

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年5月21日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCバランスファンド30 DCバランスファンド50 DCバランスファンド70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	DCバランスファンド30 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド50 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド70 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCバランスファンド30

DCバランスファンド50

DCバランスファンド70

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

平成30年 5月22日から平成30年11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：http://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の有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

- 資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。

DCバランスファンド30(以下「DCバランス30」という場合があります。)

DCバランスファンド50(以下「DCバランス50」という場合があります。)

DCバランスファンド70(以下「DCバランス70」という場合があります。)

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

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

※各マザーファンドの運用にあたっては、三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。ただし、今後変更となる場合があります。

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

原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、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。運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報(ネガティブ銘柄の選定にかかる情報を含みます。)の提供を受け活用します。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。運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。日次でベンチマークとの収益率乖離をチェックした上で、ポートフォリオとベンチマークの諸属性の乖離を極小化します。また、キャッシュポジションは債券先物を用いてヘッジし、ベンチマークとの連動性を高めます。

外国株式マザーファンド

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。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。運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。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。

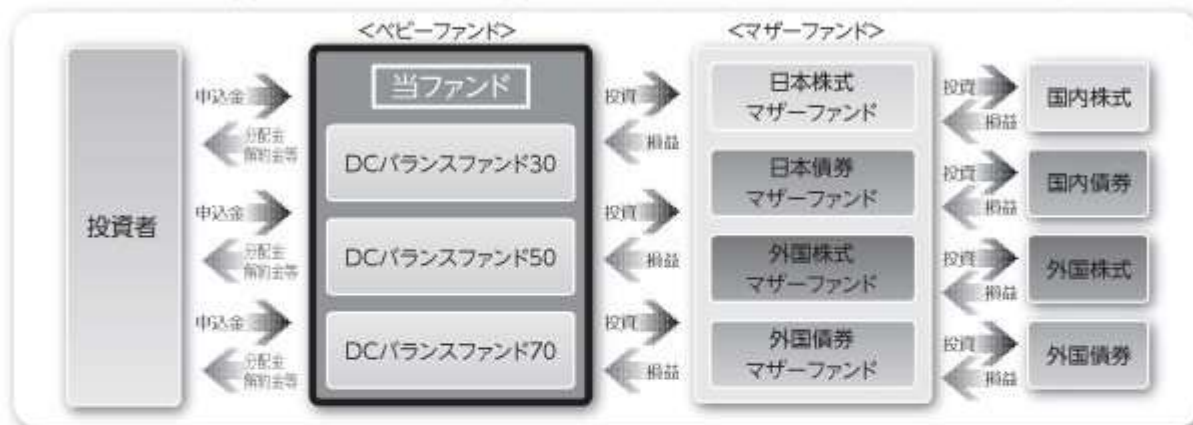
●複合指数について

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、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

「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。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。

なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

日本債券マザーファンド【NOMURA-BPI総合】

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

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

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

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

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

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

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

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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】

平成18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

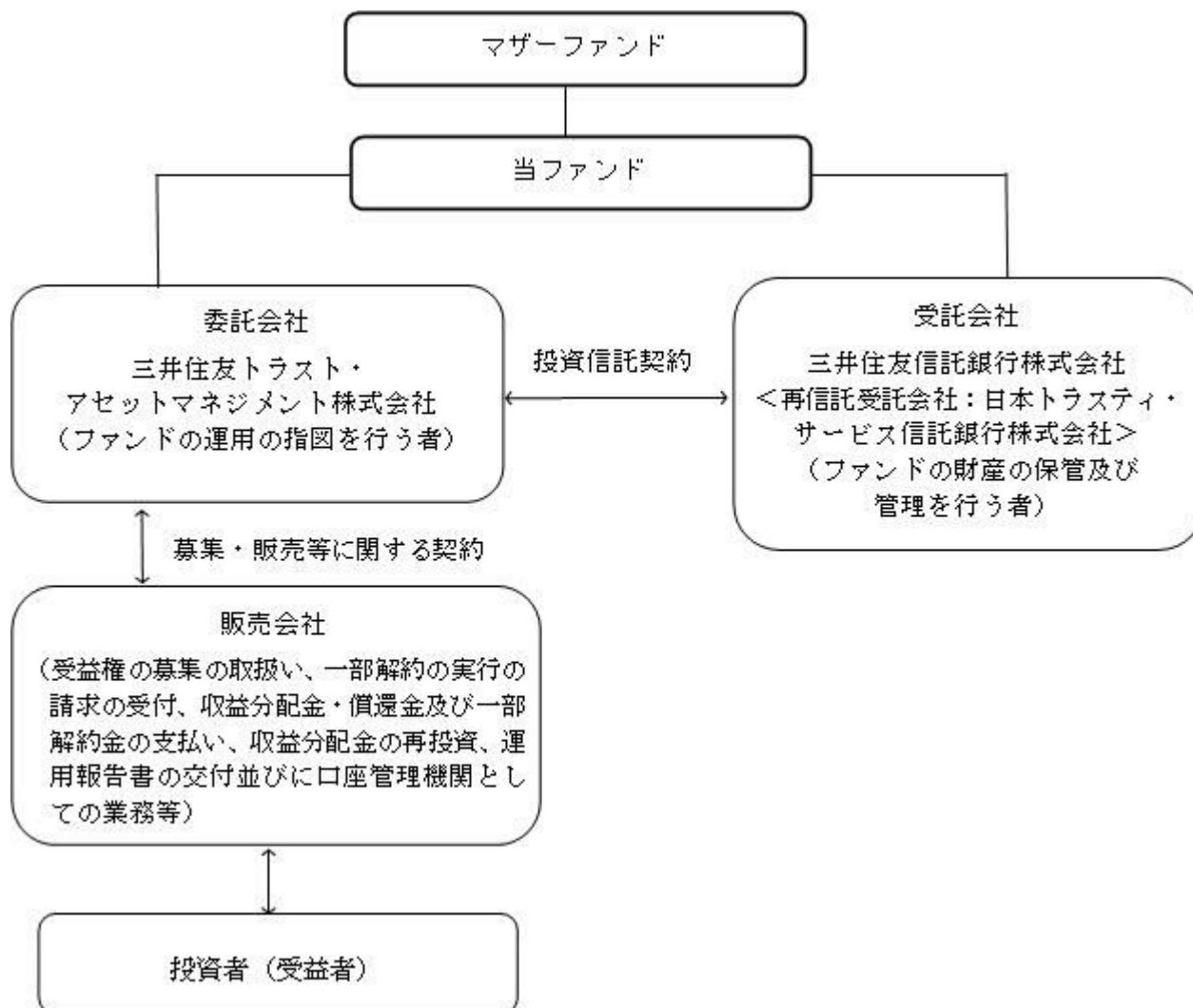
平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

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

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

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成30年 3月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

昭和61年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年2月20日：	投資顧問業の登録
昭和62年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
平成2年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11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
平成11年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
平成19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）
平成24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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

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

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

B．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

20． 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21． 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22． 外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1． 預金

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

3． コール・ローン

4． 手形割引市場において売買される手形

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

6． 外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

B． 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総

額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

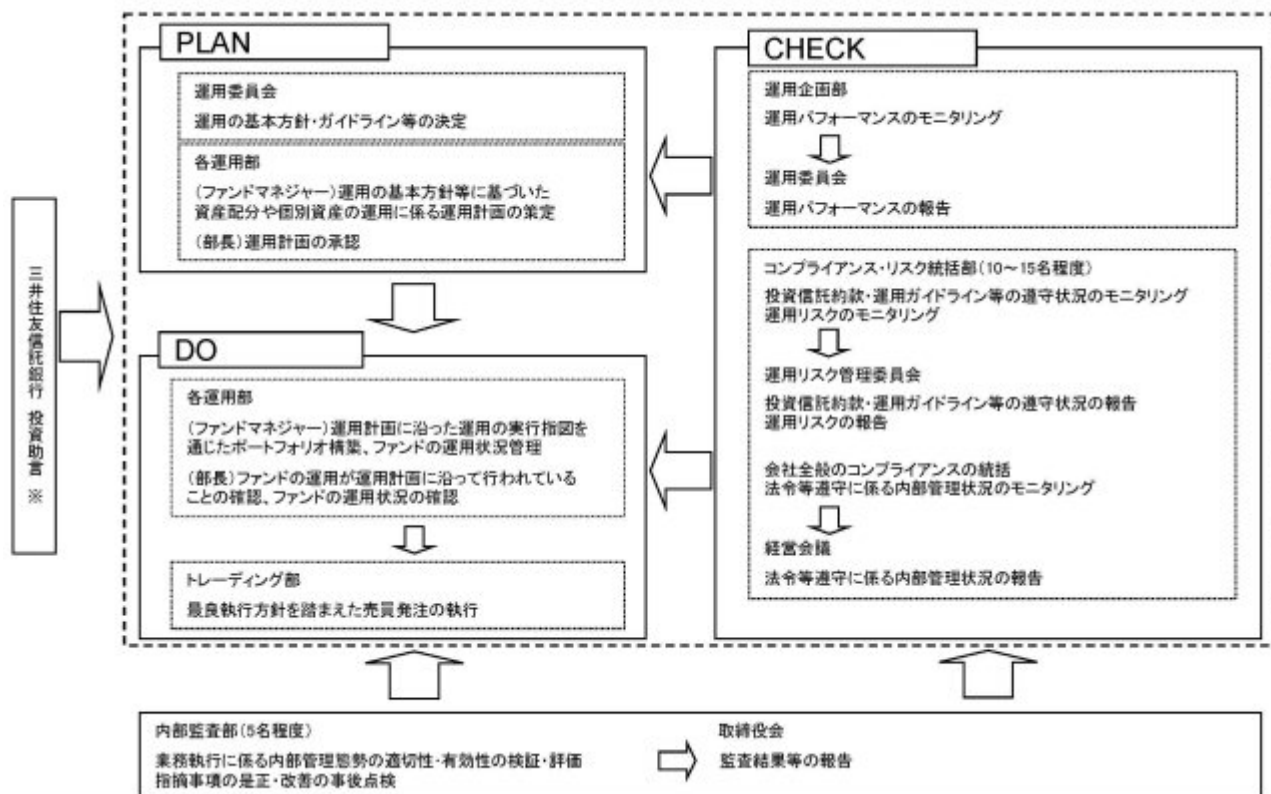
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A. 株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の60%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の80%以下

B. 外貨建資産の投資割合

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

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の30%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の45%以下

C. 新株引受権証券等への投資割合

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

D. 投資信託証券への投資割合

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

E. 同一銘柄の株式への投資制限

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

F. 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

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

G. 同一銘柄の転換社債等への投資制限

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

H. 投資する株式等の範囲

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

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

I. 信用取引の指図範囲

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

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

ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ.の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付け

の一部を決済するための指図をするものとします。

J．先物取引等の運用指図

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

K．スワップ取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次のa．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売

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

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

○．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。

ウ．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。

ヴ．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、上記イ．からオ．まで、及びク．からス．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。

ウ．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。

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻し

に相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

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

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

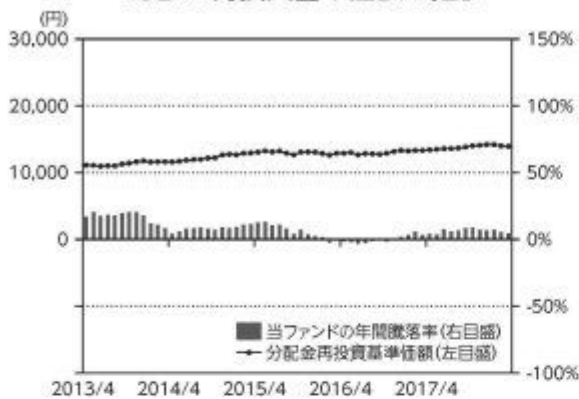
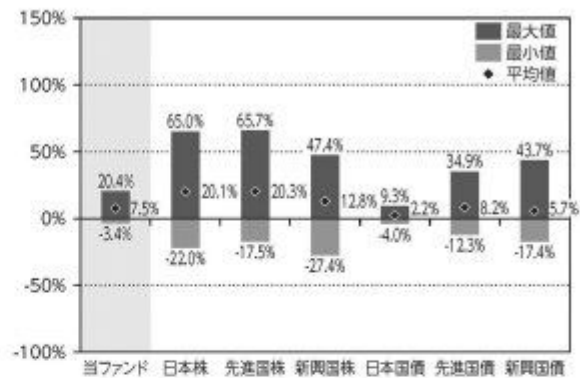
委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

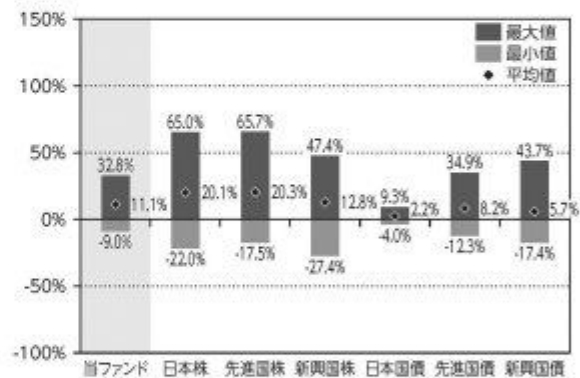
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

〔参考情報〕

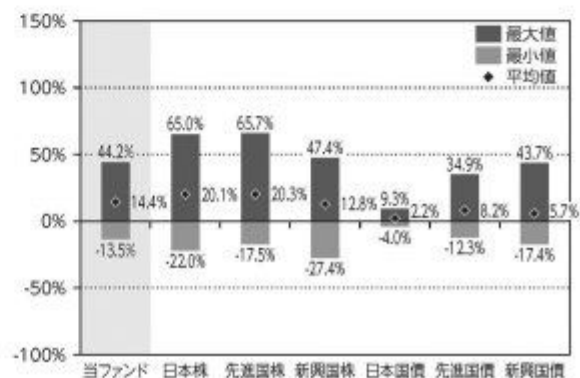
DCバランスファンド30

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。

*2013年4月～2018年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}

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)^{※3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}

新興国債… JPMオルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)^{※6}

(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。

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「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。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※2 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。

※3 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。

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

※6 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は其の完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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せん。

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

DCバランスファンド30：年率 0.2268%（税抜 0.21%）（ ）

DCバランスファンド50：年率 0.2376%（税抜 0.22%）

DCバランスファンド70：年率 0.2484%（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 0.1188%（税抜 0.11%） DCバランスファンド50：年率 0.1296%（税抜 0.12%） DCバランスファンド70：年率 0.1404%（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 0.0648%（税抜 0.06%） DCバランスファンド50：年率 0.0648%（税抜 0.06%） DCバランスファンド70：年率 0.0648%（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 0.0432%（税抜 0.04%） DCバランスファンド50：年率 0.0432%（税抜 0.04%） DCバランスファンド70：年率 0.0432%（税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（4）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、平成30年 3月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成30年 3月30日現在の状況について記載してあります。

【DCバランスファンド30】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	16,488,991,318	99.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		45,436,090	0.27
合計(純資産総額)		16,534,427,408	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	日本債券マザーファンド	7,318,966,954	1.3545	9,913,622,557	1.3585	9,942,816,607	60.13
日本	親投資信託受 益証券	日本株式マザーファンド	1,846,668,043	1.8146	3,351,087,134	1.7858	3,297,779,791	19.94
日本	親投資信託受 益証券	外国株式マザーファンド	670,925,457	2.5603	1,717,816,995	2.4666	1,654,904,732	10.01
日本	親投資信託受 益証券	外国債券マザーファンド	686,967,662	2.3143	1,589,878,270	2.3196	1,593,490,188	9.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	99.73
合計	99.73

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期計算期間末 (平成21年 2月23日)	489,951,465	489,951,465	8,319	8,319
第4期計算期間末 (平成22年 2月22日)	764,881,499	764,881,499	9,240	9,240
第5期計算期間末 (平成23年 2月21日)	1,240,531,245	1,240,531,245	9,542	9,542
第6期計算期間末 (平成24年 2月21日)	1,662,222,385	1,662,222,385	9,432	9,432
第7期計算期間末 (平成25年 2月21日)	2,268,392,887	2,268,392,887	10,435	10,435
第8期計算期間末 (平成26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 (平成27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 (平成28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 (平成29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 (平成30年 2月21日)	16,338,867,196	16,338,867,196	13,983	13,983
平成29年 3月末日	14,444,386,405		13,290	

4月末日	14,637,875,522		13,380
5月末日	14,842,067,898		13,469
6月末日	15,268,792,188		13,570
7月末日	15,360,590,758		13,592
8月末日	15,514,180,974		13,644
9月末日	15,808,496,107		13,814
10月末日	15,982,906,421		14,001
11月末日	16,191,026,595		14,076
12月末日	16,409,140,940		14,186
平成30年 1月末日	16,612,085,762		14,188
2月末日	16,461,417,324		14,007
3月末日	16,534,427,408		13,909

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	0
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	0
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	0
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	0
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	0
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	0
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	0
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	0
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	0
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	16.5
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	11.1
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	3.3
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	1.2
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	10.6
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	11.3
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	10.3
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	2.2
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	6.2
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2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3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	327,418,655	41,188,731	588,941,140
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	276,339,898	37,469,243	827,811,795
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	528,536,037	56,221,849	1,300,125,983
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	544,218,204	82,011,582	1,762,332,605
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	548,368,354	136,959,287	2,173,741,672
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	2,244,075,796	263,589,279	4,154,228,189
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	3,774,064,767	427,446,160	7,500,846,796
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	2,707,951,316	506,368,389	9,702,429,723
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	1,522,635,571	541,752,943	10,683,312,351
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	1,622,030,510	620,753,783	11,684,589,078

(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	16,893,123,549	99.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		45,537,497	0.27
合計(純資産総額)		16,938,661,046	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	5,074,738,357	1.3545	6,873,776,996	1.3585	6,894,032,057	40.70
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,832,791,409	1.8149	5,141,252,731	1.7858	5,058,798,898	29.87
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,358,100,628	2.5610	3,478,136,485	2.4666	3,349,891,009	19.78

日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	685,636,138	2.3146	1,587,010,948	2.3196	1,590,401,585	9.39
----	-----------	-------------	-------------	--------	---------------	--------	---------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.73
合計	99.73

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期計算期間末	(平成21年 2月23日)	800,476,869	800,476,869	7,111	7,111
第4期計算期間末	(平成22年 2月22日)	1,314,047,176	1,314,047,176	8,403	8,403
第5期計算期間末	(平成23年 2月21日)	1,976,927,724	1,976,927,724	8,829	8,829
第6期計算期間末	(平成24年 2月21日)	2,507,016,786	2,507,016,786	8,507	8,507
第7期計算期間末	(平成25年 2月21日)	3,400,936,257	3,400,936,257	9,831	9,831
第8期計算期間末	(平成26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	(平成27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	(平成28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	(平成29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	(平成30年 2月21日)	16,857,871,211	16,857,871,211	14,889	14,889
	平成29年 3月末日	14,716,154,420		13,788	
	4月末日	14,909,294,596		13,895	
	5月末日	15,230,547,410		14,048	
	6月末日	15,694,944,793		14,223	
	7月末日	15,839,755,077		14,263	
	8月末日	15,947,558,950		14,296	
	9月末日	16,357,213,138		14,612	

10月末日	16,614,921,102		14,925
11月末日	16,737,173,704		15,029
12月末日	17,017,626,208		15,216
平成30年 1月末日	17,288,384,261		15,255
2月末日	16,996,160,213		14,924
3月末日	16,938,661,046		14,721

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	0
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	0
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	0
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	0
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	0
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	0
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	0
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	0
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	0
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	27.1
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	18.2
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	5.1
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	3.6
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	15.6
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	17.3
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	14.9
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	5.7
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	10.7
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	7.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	608,149,401	75,873,224	1,125,620,989
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	484,735,806	46,513,105	1,563,843,690
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	738,290,364	62,969,453	2,239,164,601
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	858,899,500	150,985,019	2,947,079,082
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	737,283,783	225,124,733	3,459,238,132
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	1,127,761,819	394,119,618	4,192,880,333
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	3,890,146,207	337,276,922	7,745,749,618
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	2,389,338,964	521,486,140	9,613,602,442
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	1,427,316,438	535,903,642	10,505,015,238
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	1,604,824,267	787,711,888	11,322,127,617

(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	6,524,020,686	99.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,479,279	0.27
合計(純資産総額)		6,541,499,965	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,466,285,707	1.8151	2,661,537,706	1.7858	2,618,493,015	40.03
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	782,224,072	2.5614	2,003,640,565	2.4666	1,929,433,895	29.50
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	1,237,571,464	1.3545	1,676,300,518	1.3585	1,681,240,833	25.70
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	127,113,702	2.3149	294,266,511	2.3196	294,852,943	4.51

(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	99.73
合計	99.73

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第3期計算期間末 (平成21年 2月23日)	356,433,749	356,433,749	6,079	6,079
第4期計算期間末 (平成22年 2月22日)	618,239,337	618,239,337	7,617	7,617
第5期計算期間末 (平成23年 2月21日)	887,132,636	887,132,636	8,169	8,169
第6期計算期間末 (平成24年 2月21日)	1,010,509,539	1,010,509,539	7,652	7,652
第7期計算期間末 (平成25年 2月21日)	1,396,043,467	1,396,043,467	9,146	9,146
第8期計算期間末 (平成26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 (平成27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 (平成28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 (平成29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 (平成30年 2月21日)	6,554,623,946	6,554,623,946	15,405	15,405
平成29年 3月末日	5,518,193,251		13,927	
4月末日	5,604,658,361		14,048	
5月末日	5,707,361,916		14,251	
6月末日	5,868,715,696		14,485	
7月末日	5,925,435,189		14,543	
8月末日	5,981,037,077		14,549	
9月末日	6,187,585,968		15,001	
10月末日	6,386,225,437		15,435	
11月末日	6,481,323,425		15,570	
12月末日	6,649,419,202		15,823	
平成30年 1月末日	6,802,687,293		15,919	
2月末日	6,615,185,443		15,456	
3月末日	6,541,499,965		15,140	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	0
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	0
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	0
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	0
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	0
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	0
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	0
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	0
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	0
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	36.2
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	25.3
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	7.2
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	6.3
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	19.5
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	22.3
第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	19.1
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	8.8
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	15.2
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	10.0

(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3期計算期間	平成20年 2月22日～平成21年 2月23日	264,085,592	44,158,140	586,346,070
第4期計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	274,430,106	49,090,538	811,685,638
第5期計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月21日	339,859,039	65,511,771	1,086,032,906
第6期計算期間	平成23年 2月22日～平成24年 2月21日	324,628,476	90,057,030	1,320,604,352
第7期計算期間	平成24年 2月22日～平成25年 2月21日	336,941,132	131,115,473	1,526,430,011
第8期計算期間	平成25年 2月22日～平成26年 2月21日	749,827,425	256,234,473	2,020,022,963

第9期計算期間	平成26年 2月22日～平成27年 2月23日	1,564,258,884	299,743,427	3,284,538,420
第10期計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	721,489,462	400,760,508	3,605,267,374
第11期計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月21日	578,597,748	280,214,854	3,903,650,268
第12期計算期間	平成29年 2月22日～平成30年 2月21日	820,305,427	469,118,909	4,254,836,786

(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	227,791,882,040	97.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,994,028,069	2.15
合計(純資産総額)		232,785,910,109	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	4,977,850,000	2.14

(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	1,129,000	7,674.94	8,665,017,800	6,825.00	7,705,425,000	3.31
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,412,200	877.81	5,628,756,540	697.00	4,469,303,400	1.92
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	412,600	9,267.53	3,823,785,800	7,950.00	3,280,170,000	1.41
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	654,000	5,238.62	3,426,060,000	4,900.00	3,204,600,000	1.38
日本	株式	ソニー	電気機器	620,400	5,570.80	3,456,127,800	5,146.00	3,192,578,400	1.37

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	693,300	5,255.69	3,643,771,300	4,458.00	3,090,731,400	1.33
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	835,800	3,979.13	3,325,762,000	3,660.00	3,059,028,000	1.31
日本	株式	キーエンス	電気機器	45,600	71,455.26	3,258,360,000	66,040.00	3,011,424,000	1.29
日本	株式	任天堂	その他製品	57,200	48,455.50	2,771,655,000	46,860.00	2,680,392,000	1.15
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,444,400	214.75	2,672,542,310	191.40	2,381,858,160	1.02
日本	株式	ファナック	電気機器	88,300	31,942.29	2,820,505,000	26,960.00	2,380,568,000	1.02
日本	株式	KDDI	情報・通信業	820,600	2,753.90	2,259,856,750	2,716.50	2,229,159,900	0.96
日本	株式	キヤノン	電気機器	499,900	4,356.57	2,177,854,300	3,853.00	1,926,114,700	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	641,800	3,167.61	2,032,976,800	2,862.00	1,836,831,600	0.79
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	674,600	2,717.74	1,833,393,250	2,716.50	1,832,550,900	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	111,800	17,819.44	1,992,213,500	16,390.00	1,832,402,000	0.79
日本	株式	花王	化学	228,400	7,690.49	1,756,509,900	7,981.00	1,822,860,400	0.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	684,600	2,795.63	1,913,894,400	2,644.50	1,810,424,700	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	162,000	12,489.58	2,023,312,500	11,005.00	1,782,810,000	0.77
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	342,100	6,487.56	2,219,396,200	5,183.00	1,773,104,300	0.76
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	576,600	3,647.54	2,103,173,800	3,066.00	1,767,855,600	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	383,400	4,573.95	1,753,656,000	4,564.00	1,749,837,600	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,230,000	931.81	2,077,954,100	770.80	1,718,884,000	0.74
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	83,200	20,801.73	1,730,704,000	20,130.00	1,674,816,000	0.72
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	166,800	11,412.72	1,903,642,500	9,862.00	1,644,981,600	0.71
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	345,100	5,322.66	1,836,850,600	4,735.00	1,634,048,500	0.70
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,060,900	1,699.79	1,803,311,750	1,521.00	1,613,628,900	0.69
日本	株式	小松製作所	機械	448,500	4,286.58	1,922,531,600	3,547.00	1,590,829,500	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	928,600	2,121.68	1,970,196,950	1,701.50	1,580,012,900	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	954,400	1,398.17	1,334,420,400	1,614.00	1,540,401,600	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	3.12
		食料品	4.27
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.16
		医薬品	4.61
		石油・石炭製品	0.66
		ゴム製品	0.86

ガラス・土石製品	0.95
鉄鋼	1.04
非鉄金属	0.89
金属製品	0.66
機械	5.35
電気機器	13.59
輸送用機器	8.57
精密機器	1.59
その他製品	2.22
電気・ガス業	1.58
陸運業	3.89
海運業	0.20
空運業	0.61
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.19
卸売業	4.61
小売業	4.82
銀行業	6.89
証券、商品先物取引業	0.95
保険業	2.13
その他金融業	1.21
不動産業	2.32
サービス業	4.34
小計	97.85
合計	97.85

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	290円		4,918,974,820	4,977,850,000	2.14

(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	255,897,503,200	82.64
地方債証券	日本	17,313,524,561	5.59
特殊債券	日本	21,717,755,547	7.01
社債券	日本	11,534,540,000	3.73
	フランス	1,003,200,000	0.32
	イギリス	100,914,000	0.03
	スペイン	100,626,000	0.03
	スウェーデン	100,277,000	0.03
	オーストラリア	100,265,000	0.03
	カナダ	99,989,000	0.03
	小計		13,039,811,000
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,666,368,336	0.54
合計（純資産総額）		309,634,962,644	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	日本	904,620,000	0.29

(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	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127回利付国債(5年)	3,820,000,000	100.61	3,843,531,200	100.65	3,844,944,600	0.100	2021/3/20	1.24
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,570,000,000	100.96	3,604,451,100	101.04	3,607,235,100	0.100	2022/12/20	1.16
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,165,000,000	100.37	3,176,871,400	100.67	3,186,458,700	0.100	2027/12/20	1.03
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	2,870,000,000	100.67	2,889,458,600	100.76	2,891,955,500	0.100	2021/9/20	0.93

日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	2,870,000,000	100.58	2,886,703,400	100.59	2,887,191,300	0.100	2020/12/20	0.93
日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	2,770,000,000	100.41	2,781,357,000	100.39	2,780,941,500	0.100	2019/12/20	0.90
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,660,000,000	104.10	2,769,272,800	104.24	2,772,943,600	0.600	2024/6/20	0.90
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	2,660,000,000	104.01	2,766,666,000	104.10	2,769,166,400	0.600	2024/3/20	0.89
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	2,735,000,000	100.42	2,746,487,000	100.78	2,756,387,700	0.100	2027/6/20	0.89
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	2,645,000,000	102.99	2,724,085,500	103.29	2,732,152,750	0.400	2025/6/20	0.88
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,625,000,000	103.56	2,718,660,000	103.73	2,723,043,750	0.500	2024/9/20	0.88
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	2,700,000,000	100.38	2,710,260,000	100.75	2,720,385,000	0.100	2027/9/20	0.88
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	2,680,000,000	100.48	2,693,051,600	100.87	2,703,342,800	0.100	2026/12/20	0.87
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	2,570,000,000	103.02	2,647,665,400	103.33	2,655,658,100	0.400	2025/9/20	0.86
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	2,630,000,000	100.49	2,642,965,900	100.49	2,643,123,700	0.100	2020/6/20	0.85
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	2,605,000,000	100.62	2,621,359,400	100.98	2,630,711,350	0.100	2026/6/20	0.85
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	2,530,000,000	103.87	2,628,138,700	103.96	2,630,263,900	0.600	2023/12/20	0.85
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	2,585,000,000	100.40	2,595,340,000	100.80	2,605,809,250	0.100	2027/3/20	0.84
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	2,470,000,000	103.00	2,544,256,000	103.25	2,550,299,700	0.400	2025/3/20	0.82
日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	2,490,000,000	100.64	2,506,135,200	100.70	2,507,654,100	0.100	2021/6/20	0.81
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	2,390,000,000	102.24	2,443,703,300	102.49	2,449,654,400	0.300	2024/12/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,245,000,000	104.71	2,350,919,100	104.71	2,350,874,200	0.800	2023/6/20	0.76
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	2,320,000,000	100.46	2,330,741,600	100.44	2,330,254,400	0.100	2020/3/20	0.75
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	2,205,000,000	104.08	2,295,118,350	104.10	2,295,559,350	0.800	2022/9/20	0.74
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	2,200,000,000	100.53	2,211,704,000	100.54	2,211,968,000	0.100	2020/9/20	0.71
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	2,160,000,000	100.56	2,172,096,000	100.93	2,180,131,200	0.100	2026/9/20	0.70
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	2,120,000,000	102.33	2,169,396,000	102.63	2,175,777,200	0.300	2025/12/20	0.70
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,037,000,000	103.80	2,114,426,370	103.59	2,110,230,150	1.200	2020/12/20	0.68
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,040,000,000	102.70	2,095,080,000	102.45	2,090,143,200	1.300	2019/12/20	0.68
日本	国債証券	第37回利付国債（30年）	1,565,000,000	127.10	1,989,115,000	128.69	2,014,076,750	1.900	2042/9/20	0.65

(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	82.64

地方債証券	5.59
特殊債券	7.01
社債券	4.21
合計	99.46

(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	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 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	6円		905,351,944	904,620,000	0.29

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

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

外国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	130,285,835,070	57.86
	イギリス	14,291,851,142	6.35
	ドイツ	8,605,394,308	3.82
	フランス	8,439,277,075	3.75
	カナダ	7,995,806,074	3.55
	スイス	7,530,858,054	3.34
	オーストラリア	5,174,623,512	2.30
	オランダ	4,385,838,682	1.95
	アイルランド	3,019,460,094	1.34
	スペイン	2,821,679,861	1.25
	スウェーデン	2,346,442,164	1.04
	香港	2,035,505,893	0.90
	イタリア	1,803,447,195	0.80
	シンガポール	1,657,017,189	0.74
	デンマーク	1,581,121,629	0.70

	ジャージー	1,067,405,720	0.47
	バミューダ	1,014,701,861	0.45
	ベルギー	997,553,461	0.44
	フィンランド	895,779,244	0.40
	ノルウェー	631,710,504	0.28
	ケイマン	629,547,348	0.28
	キュラソー	533,324,432	0.24
	イスラエル	399,547,080	0.18
	ルクセンブルク	284,237,506	0.13
	オーストリア	231,574,459	0.10
	ポルトガル	136,270,698	0.06
	ニュージーランド	134,403,588	0.06
	パナマ	130,628,393	0.06
	リベリア	122,147,432	0.05
	マン島	69,556,586	0.03
	英ヴァージン諸島	53,270,878	0.02
	パプアニューギニア	40,093,116	0.02
	モーリシャス	13,801,919	0.01
	小計	209,359,712,167	92.98
投資信託受益証券	オーストラリア	106,152,951	0.05
	香港	48,391,147	0.02
	シンガポール	9,370,899	0.00
	小計	163,914,997	0.07
投資証券	アメリカ	3,725,966,358	1.65
	オーストラリア	441,681,417	0.20
	フランス	268,289,916	0.12
	イギリス	189,131,751	0.08
	香港	112,036,730	0.05
	シンガポール	83,614,827	0.04
	カナダ	41,728,698	0.02
	小計	4,862,449,697	2.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,777,319,584	4.79
合計(純資産総額)		225,163,396,445	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	7,033,847,616	3.12
	買建	カナダ	552,308,472	0.25
	買建	ドイツ	1,761,247,728	0.78
	買建	イギリス	874,366,533	0.39
	買建	オーストラリア	480,111,804	0.21

(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		993,218,650	0.44
	売建		51,288,600	0.02

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	288,074	17,332.66	4,993,090,798	17,824.94	5,134,903,840	2.28
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	411,440	9,681.85	3,983,503,941	9,696.52	3,989,538,164	1.77
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	23,001	153,049.98	3,520,302,669	153,765.40	3,536,758,002	1.57
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	195,233	11,901.52	2,323,570,153	11,683.21	2,280,948,685	1.01

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	134,069	19,559.51	2,622,324,350	16,976.08	2,275,967,357	1.01
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	151,174	13,970.84	2,112,029,185	13,614.65	2,058,182,006	0.91
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	17,680	114,549.74	2,025,239,414	109,617.36	1,938,035,095	0.86
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	238,496	8,295.96	1,978,554,466	7,926.56	1,890,454,380	0.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,785	114,939.05	1,929,251,980	110,185.75	1,849,467,874	0.82
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	557,893	3,310.84	1,847,096,830	3,186.13	1,777,523,864	0.79
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	71,568	21,348.34	1,527,858,406	21,192.75	1,516,723,104	0.67
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	262,606	6,089.41	1,599,117,672	5,568.03	1,462,200,292	0.65
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	173,575	8,547.56	1,483,644,392	8,418.77	1,461,288,801	0.65
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	261,696	4,766.90	1,247,479,796	5,532.97	1,447,958,525	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	107,197	12,383.41	1,327,465,228	12,115.60	1,298,757,002	0.58
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	341,905	3,905.76	1,335,401,848	3,787.45	1,294,950,144	0.58
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	101,873	12,723.30	1,296,160,928	12,708.42	1,294,645,767	0.57
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	278,442	4,280.04	1,191,743,131	4,556.63	1,268,758,173	0.56
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	336,373	3,744.80	1,259,652,836	3,770.45	1,268,280,134	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	65,647	20,221.08	1,327,453,419	18,936.21	1,243,105,877	0.55
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	54,672	23,886.32	1,305,913,378	22,735.36	1,242,987,602	0.55
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	142,020	8,735.19	1,240,572,254	8,422.70	1,196,192,877	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	227,211	5,380.67	1,222,549,433	5,080.39	1,154,322,037	0.51
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	31,940	36,266.70	1,158,358,562	34,833.97	1,112,597,040	0.49
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,118,989	1,083.77	1,212,728,388	990.38	1,108,225,847	0.49
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	150,778	7,940.19	1,197,206,956	7,171.20	1,081,259,194	0.48
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	124,263	8,802.11	1,093,777,100	8,601.35	1,068,830,276	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	225,830	4,733.66	1,069,002,834	4,614.00	1,041,980,343	0.46
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	52,571	17,966.36	944,509,540	18,608.99	978,293,655	0.43
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	39,272	24,284.32	953,694,027	24,392.40	957,938,451	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	6.27
		素材	4.74
		資本財	7.20
		商業・専門サービス	0.99
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.50
		耐久消費財・アパレル	1.74
		消費者サービス	1.79
		メディア	2.08
		小売	4.20
		食品・生活必需品小売り	1.55
		食品・飲料・タバコ	4.85
		家庭用品・パーソナル用品	1.89
		ヘルスケア機器・サービス	4.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.62
		銀行	9.21
		各種金融	4.51
		保険	3.93
		不動産	0.60
		ソフトウェア・サービス	10.29
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.98		
電気通信サービス	2.28		
公益事業	2.87		
半導体・半導体製造装置	3.00		
	小計	92.98	
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.16
合計			95.21

(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	501	アメリカドル	69,549,514.5	7,388,940,420	66,207,150	7,033,847,616	3.12
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	37	カナダドル	6,788,330.5	559,222,667	6,704,400	552,308,472	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	48	スイスフラン	4,152,146	462,258,413	4,126,560	459,409,924	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	304	ユーロ	10,020,578	1,307,885,840	9,974,240	1,301,837,804	0.58
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	41	オーストラリアドル	6,101,287	498,231,096	5,879,400	480,111,804	0.21
	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	84	イギリスポンド	5,909,040	879,501,513	5,874,540	874,366,533	0.39

(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	6,991,000.00	741,867,442	742,094,650	0.33
	ユーロ	買建	1,200,000.00	157,544,040	156,636,000	0.07
	イギリスポンド	買建	635,000.00	93,854,841	94,488,000	0.04
	アメリカドル	売建	360,000.00	38,303,940	38,236,600	0.02
	ユーロ	売建	100,000.00	13,157,640	13,052,000	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	57,459,019,670	40.73
	フランス	14,485,891,751	10.27
	イタリア	13,742,373,450	9.74
	イギリス	9,875,982,722	7.00
	ドイツ	9,843,385,240	6.98
	スペイン	8,518,034,286	6.04
	ベルギー	3,535,198,619	2.51

	オランダ	2,987,600,776	2.12
	オーストラリア	2,892,498,838	2.05
	カナダ	2,831,061,725	2.01
	オーストリア	2,172,095,861	1.54
	アイルランド	1,156,324,446	0.82
	メキシコ	1,137,317,395	0.81
	ポーランド	938,391,052	0.67
	南アフリカ	925,932,224	0.66
	フィンランド	884,184,150	0.63
	デンマーク	820,876,806	0.58
	マレーシア	669,228,555	0.47
	シンガポール	545,867,161	0.39
	スウェーデン	531,595,337	0.38
	ノルウェー	415,617,464	0.29
	スイス	241,605,621	0.17
	小計	136,610,083,149	96.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,467,569,108	3.17
合計(純資産総額)		141,077,652,257	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	559,456,532	0.40
	買建	ドイツ	809,512,449	0.57

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,867,854,200	1.32

(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	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	9,800,000	10,935.07	1,071,637,002	10,886.71	1,066,898,522	3.625	2020/2/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	8,250,000	10,437.50	861,094,295	10,423.92	859,973,698	1.375	2020/4/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	8,100,000	10,133.25	820,793,527	10,144.83	821,731,400	1.625	2023/4/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	8,300,000	9,590.77	796,034,570	9,649.05	800,871,429	1.500	2026/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,200,000	10,766.97	775,222,485	10,938.55	787,576,056	3.125	2044/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	7,250,000	10,684.08	774,596,077	10,694.49	775,350,542	2.750	2024/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	7,050,000	10,996.62	775,262,017	10,991.02	774,867,373	3.625	2021/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/15/19	7,100,000	10,423.89	740,096,563	10,418.78	739,733,539	0.875	2019/9/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	7,050,000	10,265.22	723,698,165	10,429.72	735,295,295	2.875	2045/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	7,500,000	9,502.06	712,654,852	9,666.05	724,954,138	2.500	2046/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/22	6,800,000	10,420.28	708,579,163	10,421.84	708,685,772	2.125	2022/12/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/23	7,100,000	9,934.93	705,380,619	9,958.98	707,088,167	1.375	2023/9/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	6,700,000	10,312.86	690,961,720	10,472.30	701,644,186	2.875	2043/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	10,423.87	698,399,957	10,446.36	699,906,434	2.375	2024/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	5,850,000	11,726.90	686,023,927	11,900.41	696,174,150	3.625	2044/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	7,450,000	8,987.97	669,603,841	9,147.08	681,457,554	2.250	2046/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	6,250,000	10,880.24	680,015,394	10,849.02	678,063,884	3.125	2021/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	10,348.62	672,660,595	10,355.27	673,092,968	2.000	2023/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	6,500,000	10,247.31	666,075,649	10,286.97	668,653,330	2.250	2025/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	6,330,000	10,136.51	641,641,626	10,191.81	645,141,872	2.250	2027/8/15	0.46
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	3,960,000	16,097.35	637,455,373	16,281.97	644,766,346	3.500	2026/4/25	0.46
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	4,350,000	14,704.64	639,652,025	14,692.57	639,126,845	3.250	2021/10/25	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	5,900,000	10,861.94	640,854,885	10,814.68	638,066,401	3.375	2019/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 07/31/22	6,000,000	10,401.23	624,073,858	10,399.80	623,988,556	2.000	2022/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/20	6,000,000	10,375.09	622,505,495	10,362.90	621,774,281	1.375	2020/10/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	10,137.11	613,295,279	10,168.01	615,164,935	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 05/31/22	5,850,000	10,364.93	606,348,414	10,361.93	606,172,919	1.875	2022/5/31	0.43
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 09/01/19	4,350,000	13,971.18	607,746,639	13,907.55	604,978,799	4.250	2019/9/1	0.43
イタリア	国債証券	BTPS 4.75% 09/01/21	3,990,000	15,087.26	601,981,818	15,097.63	602,395,834	4.750	2021/9/1	0.43
アメリカ	国債証券	T 3.625% 08/15/19	5,500,000	10,870.67	597,887,069	10,825.29	595,391,385	3.625	2019/8/15	0.42

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.83
合計	96.83

(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

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	22	アメリカドル	2,509,580.24	266,617,804	2,518,140.68	267,527,265	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	13	アメリカドル	1,562,677.06	166,018,811	1,574,828.19	167,309,747	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	8	アメリカドル	1,147,594.5	121,920,439	1,173,000	124,619,520	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	10	ユーロ	1,118,290	145,959,211	1,119,750	146,149,770	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	12	ユーロ	1,565,328	204,306,610	1,575,000	205,569,000	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	22	ユーロ	3,461,788	451,832,570	3,507,460	457,793,679	0.32

(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	7,920,000.00	839,693,628	840,549,600	0.60
	カナダドル	買建	1,010,000.00	83,443,925	83,133,100	0.06
	ユーロ	買建	6,150,000.00	807,558,255	802,821,000	0.57
	イギリスポンド	買建	950,000.00	140,660,961	141,350,500	0.10

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

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

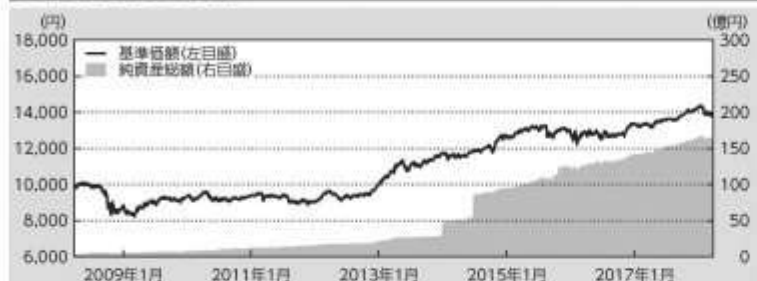
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2018年3月30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 13,909円

純資産総額 165.34億円

※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。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2014年2月	2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券マザーファンド	60.1%	第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.7%
		第134回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/12/20	0.7%
		第349回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2027/12/20	0.6%
日本株式マザーファンド	19.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.3%
外国株式マザーファンド	10.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.2%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.2%
外国債券マザーファンド	9.6%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	3.625%	2020/02/15	0.1%
		T 1.375% 04/30/20	アメリカ	国債	-	1.375%	2020/04/30	0.1%
		T 1.625% 04/30/23	アメリカ	国債	-	1.625%	2023/04/30	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。


年間収益率の推移(暦年ベース)

※2018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。

最新の運用の内容等は、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：2018年3月30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 14,721円

純資産総額 169.39億円

※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。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2014年2月	2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	40.7%	第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.5%
		第134回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/12/20	0.5%
		第349回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2027/12/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	29.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%
外国株式 マザーファンド	19.8%	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.4%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/IT機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
外国債券 マザーファンド	9.4%	AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.3%
		T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	3.625%	2020/02/15	0.1%
		T 1.375% 04/30/20	アメリカ	国債	-	1.375%	2020/04/30	0.1%
		T 1.625% 04/30/23	アメリカ	国債	-	1.625%	2023/04/30	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2018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。

最新の運用の内容等は、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：2018年3月30日

DCバランスファンド70

基準価額・純資産の推移



基準価額	15,140円
純資産総額	65.41億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間の推移を表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2014年2月	2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

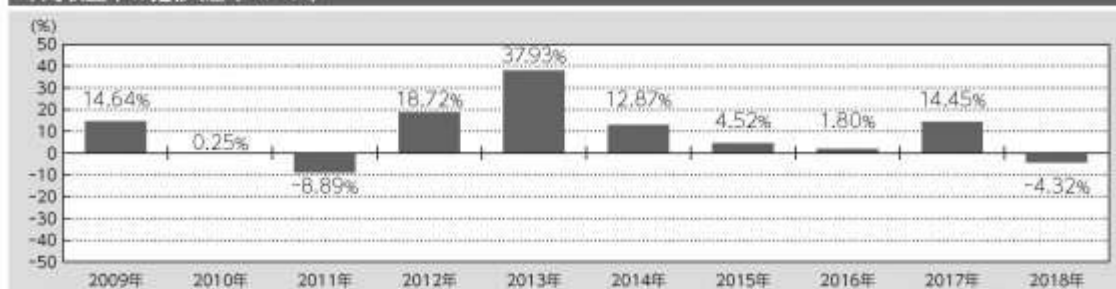
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	40.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.8%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.6%
外国株式マザーファンド	29.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	マイクロコンピュータ周辺機器	-	-	0.7%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.5%
日本債券マザーファンド	25.7%	第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.3%
		第134回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/12/20	0.3%
		第349回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2027/12/20	0.3%
外国債券マザーファンド	4.5%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	3.625%	2020/02/15	0.0%
		T 1.375% 04/30/20	アメリカ	国債	-	1.375%	2020/04/30	0.0%
		T 1.625% 04/30/23	アメリカ	国債	-	1.625%	2023/04/30	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2018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。

最新の運用の内容等は、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：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

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

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://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：<http://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。（平成18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計算期間は平成18年9月29日から平成19年2月21日までとします。

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

(5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【DCバランスファンド30】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(平成29年 2月22日から平成30年 2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	68,823,950	51,968,930
親投資信託受益証券	14,150,863,667	16,291,116,725
未収入金	13,773,217	19,424,121
流動資産合計	14,233,460,834	16,362,509,776
資産合計	14,233,460,834	16,362,509,776
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,816,574	4,850,712
未払受託者報酬	2,956,759	3,496,168
未払委託者報酬	12,566,156	14,858,632
未払利息	117	103
その他未払費用	369,535	436,965
流動負債合計	18,709,141	23,642,580
負債合計	18,709,141	23,642,580
純資産の部		
元本等		
元本	10,683,312,351	11,684,589,078
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,531,439,342	4,654,278,118
(分配準備積立金)	1,554,170,864	2,195,402,940
元本等合計	14,214,751,693	16,338,867,196
純資産合計	14,214,751,693	16,338,867,196
負債純資産合計	14,233,460,834	16,362,509,776

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日	自	平成29年 2月22日 至 平成30年 2月21日
営業収益				
受取利息		505		32
有価証券売買等損益		823,910,686		786,580,652
営業収益合計		823,911,191		786,580,684
営業費用				
支払利息		50,290		34,484
受託者報酬		5,720,104		6,667,203
委託者報酬		24,310,308		28,335,475
その他費用		724,563		833,590
営業費用合計		30,805,265		35,870,752
営業利益又は営業損失（ ）		793,105,926		750,709,932
経常利益又は経常損失（ ）		793,105,926		750,709,932
当期純利益又は当期純損失（ ）		793,105,926		750,709,932
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（ ）		19,466,687		26,932,929
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,451,409,883		3,531,439,342
剰余金増加額又は欠損金減少額		443,977,372		604,626,358
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		443,977,372		604,626,358
剰余金減少額又は欠損金増加額		137,587,152		205,564,585
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		137,587,152		205,564,585
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,531,439,342		4,654,278,118

(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11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30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	10,683,312,351口	11,684,589,078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) 1.3306円 (13,306円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3983円 (13,983円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日			第12期 自 平成29年 2月22日 至 平成30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	193,605,899円	費用控除後の配当等収益額	A	213,077,987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	148,246,163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	510,699,016円
収益調整金額	C	2,576,655,353円	収益調整金額	C	3,048,945,462円
分配準備積立金額	D	1,212,318,802円	分配準備積立金額	D	1,471,625,937円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,130,826,217円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,244,348,402円
当ファンドの期末残存口数	F	10,683,312,351口	当ファンドの期末残存口数	F	11,684,589,078口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,866円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,488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12期 自 平成29年 2月22日 至 平成30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コンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (平成30年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第11期	第12期
	自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日	自 平成29年 2月22日 至 平成30年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,702,429,723円	10,683,312,351円
期中追加設定元本額	1,522,635,571円	1,622,030,510円
期中一部解約元本額	541,752,943円	620,753,783円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30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	757,732,355	752,835,377
合計	757,732,355	752,835,377

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,809,897,220	3,286,230,382	
	日本債券マザーファンド	7,277,011,636	9,856,712,260	
	外国株式マザーファンド	657,717,884	1,685,336,305	
	外国債券マザーファンド	631,813,492	1,462,837,778	
合計		10,376,440,232	16,291,116,725	

(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12期計算期間(平成29年 2月22日から平成30年 2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	73,605,998	49,054,349
親投資信託受益証券	14,468,701,217	16,809,868,007
未収入金	9,248,084	25,270,337
流動資産合計	14,551,555,299	16,884,192,693
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,417,542	5,954,934
未払受託者報酬	2,973,723	3,620,721
未払委託者報酬	13,381,697	16,293,203
未払利息	125	97
その他未払費用	371,650	452,527
流動負債合計	18,144,737	26,321,482
負債合計	18,144,737	26,321,482
純資産の部		
元本等		
元本	10,505,015,238	11,322,127,617
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,028,395,324	5,535,743,594
(分配準備積立金)	2,470,748,042	3,393,095,276
元本等合計	14,533,410,562	16,857,871,211
純資産合計	14,533,410,562	16,857,871,211
負債純資産合計	14,551,555,299	16,884,192,693

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日	自	平成29年 2月22日 至 平成30年 2月21日
営業収益				
受取利息		571		34
有価証券売買等損益		1,392,974,272		1,186,144,506
営業収益合計		1,392,974,843		1,186,144,540
営業費用				
支払利息		37,912		34,868
受託者報酬		5,703,831		6,868,533
委託者報酬		25,667,137		30,908,319
その他費用		716,982		858,764
営業費用合計		32,125,862		38,670,484
営業利益又は営業損失（ ）		1,360,848,981		1,147,474,056
経常利益又は経常損失（ ）		1,360,848,981		1,147,474,056
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,360,848,981		1,147,474,056
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（ ）		30,374,462		55,942,677
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,402,490,498		4,028,395,324
剰余金増加額又は欠損金減少額		430,271,846		718,888,994
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		430,271,846		718,888,994
剰余金減少額又は欠損金増加額		134,841,539		303,072,103
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		134,841,539		303,072,103
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,028,395,324		5,535,743,594

(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11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30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	10,505,015,238口	11,322,127,617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) 1.3835円 (13,835円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4889円 (14,889円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日			第12期 自 平成29年 2月22日 至 平成30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	226,581,953円	費用控除後の配当等収益額	A	255,721,332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	233,961,698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	835,810,047円
収益調整金額	C	3,385,113,051円	収益調整金額	C	4,013,269,188円
分配準備積立金額	D	2,010,204,391円	分配準備積立金額	D	2,301,563,897円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,855,861,093円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,406,364,464円
当ファンドの期末残存口数	F	10,505,015,238口	当ファンドの期末残存口数	F	11,322,127,617口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,574円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,541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12期 自 平成29年 2月22日 至 平成30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コンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (平成30年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第11期	第12期
	自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日	自 平成29年 2月22日 至 平成30年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,613,602,442円	10,505,015,238円
期中追加設定元本額	1,427,316,438円	1,604,824,267円
期中一部解約元本額	535,903,642円	787,711,888円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30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	1,319,875,931	1,140,162,683
合計	1,319,875,931	1,140,162,683

（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	2,774,459,527	5,037,586,163	
	日本債券マザーファンド	5,028,569,757	6,811,197,735	
	外国株式マザーファンド	1,330,272,924	3,408,691,340	
	外国債券マザーファンド	670,493,141	1,552,392,769	
合計		9,803,795,349	16,809,868,007	

(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12期計算期間(平成29年 2月22日から平成30年 2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	29,699,811	22,318,242
親投資信託受益証券	5,440,135,847	6,536,275,789
未収入金	4,605,481	7,749,091
流動資産合計	5,474,441,139	6,566,343,122
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,960,009	3,526,504
未払受託者報酬	1,100,021	1,394,507
未払委託者報酬	5,225,039	6,623,875
未払利息	50	44
その他未払費用	137,436	174,246
流動負債合計	9,422,555	11,719,176
負債合計	9,422,555	11,719,176
純資産の部		
元本等		
元本	3,903,650,268	4,254,836,786
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,561,368,316	2,299,787,160
(分配準備積立金)	1,113,055,581	1,514,216,078
元本等合計	5,465,018,584	6,554,623,946
純資産合計	5,465,018,584	6,554,623,946
負債純資産合計	5,474,441,139	6,566,343,122

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日	自	平成29年 2月22日 至 平成30年 2月21日
営業収益				
受取利息		186		13
有価証券売買等損益		717,250,621		579,114,425
その他収益		-		141
営業収益合計		717,250,807		579,114,579
営業費用				
支払利息		20,578		13,782
受託者報酬		2,092,893		2,613,419
委託者報酬		9,941,114		12,413,659
その他費用		265,020		326,663
営業費用合計		12,319,605		15,367,523
営業利益又は営業損失（ ）		704,931,202		563,747,056
経常利益又は経常損失（ ）		704,931,202		563,747,056
当期純利益又は当期純損失（ ）		704,931,202		563,747,056
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（ ）		25,058,425		42,841,431
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		777,140,417		1,561,368,316
剰余金増加額又は欠損金減少額		165,495,132		406,907,055
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		165,495,132		406,907,055
剰余金減少額又は欠損金増加額		61,140,010		189,393,836
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		61,140,010		189,393,836
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,561,368,316		2,299,787,160

（ 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11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30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	3,903,650,268口	4,254,836,786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) 1.4000円 (14,000円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5405円 (15,405円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第11期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日			第12期 自 平成29年 2月22日 至 平成30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	90,675,604円	費用控除後の配当等収益額	A	105,710,517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	113,791,004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	415,195,108円
収益調整金額	C	1,328,368,357円	収益調整金額	C	1,669,896,739円
分配準備積立金額	D	908,588,973円	分配準備積立金額	D	993,310,453円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,441,423,938円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,184,112,817円
当ファンドの期末残存口数	F	3,903,650,268口	当ファンドの期末残存口数	F	4,254,836,786口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,254円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,483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12期 自 平成29年 2月22日 至 平成30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コンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (平成30年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第11期	第12期
	自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月21日	自 平成29年 2月22日 至 平成30年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,605,267,374円	3,903,650,268円
期中追加設定元本額	578,597,748円	820,305,427円
期中一部解約元本額	280,214,854円	469,118,909円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (平成29年 2月21日現在)	第12期 (平成30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	693,645,092	554,543,886
合計	693,645,092	554,543,886

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,440,033,173	2,614,668,232
	日本債券マザーファンド	1,229,112,306	1,664,832,618
	外国株式マザーファンド	768,186,837	1,968,401,951
	外国債券マザーファンド	124,551,025	288,372,988
合計		3,561,883,341	6,536,275,789

(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

	平成30年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,844,451,060
株式	231,766,780,190
新株予約権証券	3,308,200
派生商品評価勘定	9,937,640
未収入金	41,866,734
未収配当金	334,301,662
前払金	57,484,900
差入委託証拠金	110,430,000
流動資産合計	235,168,560,386
資産合計	235,168,560,386
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	67,439,820
未払解約金	118,854,103
未払利息	5,666
流動負債合計	186,299,589
負債合計	186,299,589
純資産の部	
元本等	
元本	129,416,349,434
剰余金	
剰余金又は欠損金()	105,565,911,363

	平成30年 2月21日現在
項目	金額（円）
元本等合計	234,982,260,797
純資産合計	234,982,260,797
負債純資産合計	235,168,560,386

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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)

	平成30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	129,416,349,434口
2. 1口当たり純資産額	1.8157円

平成30年 2月21日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (18,157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

平成30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コンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成30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)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

	平成30年 2月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成30年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 2月22日
期首元本額	143,757,669,611円
期中追加設定元本額	9,599,815,178円
期中一部解約元本額	23,941,135,355円
期末元本額	129,416,349,434円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	807,826,390円
D C 日本株式インデックスファンド	347,274,204円
D C 日本株式インデックスファンド L	52,141,363,689円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,208,882,678円
D C バランスファンド 3 0	1,809,897,220円
D C バランスファンド 5 0	2,774,459,527円
D C バランスファンド 7 0	1,440,033,173円

区分	平成30年 2月21日現在
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	623,741,167円
日本株式インデックスe	1,897,806,029円
インデックスコレクション（国内株式）	10,415,972,265円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,721,972,972円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,258,148,060円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,017,715,949円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,284,877,488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）	2,373,984,603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）	2,422,463,836円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	218,735,060円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	2,048,090,902円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	144,141,052円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	760,837,936円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	31,171,017円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	903,535,446円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,558,964,066円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	709,305,474円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,140,138,219円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,035,242,114円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	810,997,176円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,820,903,576円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	50,394,451円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	453,736,349円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	60,169,146円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,043,715,697円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	86,410,322円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	85,609,016円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	41,957,470円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,209,298,147円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	1,038,465,656円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	30,051,229円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	483,987,656円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	7,686,409,668円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	143,072,104円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	70,884,722円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,407,810円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	186,243,253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）	5,877,526円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	177,924円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成30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	17,132,810,897	
新株予約権証券	3,308,200	
合計	17,129,502,697	

(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

(平成30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	3,282,877,180	-	3,225,375,000	57,502,180
合計		3,282,877,180	-	3,225,375,000	57,502,180

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,100	3,915.00	16,051,500	
日本水産	116,000	544.00	63,104,000	
マルハニチロ	19,600	3,310.00	64,876,000	
カネコ種苗	3,600	1,604.00	5,774,400	
サカタのタネ	15,200	3,710.00	56,392,000	
ホクト	10,600	2,084.00	22,090,400	
ホクリヨウ	1,500	1,470.00	2,205,000	
住石ホールディングス	27,300	157.00	4,286,100	
日鉄鉱業	2,900	7,210.00	20,909,000	
三井松島産業	5,300	1,508.00	7,992,400	
国際石油開発帝石	501,300	1,319.00	661,214,700	
石油資源開発	16,300	2,585.00	42,135,500	

K&Oエナジーグループ	6,100	1,700.00	10,370,000	
ショーボンドホールディングス	9,700	7,640.00	74,108,000	
ミライト・ホールディングス	31,700	1,670.00	52,939,000	
タマホーム	7,800	1,183.00	9,227,400	
サンヨーホームズ	1,800	878.00	1,580,400	
ファーストコーポレーション	2,300	1,493.00	3,433,900	
ベステラ	1,400	1,871.00	2,619,400	
インベスターズクラウド	9,000	2,134.00	19,206,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,400	1,188.00	2,851,200	
第一カッター興業	1,000	2,364.00	2,364,000	
安藤・間	79,500	795.00	63,202,500	
東急建設	39,700	1,250.00	49,625,000	
コムシスホールディングス	36,300	2,817.00	102,257,100	
ミサワホーム	8,800	898.00	7,902,400	
ピーアールホールディングス	10,400	482.00	5,012,800	
高松コンストラクショングループ	6,700	2,948.00	19,751,600	
東建コーポレーション	3,900	12,020.00	46,878,000	
ソネック	1,300	779.00	1,012,700	
ヤマウラ	5,000	959.00	4,795,000	
大成建設	102,700	5,410.00	555,607,000	
大林組	309,200	1,199.00	370,730,800	
清水建設	315,400	1,015.00	320,131,000	
飛鳥建設	95,400	187.00	17,839,800	
長谷工コーポレーション	120,400	1,572.00	189,268,800	
松井建設	11,600	842.00	9,767,200	
銭高組	1,500	5,710.00	8,565,000	
鹿島建設	453,000	1,033.00	467,949,000	
不動テトラ	79,600	194.00	15,442,400	
大末建設	3,400	1,065.00	3,621,000	
鉄建建設	6,300	3,155.00	19,876,500	
西松建設	23,800	2,759.00	65,664,200	
三井住友建設	74,400	638.00	47,467,200	
大豊建設	38,000	634.00	24,092,000	
前田建設工業	73,600	1,272.00	93,619,200	
佐田建設	6,900	486.00	3,353,400	
ナカノフドー建設	8,100	634.00	5,135,400	
奥村組	17,000	4,740.00	80,580,000	
東鉄工業	12,400	3,280.00	40,672,000	
イチケン	1,900	2,490.00	4,731,000	
浅沼組	37,000	463.00	17,131,000	
戸田建設	120,000	824.00	98,880,000	
熊谷組	16,200	3,240.00	52,488,000	

青木あすなる建設	6,900	1,019.00	7,031,100	
北野建設	22,000	451.00	9,922,000	
植木組	1,300	2,707.00	3,519,100	
三井ホーム	13,000	686.00	8,918,000	
矢作建設工業	14,200	850.00	12,070,000	
ピーエス三菱	12,500	869.00	10,862,500	
日本ハウスホールディングス	20,000	644.00	12,880,000	
大東建託	37,300	17,675.00	659,277,500	
新日本建設	12,500	1,040.00	13,000,000	
N I P P O	23,900	2,540.00	60,706,000	
東亜道路工業	2,100	4,235.00	8,893,500	
前田道路	32,000	2,379.00	76,128,000	
日本道路	2,800	5,890.00	16,492,000	
東亜建設工業	8,400	2,268.00	19,051,200	
若築建設	5,600	1,724.00	9,654,400	
東洋建設	32,400	550.00	17,820,000	
五洋建設	122,600	784.00	96,118,400	
世紀東急工業	14,100	711.00	10,025,100	
福田組	3,300	6,710.00	22,143,000	
住友林業	65,900	1,847.00	121,717,300	
日本基礎技術	11,600	406.00	4,709,600	
日成ビルド工業	15,300	1,276.00	19,522,800	
巴コーポレーション	13,100	580.00	7,598,000	
大和ハウス工業	304,600	3,942.00	1,200,733,200	
ライト工業	19,900	1,176.00	23,402,400	
積水ハウス	335,500	1,883.50	631,914,250	
日特建設	8,900	662.00	5,891,800	
北陸電気工事	5,800	1,150.00	6,670,000	
ユアテック	16,200	862.00	13,964,400	
西部電気工業	1,700	2,760.00	4,692,000	
四電工	1,600	2,777.00	4,443,200	
中電工	13,300	3,010.00	40,033,000	
関電工	41,100	1,222.00	50,224,200	
きんでん	68,600	1,744.00	119,638,400	
東京エネシス	11,700	1,203.00	14,075,100	
トーエネック	2,900	3,150.00	9,135,000	
住友電設	8,100	2,316.00	18,759,600	
日本電設工業	15,800	2,191.00	34,617,800	
協和エクシオ	37,000	2,864.00	105,968,000	
新日本空調	8,100	1,625.00	13,162,500	
N D S	1,600	4,540.00	7,264,000	
九電工	20,300	5,020.00	101,906,000	

三機工業	22,000	1,189.00	26,158,000
日揮	88,800	2,410.00	214,008,000
中外炉工業	3,200	2,346.00	7,507,200
ヤマト	8,700	833.00	7,247,100
太平電業	7,000	2,633.00	18,431,000
高砂熱学工業	28,400	1,969.00	55,919,600
三晃金属工業	1,100	4,175.00	4,592,500
朝日工業社	2,200	3,525.00	7,755,000
明星工業	18,900	776.00	14,666,400
大気社	13,700	3,735.00	51,169,500
ダイダン	6,900	2,423.00	16,718,700
日比谷総合設備	11,600	2,061.00	23,907,600
東芝プラントシステム	22,500	2,136.00	48,060,000
OSJBホールディングス	46,200	310.00	14,322,000
東洋エンジニアリング	12,200	1,005.00	12,261,000
千代田化工建設	67,000	1,065.00	71,355,000
新興プランテック	19,800	1,023.00	20,255,400
日本製粉	30,600	1,645.00	50,337,000
日清製粉グループ本社	113,000	2,112.00	238,656,000
日東富士製粉	700	4,820.00	3,374,000
昭和産業	8,500	2,760.00	23,460,000
鳥越製粉	8,300	978.00	8,117,400
中部飼料	11,400	2,025.00	23,085,000
フィード・ワン	62,000	238.00	14,756,000
東洋精糖	1,600	1,225.00	1,960,000
日本甜菜製糖	5,300	2,378.00	12,603,400
三井製糖	7,300	4,265.00	31,134,500
塩水港精糖	11,200	283.00	3,169,600
日新製糖	4,400	2,201.00	9,684,400
森永製菓	21,700	5,100.00	110,670,000
中村屋	2,400	4,785.00	11,484,000
江崎グリコ	25,800	5,220.00	134,676,000
名糖産業	4,500	1,589.00	7,150,500
井村屋グループ	3,600	4,105.00	14,778,000
不二家	5,900	2,523.00	14,885,700
山崎製パン	75,500	2,080.00	157,040,000
第一屋製パン	1,600	1,152.00	1,843,200
モロゾフ	1,600	6,800.00	10,880,000
亀田製菓	5,700	5,150.00	29,355,000
寿スピリッツ	8,900	6,190.00	55,091,000
カルビー	42,100	3,675.00	154,717,500
森永乳業	18,500	4,385.00	81,122,500

六甲バター	4,600	2,317.00	10,658,200
ヤクルト本社	55,300	7,900.00	436,870,000
明治ホールディングス	61,100	7,940.00	485,134,000
雪印メグミルク	22,200	2,803.00	62,226,600
プリマハム	65,000	668.00	43,420,000
日本ハム	79,000	2,439.00	192,681,000
林兼産業	3,400	834.00	2,835,600
丸大食品	49,000	498.00	24,402,000
S Foods	6,500	4,295.00	27,917,500
伊藤ハム米久ホールディングス	59,500	923.00	54,918,500
サッポロホールディングス	33,800	3,205.00	108,329,000
アサヒグループホールディングス	193,400	5,505.00	1,064,667,000
キリンホールディングス	443,900	2,788.50	1,237,815,150
宝ホールディングス	69,100	1,335.00	92,248,500
オエノンホールディングス	26,600	407.00	10,826,200
養命酒製造	2,800	2,304.00	6,451,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	64,800	4,005.00	259,524,000
サントリー食品インターナショナル	70,600	5,000.00	353,000,000
ダイトーグループホールディングス	4,700	6,590.00	30,973,000
伊藤園	30,600	4,560.00	139,536,000
キーコーヒー	9,100	2,123.00	19,319,300
ユニカフェ	2,800	1,176.00	3,292,800
ジャパンフーズ	1,300	1,505.00	1,956,500
日清オイリオグループ	10,900	3,015.00	32,863,500
不二製油グループ本社	25,000	3,190.00	79,750,000
かどや製油	1,000	6,680.00	6,680,000
J - オイルミルズ	4,800	3,700.00	17,760,000
キッコーマン	72,100	4,270.00	307,867,000
味の素	212,400	1,968.00	418,003,200
キューピー	51,400	2,978.00	153,069,200
ハウス食品グループ本社	35,200	3,705.00	130,416,000
カゴメ	37,000	3,690.00	136,530,000
焼津水産化学工業	4,500	1,190.00	5,355,000
アリアケジャパン	8,400	8,230.00	69,132,000
ピエトロ	1,200	1,669.00	2,002,800
エバラ食品工業	2,000	2,142.00	4,284,000
ニチレイ	44,000	2,681.00	117,964,000
東洋水産	50,700	4,200.00	212,940,000
イトアンド	2,600	2,135.00	5,551,000
大冷	1,000	2,218.00	2,218,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,500	1,782.00	2,673,000
日清食品ホールディングス	40,300	7,480.00	301,444,000

永谷園ホールディングス	10,000	1,562.00	15,620,000
一正蒲鉾	3,600	1,257.00	4,525,200
フジッコ	10,000	2,340.00	23,400,000
ロック・フィールド	10,000	2,154.00	21,540,000
日本たばこ産業	571,400	3,106.00	1,774,768,400
ケンコーマヨネーズ	6,100	3,635.00	22,173,500
わらべや日洋ホールディングス	6,000	2,577.00	15,462,000
なとり	5,200	1,942.00	10,098,400
イフジ産業	1,600	772.00	1,235,200
ピクルスコーポレーション	1,400	1,822.00	2,550,800
北の達人コーポレーション	26,700	740.00	19,758,000
ユーグレナ	35,600	972.00	34,603,200
ミヨシ油脂	3,600	1,422.00	5,119,200
理研ビタミン	3,500	4,035.00	14,122,500
片倉工業	11,100	1,369.00	15,195,900
ゲンゼ	7,200	5,860.00	42,192,000
東洋紡	35,700	2,069.00	73,863,300
ユニチカ	28,200	706.00	19,909,200
富士紡ホールディングス	5,400	4,310.00	23,274,000
倉敷紡績	97,000	344.00	33,368,000
シキボウ	4,900	1,400.00	6,860,000
日本毛織	27,300	1,087.00	29,675,100
トーア紡コーポレーション	4,100	582.00	2,386,200
ダイドーリミテッド	11,200	472.00	5,286,400
帝国繊維	10,200	2,016.00	20,563,200
帝人	78,800	2,167.00	170,759,600
東レ	699,200	1,100.00	769,120,000
サカイオーベックス	2,500	2,813.00	7,032,500
住江織物	2,400	2,948.00	7,075,200
日本フェルト	5,400	523.00	2,824,200
イチカワ	7,000	379.00	2,653,000
日東製網	1,000	1,802.00	1,802,000
アツギ	6,700	1,199.00	8,033,300
ダイニック	3,700	1,040.00	3,848,000
セーレン	22,200	2,074.00	46,042,800
ソトー	3,900	1,078.00	4,204,200
東海染工	1,600	1,550.00	2,480,000
小松精練	15,300	957.00	14,642,100
ワコールホールディングス	26,700	3,155.00	84,238,500
ホギメディカル	6,100	8,400.00	51,240,000
レナウン	26,400	188.00	4,963,200
クラウドディアホールディングス	2,800	564.00	1,579,200

TSIホールディングス	36,700	752.00	27,598,400
マツオカコーポレーション	1,700	3,735.00	6,349,500
三陽商会	5,200	2,384.00	12,396,800
オンワードホールディングス	57,800	912.00	52,713,600
ルックホールディングス	17,000	317.00	5,389,000
ゴールドウイン	2,700	11,830.00	31,941,000
デサント	22,100	1,748.00	38,630,800
キング	5,200	674.00	3,504,800
ヤマトインターナショナル	7,100	480.00	3,408,000
特種東海製紙	5,300	4,200.00	22,260,000
王子ホールディングス	406,000	714.00	289,884,000
日本製紙	43,200	2,155.00	93,096,000
三菱製紙	13,900	702.00	9,757,800
北越紀州製紙	53,800	703.00	37,821,400
中越パルプ工業	3,800	1,956.00	7,432,800
巴川製紙所	15,000	309.00	4,635,000
大王製紙	38,400	1,530.00	58,752,000
阿波製紙	2,400	656.00	1,574,400
レンゴー	92,900	916.00	85,096,400
トモク	5,600	2,084.00	11,670,400
ザ・パック	6,800	3,705.00	25,194,000
クラレ	162,200	1,892.00	306,882,400
旭化成	601,100	1,351.50	812,386,650
共和レザー	5,700	985.00	5,614,500
昭和電工	64,200	5,210.00	334,482,000
住友化学	709,000	673.00	477,157,000
住友精化	4,000	5,500.00	22,000,000
日産化学工業	56,100	4,050.00	227,205,000
ラサ工業	3,400	2,453.00	8,340,200
クレハ	8,200	7,660.00	62,812,000
多木化学	1,300	4,380.00	5,694,000
テイカ	7,300	2,802.00	20,454,600
石原産業	17,400	1,490.00	25,926,000
片倉コープアグリ	2,400	1,244.00	2,985,600
日東エフシー	5,800	796.00	4,616,800
日本曹達	67,000	664.00	44,488,000
東ソー	139,300	2,276.00	317,046,800
トクヤマ	28,000	3,140.00	87,920,000
セントラル硝子	19,600	2,448.00	47,980,800
東亜合成	56,600	1,222.00	69,165,200
大阪ソーダ	8,700	2,811.00	24,455,700
関東電化工業	23,000	1,230.00	28,290,000

デンカ	35,400	3,915.00	138,591,000
信越化学工業	160,500	11,390.00	1,828,095,000
日本カーバイド工業	3,100	2,286.00	7,086,600
堺化学工業	6,600	3,105.00	20,493,000
エア・ウォーター	79,500	2,147.00	170,686,500
大陽日酸	74,200	1,577.00	117,013,400
日本化学工業	3,600	3,260.00	11,736,000
東邦アセチレン	1,400	1,489.00	2,084,600
日本パーカラライジング	49,200	1,911.00	94,021,200
高压ガス工業	14,500	882.00	12,789,000
チタン工業	1,000	2,807.00	2,807,000
四国化成工業	14,000	1,507.00	21,098,000
戸田工業	1,900	3,695.00	7,020,500
ステラ ケミファ	4,900	2,699.00	13,225,100
保土谷化学工業	3,100	4,960.00	15,376,000
日本触媒	15,200	7,480.00	113,696,000
大日精化工業	7,400	4,655.00	34,447,000
カネカ	130,000	1,081.00	140,530,000
三菱瓦斯化学	79,400	2,648.00	210,251,200
三井化学	87,600	3,315.00	290,394,000
J S R	96,900	2,400.00	232,560,000
東京応化工業	16,700	4,025.00	67,217,500
大阪有機化学工業	6,400	1,559.00	9,977,600
三菱ケミカルホールディングス	645,500	1,104.00	712,632,000
K Hネオケム	14,800	3,050.00	45,140,000
ダイセル	130,000	1,213.00	157,690,000
住友ベークライト	78,000	901.00	70,278,000
積水化学工業	200,200	1,973.00	394,994,600
日本ゼオン	81,300	1,592.00	129,429,600
アイカ工業	27,000	4,115.00	111,105,000
宇部興産	48,500	3,420.00	165,870,000
積水樹脂	14,900	2,466.00	36,743,400
タキロンシーアイ	19,600	714.00	13,994,400
旭有機材	5,700	2,113.00	12,044,100
日立化成	47,600	2,386.00	113,573,600
ニチバン	4,800	3,240.00	15,552,000
リケンテクノス	21,100	524.00	11,056,400
大倉工業	23,000	573.00	13,179,000
積水化成成品工業	12,100	1,168.00	14,132,800
群栄化学工業	2,300	3,500.00	8,050,000
タイガースポリマー	4,900	876.00	4,292,400
ミライアル	3,200	2,052.00	6,566,400

ダイキアクシス	3,300	1,615.00	5,329,500
ダイキョーニシカワ	19,000	1,880.00	35,720,000
竹本容器	1,100	2,466.00	2,712,600
森六ホールディングス	3,700	3,030.00	11,211,000
日本化薬	62,600	1,376.00	86,137,600
カーリットホールディングス	9,100	1,181.00	10,747,100
日本精化	8,100	1,250.00	10,125,000
扶桑化学工業	6,900	2,875.00	19,837,500
A D E K A	41,500	1,947.00	80,800,500
日油	37,200	2,954.00	109,888,800
ハリマ化成グループ	7,600	892.00	6,779,200
花王	226,300	7,895.00	1,786,638,500
第一工業製薬	18,000	800.00	14,400,000
日華化学	3,100	1,175.00	3,642,500
ニイタカ	1,400	1,842.00	2,578,800
三洋化成工業	6,100	5,420.00	33,062,000
有機合成薬品工業	6,600	296.00	1,953,600
大日本塗料	11,100	1,582.00	17,560,200
日本ペイントホールディングス	74,400	3,750.00	279,000,000
関西ペイント	101,200	2,632.00	266,358,400
神東塗料	7,500	259.00	1,942,500
中国塗料	27,800	1,113.00	30,941,400
日本特殊塗料	6,100	2,058.00	12,553,800
藤倉化成	12,300	673.00	8,277,900
太陽ホールディングス	7,400	4,875.00	36,075,000
D I C	38,100	3,895.00	148,399,500
サカタインクス	19,800	1,387.00	27,462,600
東洋インキS Cホールディングス	95,000	668.00	63,460,000
T & K T O K A	6,600	1,379.00	9,101,400
富士フイルムホールディングス	191,100	4,358.00	832,813,800
資生堂	171,400	6,289.00	1,077,934,600
ライオン	128,200	2,105.00	269,861,000
高砂香料工業	5,800	3,215.00	18,647,000
マンダム	17,900	3,770.00	67,483,000
ミルボン	12,300	4,360.00	53,628,000
ファンケル	22,400	3,430.00	76,832,000
コーセー	15,600	20,310.00	316,836,000
コタ	4,100	1,961.00	8,040,100
シーズ・ホールディングス	12,500	6,060.00	75,750,000
シーボン	1,100	3,410.00	3,751,000
ポーラ・オルビスホールディングス	39,300	4,515.00	177,439,500
ノエビアホールディングス	5,900	8,010.00	47,259,000

アジュバンコスメジャパン	2,100	1,103.00	2,316,300	
エステー	6,600	2,366.00	15,615,600	
アグロ カネショウ	3,800	2,273.00	8,637,400	
コニシ	15,200	1,854.00	28,180,800	
長谷川香料	12,300	2,012.00	24,747,600	
星光PMC	5,400	1,082.00	5,842,800	
小林製薬	25,800	7,020.00	181,116,000	
荒川化学工業	8,300	1,933.00	16,043,900	
メック	6,400	1,695.00	10,848,000	
日本高純度化学	2,500	2,583.00	6,457,500	
タカラバイオ	24,100	1,985.00	47,838,500	
JCU	5,700	4,810.00	27,417,000	
新田ゼラチン	6,500	789.00	5,128,500	
OATアグリオ	1,400	2,944.00	4,121,600	
デクセリアルズ	23,600	1,403.00	33,110,800	
アース製薬	6,900	5,180.00	35,742,000	
北興化学工業	9,600	770.00	7,392,000	
大成ラミック	2,800	3,140.00	8,792,000	
クミアイ化学工業	42,100	659.00	27,743,900	
日本農薬	24,000	617.00	14,808,000	
アキレス	7,000	2,172.00	15,204,000	
有沢製作所	15,600	967.00	15,085,200	
日東電工	69,500	8,505.00	591,097,500	
レック	5,500	3,130.00	17,215,000	
きもと	16,100	402.00	6,472,200	
藤森工業	7,700	3,655.00	28,143,500	
前澤化成工業	6,400	1,165.00	7,456,000	
JSP	5,400	3,295.00	17,793,000	
エフピコ	7,600	5,890.00	44,764,000	
天馬	7,200	2,200.00	15,840,000	
信越ポリマー	19,000	1,238.00	23,522,000	
東リ	23,400	385.00	9,009,000	
ニフコ	16,900	7,600.00	128,440,000	
日本バルカー工業	7,500	3,175.00	23,812,500	
ユニ・チャーム	195,100	3,008.00	586,860,800	
協和発酵キリン	115,300	2,267.00	261,385,100	
武田薬品工業	339,000	5,923.00	2,007,897,000	
アステラス製薬	945,700	1,508.50	1,426,588,450	
大日本住友製薬	68,200	1,599.00	109,051,800	
塩野義製薬	131,600	5,530.00	727,748,000	
田辺三菱製薬	112,300	2,252.00	252,899,600	
わかもと製薬	11,000	276.00	3,036,000	

あすか製薬	10,500	2,167.00	22,753,500
日本新薬	24,100	6,180.00	148,938,000
ピオフェルミン製薬	1,600	2,875.00	4,600,000
中外製薬	95,900	5,470.00	524,573,000
科研製薬	16,600	6,070.00	100,762,000
エーザイ	110,100	5,610.00	617,661,000
ロート製薬	50,500	3,005.00	151,752,500
小野薬品工業	217,300	3,003.00	652,551,900
久光製薬	27,200	7,390.00	201,008,000
持田製薬	6,400	7,730.00	49,472,000
参天製薬	174,200	1,723.00	300,146,600
扶桑薬品工業	3,200	2,788.00	8,921,600
日本ケミファ	1,200	4,405.00	5,286,000
ツムラ	32,900	3,555.00	116,959,500
日医工	24,400	1,698.00	41,431,200
キッセイ薬品工業	17,100	2,869.00	49,059,900
生化学工業	17,900	2,136.00	38,234,400
栄研化学	7,500	5,060.00	37,950,000
日水製薬	3,900	1,415.00	5,518,500
鳥居薬品	5,800	2,815.00	16,327,000
JCRファーマ	6,500	5,360.00	34,840,000
東和薬品	4,400	6,970.00	30,668,000
富士製薬工業	3,100	4,605.00	14,275,500
沢井製薬	18,500	4,995.00	92,407,500
ゼリア新薬工業	19,700	2,110.00	41,567,000
第一三共	263,300	3,867.00	1,018,181,100
キョーリン製薬ホールディングス	25,700	2,066.00	53,096,200
大幸薬品	4,900	2,093.00	10,255,700
ダイト	5,400	3,470.00	18,738,000
大塚ホールディングス	191,200	4,989.00	953,896,800
大正製薬ホールディングス	20,600	9,930.00	204,558,000
ペプチドリーム	41,200	4,710.00	194,052,000
日本コークス工業	78,700	112.00	8,814,400
昭和シェル石油	86,100	1,387.00	119,420,700
ニチレキ	11,900	1,402.00	16,683,800
ユシロ化学工業	5,200	1,907.00	9,916,400
ビーピー・カストロール	4,000	1,746.00	6,984,000
富士石油	22,700	446.00	10,124,200
MORESCO	3,300	1,950.00	6,435,000
出光興産	77,200	4,010.00	309,572,000
JXTGホールディングス	1,468,500	657.50	965,538,750
コスモエネルギーホールディングス	26,600	3,860.00	102,676,000

横浜ゴム	53,300	2,685.00	143,110,500
東洋ゴム工業	54,500	1,957.00	106,656,500
ブリヂストン	325,200	4,789.00	1,557,382,800
住友ゴム工業	94,700	2,127.00	201,426,900
藤倉ゴム工業	8,200	826.00	6,773,200
オカモト	32,000	1,115.00	35,680,000
フコク	4,100	1,052.00	4,313,200
ニッタ	9,500	4,145.00	39,377,500
住友理工	17,800	1,073.00	19,099,400
三ツ星ベルト	22,000	1,177.00	25,894,000
バンドー化学	17,500	1,226.00	21,455,000
日東紡績	13,700	2,550.00	34,935,000
旭硝子	94,100	4,495.00	422,979,500
日本板硝子	44,000	886.00	38,984,000
石塚硝子	1,200	2,666.00	3,199,200
日本山村硝子	39,000	184.00	7,176,000
日本電気硝子	39,800	3,360.00	133,728,000
オハラ	3,600	3,060.00	11,016,000
住友大阪セメント	179,000	487.00	87,173,000
太平洋セメント	58,100	4,030.00	234,143,000
日本ヒューム	9,500	810.00	7,695,000
日本コンクリート工業	20,000	459.00	9,180,000
三谷セキサン	4,800	2,550.00	12,240,000
アジアパイルホールディングス	12,200	670.00	8,174,000
東海カーボン	83,600	1,983.00	165,778,800
日本カーボン	4,700	6,370.00	29,939,000
東洋炭素	6,000	3,605.00	21,630,000
ノリタケカンパニーリミテド	5,400	5,390.00	29,106,000
TOTO	70,800	5,800.00	410,640,000
日本碍子	112,300	2,024.00	227,295,200
日本特殊陶業	78,900	2,700.00	213,030,000
MARUWA	3,200	8,570.00	27,424,000
品川リフラクトリーズ	2,400	3,105.00	7,452,000
黒崎播磨	1,800	5,080.00	9,144,000
ヨータイ	5,600	915.00	5,124,000
イソライト工業	4,900	945.00	4,630,500
東京窯業	12,200	454.00	5,538,800
ニッカトー	3,300	1,109.00	3,659,700
フジインコーポレーテッド	8,200	2,592.00	21,254,400
エーアンドエーマテリアル	2,000	1,241.00	2,482,000
ニチアス	50,000	1,435.00	71,750,000
ニチハ	13,900	4,340.00	60,326,000

新日鐵住金	407,200	2,577.00	1,049,354,400
神戸製鋼所	166,500	1,212.00	201,798,000
中山製鋼所	12,800	711.00	9,100,800
合同製鐵	4,900	2,015.00	9,873,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	245,800	2,539.00	624,086,200
日新製鋼	25,100	1,548.00	38,854,800
東京製鐵	48,700	863.00	42,028,100
共英製鋼	10,300	1,922.00	19,796,600
大和工業	19,300	3,135.00	60,505,500
東京鐵鋼	3,800	1,715.00	6,517,000
大阪製鐵	6,100	2,139.00	13,047,900
淀川製鋼所	13,300	3,100.00	41,230,000
東洋鋼鈹	23,000	713.00	16,399,000
丸一鋼管	32,200	3,355.00	108,031,000
モリ工業	3,000	3,845.00	11,535,000
大同特殊鋼	16,100	5,900.00	94,990,000
日本高周波鋼業	3,400	804.00	2,733,600
日本冶金工業	75,300	337.00	25,376,100
山陽特殊製鋼	10,500	2,405.00	25,252,500
愛知製鋼	5,100	4,720.00	24,072,000
日立金属	98,000	1,427.00	139,846,000
日本金属	2,300	2,720.00	6,256,000
大平洋金属	5,600	3,220.00	18,032,000
新日本電工	54,900	383.00	21,026,700
栗本鐵工所	4,600	2,126.00	9,779,600
虹技	1,400	2,047.00	2,865,800
日本鑄鉄管	9,000	167.00	1,503,000
三菱製鋼	6,700	2,661.00	17,828,700
日亜鋼業	13,500	358.00	4,833,000
日本精線	1,500	4,965.00	7,447,500
シンニッタン	7,200	840.00	6,048,000
新家工業	2,100	2,490.00	5,229,000
大紀アルミニウム工業所	15,100	809.00	12,215,900
日本軽金属ホールディングス	266,200	289.00	76,931,800
三井金属鉱業	24,600	5,120.00	125,952,000
東邦亜鉛	5,100	5,880.00	29,988,000
三菱マテリアル	60,100	3,360.00	201,936,000
住友金属鉱山	116,300	5,020.00	583,826,000
DOWAホールディングス	23,100	3,955.00	91,360,500
古河機械金属	15,100	2,305.00	34,805,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,500	2,861.00	27,179,500
東邦チタニウム	16,500	1,526.00	25,179,000

U A C J	13,900	2,590.00	36,001,000
古河電気工業	30,300	5,870.00	177,861,000
住友電気工業	340,300	1,684.00	573,065,200
フジクラ	110,100	769.00	84,666,900
昭和電線ホールディングス	11,600	1,002.00	11,623,200
東京特殊電線	1,200	3,195.00	3,834,000
タツタ電線	18,200	715.00	13,013,000
カナレ電気	1,600	2,194.00	3,510,400
平河ヒューテック	4,700	1,208.00	5,677,600
リョービ	11,200	2,878.00	32,233,600
アーレスティ	11,500	971.00	11,166,500
アサヒホールディングス	15,800	2,040.00	32,232,000
稲葉製作所	5,200	1,341.00	6,973,200
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,433.00	6,325,800
トーカロ	6,300	5,630.00	35,469,000
アルファC o	3,200	1,870.00	5,984,000
S U M C O	83,800	2,755.00	230,869,000
川田テクノロジーズ	1,800	6,050.00	10,890,000
R S Technologies	1,300	7,210.00	9,373,000
東洋製罐グループホールディングス	62,200	1,558.00	96,907,600
ホッカンホールディングス	23,000	384.00	8,832,000
コロナ	5,100	1,354.00	6,905,400
横河ブリッジホールディングス	16,900	2,590.00	43,771,000
駒井ハルテック	2,000	2,618.00	5,236,000
高田機工	800	4,520.00	3,616,000
三和ホールディングス	87,300	1,464.00	127,807,200
文化シャッター	27,000	996.00	26,892,000
三協立山	12,600	1,551.00	19,542,600
アルインコ	6,700	1,151.00	7,711,700
東洋シャッター	2,500	624.00	1,560,000
L I X I Lグループ	134,200	2,665.00	357,643,000
日本フィルコン	7,100	657.00	4,664,700
ノーリツ	20,300	1,971.00	40,011,300
長府製作所	10,300	2,454.00	25,276,200
リンナイ	16,200	9,770.00	158,274,000
ダイニチ工業	5,000	875.00	4,375,000
日東精工	12,800	614.00	7,859,200
三洋工業	1,100	2,139.00	2,352,900
岡部	18,700	997.00	18,643,900
ジーテクト	10,100	2,144.00	21,654,400
東プレ	17,000	3,180.00	54,060,000
高周波熱錬	17,500	1,092.00	19,110,000

東京製綱	6,500	2,030.00	13,195,000
サンコール	5,200	796.00	4,139,200
モリテック スチール	5,400	1,033.00	5,578,200
パイオラックス	13,500	2,950.00	39,825,000
エイチワン	6,800	1,443.00	9,812,400
日本発條	90,700	1,067.00	96,776,900
中央発條	1,100	3,570.00	3,927,000
アドバネクス	1,400	4,095.00	5,733,000
立川ブラインド工業	4,100	1,447.00	5,932,700
三益半導体工業	7,100	1,977.00	14,036,700
日本ドライケミカル	1,200	2,522.00	3,026,400
日本製鋼所	29,800	3,410.00	101,618,000
三浦工業	39,500	3,035.00	119,882,500
タクマ	31,200	1,311.00	40,903,200
ツガミ	24,000	1,535.00	36,840,000
オークマ	10,700	6,630.00	70,941,000
東芝機械	52,000	772.00	40,144,000
アマダホールディングス	140,700	1,428.00	200,919,600
アイダエンジニアリング	23,400	1,438.00	33,649,200
滝澤鉄工所	2,800	2,168.00	6,070,400
富士機械製造	27,200	2,186.00	59,459,200
牧野フライス製作所	45,000	1,089.00	49,005,000
オーエスジー	41,800	2,501.00	104,541,800
ダイジェット工業	1,300	2,152.00	2,797,600
旭ダイヤモンド工業	27,500	1,283.00	35,282,500
D M G 森精機	50,500	2,166.00	109,383,000
ソディック	19,800	1,425.00	28,215,000
ディスコ	12,300	24,260.00	298,398,000
日東工器	5,600	2,887.00	16,167,200
日進工具	2,400	3,355.00	8,052,000
パンチ工業	7,600	1,267.00	9,629,200
富士ダイス	3,500	1,091.00	3,818,500
豊和工業	5,300	1,671.00	8,856,300
O K K	3,800	1,171.00	4,449,800
東洋機械金属	7,200	949.00	6,832,800
島精機製作所	11,600	6,830.00	79,228,000
オプトラン	6,700	3,860.00	25,862,000
N C ホールディングス	3,000	761.00	2,283,000
フリュー	6,600	1,051.00	6,936,600
ヤマシンフィルタ	12,400	1,354.00	16,789,600
日阪製作所	13,300	1,094.00	14,550,200
やまびこ	17,600	1,680.00	29,568,000

平田機工	2,500	10,330.00	25,825,000	
ペガサスミシン製造	8,600	751.00	6,458,600	
ナブテスコ	50,100	4,495.00	225,199,500	
三井海洋開発	9,700	2,689.00	26,083,300	
レオン自動機	8,200	2,332.00	19,122,400	
S M C	28,900	46,400.00	1,340,960,000	
新川	7,500	1,148.00	8,610,000	
ホソカワミクロン	3,400	7,750.00	26,350,000	
ユニオンツール	4,200	3,965.00	16,653,000	
オイレス工業	11,800	2,363.00	27,883,400	
日精エー・エス・ビー機械	3,100	7,770.00	24,087,000	
サトーホールディングス	12,000	3,575.00	42,900,000	
技研製作所	4,600	2,836.00	13,045,600	
日本エアーテック	3,200	980.00	3,136,000	
日精樹脂工業	7,900	1,739.00	13,738,100	
オカダアイヨン	2,700	1,655.00	4,468,500	
ワイエイシイホールディングス	3,100	919.00	2,848,900	
小松製作所	444,400	3,999.00	1,777,155,600	
住友重機械工業	52,700	4,295.00	226,346,500	
日立建機	43,100	4,545.00	195,889,500	
日工	2,700	2,462.00	6,647,400	
巴工業	3,900	1,960.00	7,644,000	
井関農機	9,300	2,205.00	20,506,500	
T O W A	7,200	1,638.00	11,793,600	
丸山製作所	2,200	1,807.00	3,975,400	
北川鉄工所	4,500	2,809.00	12,640,500	
ローツェ	4,500	2,374.00	10,683,000	
タカキタ	3,200	821.00	2,627,200	
クボタ	493,700	1,979.50	977,279,150	
荏原実業	2,900	2,184.00	6,333,600	
三菱化工機	3,300	2,223.00	7,335,900	
月島機械	18,600	1,436.00	26,709,600	
帝国電機製作所	6,500	1,653.00	10,744,500	
新東工業	22,200	1,227.00	27,239,400	
澁谷工業	8,100	4,380.00	35,478,000	
アイチ コーポレーション	16,600	731.00	12,134,600	
小森コーポレーション	23,500	1,400.00	32,900,000	
鶴見製作所	8,000	1,943.00	15,544,000	
住友精密工業	15,000	419.00	6,285,000	
酒井重工業	1,800	4,515.00	8,127,000	
荏原製作所	37,900	3,970.00	150,463,000	
石井鐵工所	1,600	2,024.00	3,238,400	

西島製作所	9,800	999.00	9,790,200
北越工業	10,300	1,175.00	12,102,500
ダイキン工業	125,600	12,775.00	1,604,540,000
オルガノ	3,400	3,290.00	11,186,000
トーヨーカネツ	4,000	3,515.00	14,060,000
栗田工業	49,900	3,210.00	160,179,000
椿本チエイン	55,000	898.00	49,390,000
大同工業	3,700	1,567.00	5,797,900
木村化工機	8,400	505.00	4,242,000
アネスト岩田	15,500	1,133.00	17,561,500
ダイフク	46,900	6,890.00	323,141,000
サムコ	2,600	1,260.00	3,276,000
加藤製作所	4,500	2,606.00	11,727,000
油研工業	1,900	3,055.00	5,804,500
タダノ	44,600	1,704.00	75,998,400
フジテック	29,500	1,424.00	42,008,000
C K D	25,600	2,688.00	68,812,800
キトー	7,000	2,085.00	14,595,000
平和	28,500	2,116.00	60,306,000
理想科学工業	9,200	2,171.00	19,973,200
S A N K Y O	23,000	3,920.00	90,160,000
日本金銭機械	8,600	1,299.00	11,171,400
マースエンジニアリング	5,800	2,447.00	14,192,600
福島工業	5,700	4,825.00	27,502,500
オーイズミ	3,900	531.00	2,070,900
ダイコク電機	4,300	1,713.00	7,365,900
竹内製作所	15,400	2,482.00	38,222,800
アマノ	28,500	2,926.00	83,391,000
J U K I	13,700	1,686.00	23,098,200
サンデンホールディングス	11,200	1,650.00	18,480,000
蛇の目ミシン工業	8,500	772.00	6,562,000
マックス	14,200	1,502.00	21,328,400
グローリー	27,500	4,020.00	110,550,000
新晃工業	9,400	1,999.00	18,790,600
大和冷機工業	14,800	1,225.00	18,130,000
セガサミーホールディングス	91,300	1,572.00	143,523,600
日本ピストンリング	3,400	2,384.00	8,105,600
リケン	4,300	6,080.00	26,144,000
T P R	10,300	3,035.00	31,260,500
ツバキ・ナカシマ	9,200	3,070.00	28,244,000
ホシザキ	29,000	9,800.00	284,200,000
大豊工業	7,600	1,571.00	11,939,600

日本精工	189,000	1,622.00	306,558,000
NTN	213,000	481.00	102,453,000
ジェイテクト	98,100	1,702.00	166,966,200
不二越	85,000	676.00	57,460,000
日本トムソン	29,600	782.00	23,147,200
THK	57,400	4,695.00	269,493,000
ユーシン精機	4,100	3,585.00	14,698,500
前澤給装工業	3,600	1,909.00	6,872,400
イーグル工業	11,400	1,965.00	22,401,000
前澤工業	6,200	425.00	2,635,000
日本ピラー工業	9,400	1,707.00	16,045,800
キッツ	41,000	881.00	36,121,000
マキタ	120,000	5,060.00	607,200,000
日立造船	73,600	553.00	40,700,800
三菱重工業	154,300	4,377.00	675,371,100
IHI	70,800	3,520.00	249,216,000
スター精密	14,900	2,161.00	32,198,900
日清紡ホールディングス	56,200	1,623.00	91,212,600
イビデン	56,400	1,791.00	101,012,400
コニカミノルタ	215,500	977.00	210,543,500
ブラザー工業	112,400	2,650.00	297,860,000
ミネベアミツミ	170,900	2,439.00	416,825,100
日立製作所	2,209,000	822.70	1,817,344,300
三菱電機	920,100	1,827.50	1,681,482,750
富士電機	277,000	815.00	225,755,000
東洋電機製造	3,600	1,706.00	6,141,600
安川電機	106,700	4,975.00	530,832,500
シンフォニアテクノロジー	60,000	370.00	22,200,000
明電舎	78,000	414.00	32,292,000
オリジン電気	2,700	1,900.00	5,130,000
山洋電気	4,500	8,190.00	36,855,000
デンヨー	8,500	1,834.00	15,589,000
東芝テック	66,000	651.00	42,966,000
芝浦メカトロニクス	14,000	495.00	6,930,000
マブチモーター	25,700	5,370.00	138,009,000
日本電産	110,700	16,410.00	1,816,587,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,400	2,852.00	9,696,800
東光高岳	4,700	1,625.00	7,637,500
ダブル・スコープ	13,500	1,537.00	20,749,500
ダイヘン	50,000	836.00	41,800,000
ヤーマン	11,800	1,733.00	20,449,400
JVCケンウッド	68,200	365.00	24,893,000

ミマキエンジニアリング	8,500	918.00	7,803,000
第一精工	4,300	2,827.00	12,156,100
日新電機	21,700	1,074.00	23,305,800
大崎電気工業	19,700	793.00	15,622,100
オムロン	97,800	6,270.00	613,206,000
日東工業	14,800	1,868.00	27,646,400
I D E C	11,400	2,865.00	32,661,000
不二電機工業	1,100	1,357.00	1,492,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	166,000	600.00	99,600,000
サクサホールディングス	2,300	2,171.00	4,993,300
メルコホールディングス	4,500	3,595.00	16,177,500
テクノメディカ	2,100	1,964.00	4,124,400
日本電気	119,100	3,225.00	384,097,500
富士通	946,000	642.30	607,615,800
沖電気工業	37,400	1,456.00	54,454,400
岩崎通信機	4,100	771.00	3,161,100
電気興業	5,200	3,290.00	17,108,000
サンケン電気	54,000	862.00	46,548,000
ナカヨ	1,800	2,019.00	3,634,200
アイホン	5,200	1,705.00	8,866,000
ルネサスエレクトロニクス	47,700	1,181.00	56,333,700
セイコーエプソン	137,000	2,073.00	284,001,000
ワコム	71,600	552.00	39,523,200
アルバック	21,200	6,420.00	136,104,000
アクセル	4,000	810.00	3,240,000
E I Z O	8,400	5,180.00	43,512,000
日本信号	25,500	1,077.00	27,463,500
京三製作所	22,000	773.00	17,006,000
能美防災	12,300	2,331.00	28,671,300
ホーチキ	6,800	2,014.00	13,695,200
エレコム	8,000	2,354.00	18,832,000
パナソニック	1,051,200	1,647.50	1,731,852,000
シャープ	64,100	3,565.00	228,516,500
アンリツ	67,100	1,350.00	90,585,000
富士通ゼネラル	28,100	2,059.00	57,857,900
ソニー	614,700	5,378.00	3,305,856,600
T D K	48,100	9,410.00	452,621,000
帝国通信工業	4,200	1,378.00	5,787,600
タムラ製作所	35,700	810.00	28,917,000
アルプス電気	79,300	2,775.00	220,057,500
池上通信機	29,000	166.00	4,814,000
パイオニア	154,300	199.00	30,705,700

日本電波工業	8,600	703.00	6,045,800
鈴木	3,700	1,289.00	4,769,300
日本トリム	2,000	6,040.00	12,080,000
ローランド ディー・ジー・	4,700	2,688.00	12,633,600
フォスター電機	10,800	2,942.00	31,773,600
クラリオン	48,000	339.00	16,272,000
S M K	24,000	464.00	11,136,000
ヨコオ	6,100	2,255.00	13,755,500
ホシデン	23,400	1,530.00	35,802,000
ヒロセ電機	14,900	15,370.00	229,013,000
日本航空電子工業	24,000	1,585.00	38,040,000
T O A	10,000	1,427.00	14,270,000
マクセルホールディングス	18,300	2,118.00	38,759,400
古野電気	11,200	745.00	8,344,000
ユニデンホールディングス	25,000	301.00	7,525,000
アルパイン	21,900	2,133.00	46,712,700
スミダコーポレーション	9,500	1,616.00	15,352,000
アイコム	5,100	2,765.00	14,101,500
リオン	3,900	2,974.00	11,598,600
本多通信工業	7,200	1,244.00	8,956,800
船井電機	9,400	772.00	7,256,800
横河電機	92,100	2,255.00	207,685,500
新電元工業	3,200	8,330.00	26,656,000
アズビル	27,600	4,720.00	130,272,000
東亜ディーケーケー	4,700	1,141.00	5,362,700
日本光電工業	38,500	2,974.00	114,499,000
チノー	3,200	1,634.00	5,228,800
共和電業	10,600	452.00	4,791,200
日本電子材料	3,700	730.00	2,701,000
堀場製作所	18,200	7,740.00	140,868,000
アドバンテスト	51,300	2,233.00	114,552,900
小野測器	4,100	802.00	3,288,200
エスベック	8,200	2,621.00	21,492,200
キーエンス	45,200	63,900.00	2,888,280,000
日置電機	4,800	3,535.00	16,968,000
シスメックス	71,600	8,680.00	621,488,000
日本マイクロニクス	16,100	1,103.00	17,758,300
メガチップス	7,300	3,760.00	27,448,000
O B A R A G R O U P	5,400	6,580.00	35,532,000
澤藤電機	1,000	2,201.00	2,201,000
コーセル	12,900	1,633.00	21,065,700
イリソ電子工業	7,700	6,950.00	53,515,000

新日本無線	5,700	878.00	5,004,600	
オブテックスグループ	7,500	5,870.00	44,025,000	
千代田インテグレ	4,500	2,425.00	10,912,500	
アイ・オー・データ機器	4,000	1,123.00	4,492,000	
レーザーテック	18,900	4,395.00	83,065,500	
スタンレー電気	70,400	4,155.00	292,512,000	
岩崎電気	3,700	1,653.00	6,116,100	
ウシオ電機	55,900	1,470.00	82,173,000	
岡谷電機産業	5,200	769.00	3,998,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	8,000	1,008.00	8,064,000	
日本セラミック	9,400	2,947.00	27,701,800	
遠藤照明	4,800	1,150.00	5,520,000	
古河電池	6,800	1,050.00	7,140,000	
双信電機	4,200	708.00	2,973,600	
山一電機	6,800	1,869.00	12,709,200	
図研	6,100	1,774.00	10,821,400	
日本電子	34,000	835.00	28,390,000	
カシオ計算機	74,000	1,513.00	111,962,000	
ファナック	87,400	27,575.00	2,410,055,000	
日本シイエムケイ	16,400	967.00	15,858,800	
エンプラス	4,200	3,670.00	15,414,000	
大真空	3,400	1,367.00	4,647,800	
ローム	41,300	11,070.00	457,191,000	
浜松ホトニクス	67,000	4,210.00	282,070,000	
三井ハイテック	12,300	2,041.00	25,104,300	
新光電気工業	35,100	892.00	31,309,200	
京セラ	151,000	6,249.00	943,599,000	
太陽誘電	41,400	1,789.00	74,064,600	
村田製作所	96,500	15,040.00	1,451,360,000	
ユーシン	13,900	753.00	10,466,700	
双葉電子工業	15,100	2,225.00	33,597,500	
北陸電気工業	3,800	1,669.00	6,342,200	
ニチコン	29,000	1,338.00	38,802,000	
日本ケミコン	7,500	2,819.00	21,142,500	
K O A	12,800	2,328.00	29,798,400	
市光工業	14,000	1,148.00	16,072,000	
小糸製作所	55,100	7,530.00	414,903,000	
ミツバ	17,100	1,368.00	23,392,800	
S C R E E Nホールディングス	17,400	9,630.00	167,562,000	
キャノン電子	8,500	2,574.00	21,879,000	
キャノン	495,300	4,002.00	1,982,190,600	
リコー	276,700	1,198.00	331,486,600	

MUTOHホールディングス	1,300	2,539.00	3,300,700
東京エレクトロン	61,400	20,635.00	1,266,989,000
トヨタ紡織	26,800	2,299.00	61,613,200
芦森工業	1,900	2,400.00	4,560,000
ユニプレス	17,800	2,578.00	45,888,400
豊田自動織機	74,500	6,810.00	507,345,000
モリタホールディングス	14,800	1,992.00	29,481,600
三櫻工業	11,800	769.00	9,074,200
デンソー	204,200	6,251.00	1,276,454,200
東海理化電機製作所	24,200	2,305.00	55,781,000
三井造船	33,600	1,984.00	66,662,400
川崎重工業	71,700	4,020.00	288,234,000
名村造船所	27,600	638.00	17,608,800
サノヤスホールディングス	11,300	261.00	2,949,300
三菱ロジスネクスト	11,600	929.00	10,776,400
近畿車輛	1,400	2,689.00	3,764,600
日産自動車	1,085,700	1,121.50	1,217,612,550
いすゞ自動車	267,000	1,748.50	466,849,500
トヨタ自動車	1,118,700	7,300.00	8,166,510,000
日野自動車	131,700	1,441.00	189,779,700
三菱自動車工業	341,300	838.00	286,009,400
エフテック	6,000	1,315.00	7,890,000
レシップホールディングス	3,300	897.00	2,960,100
GMB	1,500	1,799.00	2,698,500
ファルテック	1,600	1,462.00	2,339,200
武蔵精密工業	9,800	3,735.00	36,603,000
日産車体	36,500	1,022.00	37,303,000
新明和工業	40,700	948.00	38,583,600
極東開発工業	17,400	1,688.00	29,371,200
日信工業	18,800	1,870.00	35,156,000
トピー工業	7,600	3,235.00	24,586,000
ティラド	3,300	4,075.00	13,447,500
曙ブレーキ工業	43,400	308.00	13,367,200
タチエス	15,700	1,894.00	29,735,800
NOK	49,500	2,280.00	112,860,000
フタバ産業	28,300	947.00	26,800,100
KYB	9,600	5,570.00	53,472,000
大同メタル工業	11,700	1,315.00	15,385,500
プレス工業	49,200	672.00	33,062,400
ミクニ	11,800	699.00	8,248,200
太平洋工業	19,300	1,490.00	28,757,000
ケーヒン	21,100	2,148.00	45,322,800

河西工業	11,400	1,462.00	16,666,800
アイシン精機	75,800	6,190.00	469,202,000
マツダ	289,200	1,498.50	433,366,200
今仙電機製作所	8,500	1,193.00	10,140,500
本田技研工業	828,200	3,847.00	3,186,085,400
スズキ	182,500	5,996.00	1,094,270,000
S U B A R U	285,800	3,729.00	1,065,748,200
安永	4,400	2,528.00	11,123,200
ヤマハ発動機	130,100	3,440.00	447,544,000
ショーワ	24,000	1,704.00	40,896,000
T B K	11,100	541.00	6,005,100
エクセディ	11,100	3,415.00	37,906,500
豊田合成	33,400	2,611.00	87,207,400
愛三工業	16,200	1,246.00	20,185,200
盟和産業	1,400	1,368.00	1,915,200
日本プラスト	3,800	934.00	3,549,200
ヨロズ	9,300	1,889.00	17,567,700
エフ・シー・シー	15,000	3,120.00	46,800,000
シマノ	37,100	15,670.00	581,357,000
テイ・エス テック	21,400	4,210.00	90,094,000
ジャムコ	4,600	2,515.00	11,569,000
テルモ	141,000	5,520.00	778,320,000
クリエートメディック	3,100	1,151.00	3,568,100
日機装	31,900	1,220.00	38,918,000
島津製作所	110,000	2,681.00	294,910,000
J M S	8,700	629.00	5,472,300
長野計器	7,200	1,236.00	8,899,200
ブイ・テクノロジー	2,200	25,100.00	55,220,000
東京計器	6,000	1,222.00	7,332,000
愛知時計電機	1,200	4,520.00	5,424,000
インターアクション	3,500	1,009.00	3,531,500
オーバル	9,200	297.00	2,732,400
東京精密	16,600	4,450.00	73,870,000
マニー	11,200	3,990.00	44,688,000
ニコン	160,400	2,183.00	350,153,200
トプコン	49,400	2,368.00	116,979,200
オリンパス	137,100	4,185.00	573,763,500
理研計器	8,900	2,277.00	20,265,300
タムロン	7,400	2,461.00	18,211,400
H O Y A	187,300	5,535.00	1,036,705,500
シード	1,000	4,620.00	4,620,000
ノーリツ鋼機	9,300	2,442.00	22,710,600

エー・アンド・デイ	8,600	691.00	5,942,600
シチズン時計	109,900	836.00	91,876,400
リズム時計工業	3,500	2,216.00	7,756,000
大研医器	8,400	751.00	6,308,400
メニコン	12,600	2,568.00	32,356,800
シンシア	800	659.00	527,200
松風	4,600	1,436.00	6,605,600
セイコーホールディングス	14,200	2,897.00	41,137,400
ニプロ	63,700	1,587.00	101,091,900
中本パックス	900	4,625.00	4,162,500
スノーピーク	2,900	1,187.00	3,442,300
パラマウントベッドホールディングス	9,700	5,720.00	55,484,000
トランザクション	4,200	1,081.00	4,540,200
S H O - B I	3,100	413.00	1,280,300
ニホンフラッシュ	4,300	2,698.00	11,601,400
前田工織	9,300	2,018.00	18,767,400
永大産業	12,000	569.00	6,828,000
アートネイチャー	10,000	774.00	7,740,000
バンダイナムコホールディングス	95,100	3,575.00	339,982,500
アイフィスジャパン	2,100	701.00	1,472,100
共立印刷	15,500	363.00	5,626,500
S H O E I	4,100	4,490.00	18,409,000
フランスベッドホールディングス	11,100	1,038.00	11,521,800
パイロットコーポレーション	16,000	5,510.00	88,160,000
萩原工業	5,100	1,780.00	9,078,000
トッパン・フォームズ	19,800	1,232.00	24,393,600
フジシールインターナショナル	20,600	3,525.00	72,615,000
タカラトミー	38,500	1,129.00	43,466,500
廣済堂	8,700	521.00	4,532,700
A s - m e エステール	2,700	965.00	2,605,500
アーク	39,300	126.00	4,951,800
タカノ	4,100	966.00	3,960,600
プロネクサス	8,700	1,309.00	11,388,300
ホクシン	6,600	193.00	1,273,800
ウッドワン	3,100	1,456.00	4,513,600
大建工業	7,200	2,703.00	19,461,600
凸版印刷	260,000	934.00	242,840,000
大日本印刷	120,400	2,255.00	271,502,000
図書印刷	6,300	1,003.00	6,318,900
共同印刷	2,800	3,145.00	8,806,000
N I S S H A	18,600	2,986.00	55,539,600
光村印刷	800	2,446.00	1,956,800

宝印刷	4,800	1,833.00	8,798,400
アシックス	91,400	1,658.00	151,541,200
ツツミ	2,900	2,125.00	6,162,500
小松ウオール工業	3,100	2,591.00	8,032,100
ヤマハ	62,000	4,715.00	292,330,000
河合楽器製作所	3,100	3,845.00	11,919,500
クリナップ	8,700	846.00	7,360,200
ピジョン	55,600	4,285.00	238,246,000
兼松サステック	700	2,021.00	1,414,700
キングジム	7,800	986.00	7,690,800
リンテック	21,900	3,065.00	67,123,500
イトーキ	19,700	719.00	14,164,300
任天堂	56,700	47,770.00	2,708,559,000
三菱鉛筆	15,200	2,453.00	37,285,600
タカラスタンド	19,100	1,836.00	35,067,600
コクヨ	44,100	1,980.00	87,318,000
ナカバヤシ	9,200	620.00	5,704,000
グローブライド	4,100	2,339.00	9,589,900
岡村製作所	32,100	1,475.00	47,347,500
美津濃	9,100	3,185.00	28,983,500
東京電力ホールディングス	734,600	412.00	302,655,200
中部電力	281,500	1,433.00	403,389,500
関西電力	375,500	1,292.50	485,333,750
中国電力	127,200	1,249.00	158,872,800
北陸電力	90,100	842.00	75,864,200
東北電力	215,500	1,391.00	299,760,500
四国電力	82,900	1,223.00	101,386,700
九州電力	203,200	1,216.00	247,091,200
北海道電力	92,300	647.00	59,718,100
沖縄電力	14,900	2,894.00	43,120,600
電源開発	73,200	2,795.00	204,594,000
エフオン	4,600	1,168.00	5,372,800
イーレックス	14,700	801.00	11,774,700
東京瓦斯	196,300	2,683.50	526,771,050
大阪瓦斯	178,600	2,157.00	385,240,200
東邦瓦斯	45,600	3,255.00	148,428,000
北海道瓦斯	25,000	298.00	7,450,000
広島ガス	19,200	406.00	7,795,200
西部瓦斯	11,200	2,839.00	31,796,800
静岡ガス	26,300	916.00	24,090,800
メタウォーター	5,200	3,100.00	16,120,000
SBSホールディングス	9,200	1,299.00	11,950,800

東武鉄道	98,300	3,335.00	327,830,500
相鉄ホールディングス	29,400	2,879.00	84,642,600
東京急行電鉄	249,900	1,736.00	433,826,400
京浜急行電鉄	126,000	1,963.00	247,338,000
小田急電鉄	136,900	2,233.00	305,697,700
京王電鉄	51,400	4,740.00	243,636,000
京成電鉄	64,000	3,535.00	226,240,000
富士急行	12,500	2,862.00	35,775,000
新京成電鉄	2,400	2,272.00	5,452,800
東日本旅客鉄道	165,300	10,310.00	1,704,243,000
西日本旅客鉄道	83,000	7,545.00	626,235,000
東海旅客鉄道	82,400	20,010.00	1,648,824,000
西武ホールディングス	117,300	1,881.00	220,641,300
鴻池運輸	13,100	1,935.00	25,348,500
西日本鉄道	25,500	2,911.00	74,230,500
ハマキョウレックス	6,500	3,500.00	22,750,000
サカイ引越センター	4,800	5,420.00	26,016,000
近鉄グループホールディングス	87,200	4,185.00	364,932,000
阪急阪神ホールディングス	116,200	3,995.00	464,219,000
南海電気鉄道	41,300	2,756.00	113,822,800
京阪ホールディングス	38,800	3,395.00	131,726,000
神戸電鉄	2,100	3,955.00	8,305,500
名古屋鉄道	67,600	2,749.00	185,832,400
山陽電気鉄道	6,700	2,787.00	18,672,900
日本通運	34,200	7,120.00	243,504,000
ヤマトホールディングス	152,800	2,707.00	413,629,600
山九	22,400	5,230.00	117,152,000
丸運	5,000	352.00	1,760,000
丸全昭和運輸	31,000	519.00	16,089,000
センコーグループホールディングス	52,400	742.00	38,880,800
トナミホールディングス	2,100	5,340.00	11,214,000
ニッコンホールディングス	33,100	2,739.00	90,660,900
日本石油輸送	1,000	3,300.00	3,300,000
福山通運	12,700	4,585.00	58,229,500
セイノーホールディングス	65,300	1,779.00	116,168,700
神奈川中央交通	2,200	3,690.00	8,118,000
日立物流	19,200	2,639.00	50,668,800
丸和運輸機関	4,600	3,745.00	17,227,000
C & F ロジホールディングス	9,500	1,580.00	15,010,000
九州旅客鉄道	73,100	3,355.00	245,250,500
S Gホールディングス	61,700	2,290.00	141,293,000
日本郵船	73,100	2,322.00	169,738,200

商船三井	55,300	3,395.00	187,743,500
川崎汽船	40,500	2,638.00	106,839,000
N S ユナイテッド海運	4,400	2,288.00	10,067,200
飯野海運	45,900	567.00	26,025,300
共栄タンカー	1,000	1,901.00	1,901,000
乾汽船	6,800	825.00	5,610,000
日本航空	161,700	4,031.00	651,812,700
A N A ホールディングス	170,800	4,334.00	740,247,200
パスコ	8,000	337.00	2,696,000
ランコム	2,400	7,120.00	17,088,000
日新	7,500	2,793.00	20,947,500
三菱倉庫	30,200	2,521.00	76,134,200
三井倉庫ホールディングス	50,000	357.00	17,850,000
住友倉庫	60,000	734.00	44,040,000
澁澤倉庫	4,800	1,888.00	9,062,400
東陽倉庫	16,000	348.00	5,568,000
日本トランスシティ	21,000	439.00	9,219,000
ケイヒン	1,700	1,744.00	2,964,800
中央倉庫	5,400	1,094.00	5,907,600
川西倉庫	1,800	2,056.00	3,700,800
安田倉庫	7,900	982.00	7,757,800
東洋埠頭	2,700	1,756.00	4,741,200
宇徳	7,600	509.00	3,868,400
上組	54,900	2,364.00	129,783,600
サンリツ	2,300	816.00	1,876,800
キムラユニティー	2,400	1,126.00	2,702,400
キューソー流通システム	2,500	2,575.00	6,437,500
近鉄エクスプレス	16,500	2,105.00	34,732,500
東海運	5,000	420.00	2,100,000
エーアイティー	6,300	1,150.00	7,245,000
内外トランスライン	3,100	1,846.00	5,722,600
日本コンセプト	1,700	1,516.00	2,577,200
N E C ネットズエスアイ	10,000	2,763.00	27,630,000
システナ	7,300	4,495.00	32,813,500
デジタルアーツ	4,500	3,845.00	17,302,500
新日鉄住金ソリューションズ	14,300	2,906.00	41,555,800
キューブシステム	5,500	795.00	4,372,500
エイジア	1,500	1,466.00	2,199,000
コア	4,000	1,309.00	5,236,000
ソリトンシステムズ	3,100	1,401.00	4,343,100
ソフトクリエイトホールディングス	4,500	1,492.00	6,714,000
T I S	30,100	3,900.00	117,390,000

ネオス	3,000	429.00	1,287,000
電算システム	3,200	1,937.00	6,198,400
グリー	48,900	666.00	32,567,400
コーエーテクモホールディングス	15,400	2,254.00	34,711,600
三菱総合研究所	3,900	3,540.00	13,806,000
ボルテージ	1,800	982.00	1,767,600
電算	1,100	2,562.00	2,818,200
A G S	5,300	835.00	4,425,500
ファインデックス	7,800	732.00	5,709,600
ヒト・コミュニケーションズ	2,100	1,940.00	4,074,000
ブレインパッド	2,100	2,589.00	5,436,900
K L a b	17,600	1,626.00	28,617,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	6,600	2,327.00	15,358,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	994.00	1,590,400
ネクソン	100,600	3,850.00	387,310,000
アイスタイル	21,000	1,528.00	32,088,000
エムアップ	3,100	1,131.00	3,506,100
エイチーム	6,300	2,661.00	16,764,300
テクノスジャパン	8,400	940.00	7,896,000
コロプラ	29,400	990.00	29,106,000
モバイルクリエイト	7,800	372.00	2,901,600
ブロードリーフ	22,500	1,262.00	28,395,000
ハーツユナイテッドグループ	4,900	1,567.00	7,678,300
メディアドゥホールディングス	3,000	1,960.00	5,880,000
サイバーリンクス	1,500	1,325.00	1,987,500
フィックスターズ	1,600	7,850.00	12,560,000
VOYAGE GROUP	4,700	1,248.00	5,865,600
オブティム	1,600	2,414.00	3,862,400
セレス	2,800	1,782.00	4,989,600
ベリサーブ	1,200	3,170.00	3,804,000
ティーガイア	9,100	2,984.00	27,154,400
セック	900	3,190.00	2,871,000
日本アジアグループ	9,600	523.00	5,020,800
豆蔵ホールディングス	6,900	1,224.00	8,445,600
テクマトリックス	5,100	1,870.00	9,537,000
プロシップ	1,400	2,315.00	3,241,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	245,300	367.00	90,025,100
GMOペイメントゲートウェイ	6,400	9,140.00	58,496,000
ザッパラス	5,100	391.00	1,994,100
システムリサーチ	1,000	2,361.00	2,361,000
インターネットイニシアティブ	14,700	2,344.00	34,456,800
さくらインターネット	11,100	764.00	8,480,400

ヴィンクス	1,100	1,713.00	1,884,300
GMOクラウド	2,100	2,303.00	4,836,300
SRAホールディングス	4,800	3,420.00	16,416,000
Minorisoソリューションズ	1,900	1,558.00	2,960,200
朝日ネット	8,600	517.00	4,446,200
eBASE	1,900	1,165.00	2,213,500
アドソル日進	3,600	1,340.00	4,824,000
フリービット	6,200	908.00	5,629,600
コムチュア	4,600	3,650.00	16,790,000
サイバーコム	1,800	1,324.00	2,383,200
メディカル・データ・ビジョン	3,500	2,835.00	9,922,500
gumi	10,700	1,097.00	11,737,900
ショーケース・ティービー	1,800	1,556.00	2,800,800
モバイルファクトリー	1,800	1,286.00	2,314,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,400	3,385.00	4,739,000
PCIホールディングス	1,600	3,190.00	5,104,000
パイプドHD	1,500	1,438.00	2,157,000
アイビーシー	1,100	1,760.00	1,936,000
オープンドア	3,600	2,177.00	7,837,200
マイネット	1,900	1,458.00	2,770,200
アカツキ	1,800	6,220.00	11,196,000
Ubicomホールディングス	1,100	1,104.00	1,214,400
LINE	27,300	4,495.00	122,713,500
シンクロ・フード	800	5,020.00	4,016,000
オークネット	3,000	1,386.00	4,158,000
AOI TYO Holdings	7,600	1,260.00	9,576,000
マクロミル	8,500	2,907.00	24,709,500
ソルクシーズ	3,700	1,153.00	4,266,100
フェイス	3,300	1,172.00	3,867,600
ハイマックス	1,300	1,694.00	2,202,200
野村総合研究所	60,400	4,650.00	280,860,000
サイバネットシステム	7,700	758.00	5,836,600
CEホールディングス	2,800	890.00	2,492,000
日本システム技術	1,200	1,301.00	1,561,200
インテージホールディングス	10,600	1,200.00	12,720,000
東邦システムサイエンス	3,200	811.00	2,595,200
ソースネクスト	13,200	677.00	8,936,400
フォーカスシステムズ	5,400	947.00	5,113,800
クレスコ	2,100	3,835.00	8,053,500
フジ・メディア・ホールディングス	94,600	1,839.00	173,969,400
オービック	28,500	8,660.00	246,810,000
ジャストシステム	14,800	2,462.00	36,437,600

TDCソフト	4,100	1,169.00	4,792,900
ヤフー	651,300	512.00	333,465,600
トレンドマイクロ	44,100	6,160.00	271,656,000
インフォメーション・ディベロプメント	3,000	1,399.00	4,197,000
日本オラクル	14,600	8,430.00	123,078,000
アルファシステムズ	3,000	2,327.00	6,981,000
フューチャー	12,400	1,246.00	15,450,400
CAC Holdings	7,000	1,121.00	7,847,000
ソフトバンク・テクノロジー	3,900	1,974.00	7,698,600
トーセ	2,500	2,030.00	5,075,000
オービックビジネスコンサルタント	4,600	6,380.00	29,348,000
伊藤忠テクノソリューションズ	20,600	4,350.00	89,610,000
アイティフォー	11,300	751.00	8,486,300
東計電算	1,600	3,360.00	5,376,000
エクスネット	1,600	887.00	1,419,200
大塚商会	27,200	9,600.00	261,120,000
サイボウズ	12,500	547.00	6,837,500
ソフトブレーン	7,600	436.00	3,313,600
電通国際情報サービス	5,600	2,696.00	15,097,600
デジタルガレージ	16,300	3,215.00	52,404,500
EMシステムズ	3,200	2,511.00	8,035,200
ウェザーニューズ	3,100	3,250.00	10,075,000
C I J	7,300	689.00	5,029,700
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	1,749.00	1,749,000
日本エンタープライズ	10,000	227.00	2,270,000
WOWOW	4,400	3,365.00	14,806,000
スカラ	6,600	911.00	6,012,600
イマジカ・ロボットホールディングス	7,700	1,179.00	9,078,300
ネットワンシステムズ	36,900	1,590.00	58,671,000
システムソフト	22,800	139.00	3,169,200
アルゴグラフィックス	4,200	3,485.00	14,637,000
マーベラス	15,700	925.00	14,522,500
エイベックス	16,900	1,622.00	27,411,800
日本ユニシス	25,100	2,222.00	55,772,200
兼松エレクトロニクス	5,800	3,230.00	18,734,000
東京放送ホールディングス	54,500	2,325.00	126,712,500
日本テレビホールディングス	83,000	2,020.00	167,660,000
朝日放送	9,300	892.00	8,295,600
テレビ朝日ホールディングス	24,900	2,269.00	56,498,100
スカパーJ S A Tホールディングス	69,200	490.00	33,908,000
テレビ東京ホールディングス	7,500	2,667.00	20,002,500
日本BS放送	3,200	1,352.00	4,326,400

ビジョン	2,400	2,789.00	6,693,600
ワイヤレスゲート	4,400	1,153.00	5,073,200
コネクシオ	6,500	2,311.00	15,021,500
クロップス	2,100	852.00	1,789,200
日本電信電話	648,000	4,754.00	3,080,592,000
K D D I	813,100	2,623.50	2,133,167,850
光通信	10,900	15,500.00	168,950,000
N T T ドコモ	668,500	2,701.50	1,805,952,750
エムティーアイ	12,600	641.00	8,076,600
G M O インターネット	33,000	1,872.00	61,776,000
アйдママーケティングコミュニケーション	1,700	738.00	1,254,600
カドカワ	26,400	1,197.00	31,600,800
学研ホールディングス	3,100	5,090.00	15,779,000
ゼンリン	11,000	3,495.00	38,445,000
昭文社	4,400	769.00	3,383,600
インプレスホールディングス	7,600	232.00	1,763,200
アイネット	5,200	1,590.00	8,268,000
松竹	6,000	15,330.00	91,980,000
東宝	59,400	3,495.00	207,603,000
東映	3,400	11,550.00	39,270,000
エヌ・ティ・ティ・データ	280,600	1,113.00	312,307,800
ピー・シー・エー	1,400	1,859.00	2,602,600
ビジネスブレイン太田昭和	1,600	1,958.00	3,132,800
D T S	9,400	3,820.00	35,908,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	42,000	4,440.00	186,480,000
シーイーシー	5,400	3,245.00	17,523,000
カブコン	19,400	4,470.00	86,718,000
アイ・エス・ビー	1,900	1,345.00	2,555,500
ジャステック	5,400	1,310.00	7,074,000
S C S K	20,900	4,275.00	89,347,500
日本システムウエア	3,000	2,587.00	7,761,000
アイネス	11,700	1,075.00	12,577,500
T K C	8,400	4,615.00	38,766,000
富士ソフト	12,600	4,010.00	50,526,000
N S D	14,900	2,174.00	32,392,600
コナミホールディングス	36,900	5,740.00	211,806,000
福井コンピュータホールディングス	2,700	2,462.00	6,647,400
J B C C ホールディングス	7,400	1,076.00	7,962,400
ミロク情報サービス	8,000	3,255.00	26,040,000
ソフトバンクグループ	408,800	8,873.00	3,627,282,400
ハウスイ	700	1,174.00	821,800
高千穂交易	3,600	1,275.00	4,590,000

伊藤忠食品	2,200	5,880.00	12,936,000
エレマテック	4,200	2,357.00	9,899,400
JALUX	2,600	3,105.00	8,073,000
あらた	4,500	5,050.00	22,725,000
トーメンデバイス	1,400	2,898.00	4,057,200
東京エレクトロン デバイス	3,300	2,153.00	7,104,900
フィールズ	7,100	1,132.00	8,037,200
双日	536,300	344.00	184,487,200
アルフレッサ ホールディングス	100,700	2,374.00	239,061,800
横浜冷凍	21,700	1,104.00	23,956,800
神栄	1,300	1,429.00	1,857,700
ラサ商事	4,100	934.00	3,829,400
ラクーン	5,300	722.00	3,826,600
アルコニックス	9,600	2,422.00	23,251,200
神戸物産	5,900	4,220.00	24,898,000
ペッパーフードサービス	4,900	4,770.00	23,373,000
あい ホールディングス	13,000	3,015.00	39,195,000
ディーブイエックス	3,300	1,251.00	4,128,300
ダイワボウホールディングス	7,700	4,320.00	33,264,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,800	2,916.00	48,988,800
ラクト・ジャパン	1,300	3,880.00	5,044,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,300	1,030.00	17,819,000
八洲電機	7,100	867.00	6,155,700
メディアスホールディングス	1,400	2,773.00	3,882,200
UKCホールディングス	5,900	2,305.00	13,599,500
ジューテックホールディングス	2,100	1,267.00	2,660,700
大光	2,100	928.00	1,948,800
OCHIホールディングス	2,700	1,450.00	3,915,000
TOKAIホールディングス	47,900	1,172.00	56,138,800
大阪工機	1,400	1,074.00	1,503,600
三洋貿易	5,000	2,353.00	11,765,000
ビューティガレージ	1,200	2,238.00	2,685,600
ウイン・パートナーズ	6,700	1,706.00	11,430,200
ミタチ産業	2,100	1,652.00	3,469,200
シップヘルスケアホールディングス	18,900	3,800.00	71,820,000
明治電機工業	3,100	2,017.00	6,252,700
デリカフーズホールディングス	1,800	1,435.00	2,583,000
スターティア	2,100	969.00	2,034,900
コメダホールディングス	16,900	2,162.00	36,537,800
富士興産	3,600	630.00	2,268,000
協栄産業	1,100	1,997.00	2,196,700
小野建	8,000	1,947.00	15,576,000

佐島電機	6,800	1,080.00	7,344,000
エコートレーディング	2,100	743.00	1,560,300
伯東	5,600	1,632.00	9,139,200
コンドーテック	7,300	982.00	7,168,600
中山福	5,300	778.00	4,123,400
ナガイレーベン	12,000	2,762.00	33,144,000
三菱食品	10,000	3,095.00	30,950,000
松田産業	6,700	1,958.00	13,118,600
第一興商	13,500	5,530.00	74,655,000
メディバルホールディングス	90,800	2,142.00	194,493,600
S P K	1,900	3,025.00	5,747,500
萩原電気	3,100	3,490.00	10,819,000
アズワン	7,100	6,980.00	49,558,000
スズデン	3,200	1,735.00	5,552,000
尾家産業	2,700	1,303.00	3,518,100
シモジマ	5,600	1,123.00	6,288,800
ドウシシャ	9,600	2,440.00	23,424,000
小津産業	2,000	2,224.00	4,448,000
高速	5,500	1,226.00	6,743,000
たけびし	3,200	1,843.00	5,897,600
リックス	2,100	2,235.00	4,693,500
丸文	8,200	1,061.00	8,700,200
ハピネット	6,200	1,711.00	10,608,200
橋本総業ホールディングス	1,900	1,864.00	3,541,600
日本ライフライン	25,800	3,445.00	88,881,000
エクセル	3,600	2,798.00	10,072,800
マルカキカイ	2,900	2,145.00	6,220,500
I D O M	27,500	716.00	19,690,000
日本エム・ディ・エム	6,200	983.00	6,094,600
進和	5,400	2,275.00	12,285,000
エスケイジャパン	2,300	678.00	1,559,400
ダイトロン	4,200	2,408.00	10,113,600
シークス	5,800	4,805.00	27,869,000
田中商事	2,800	800.00	2,240,000
オーハシテクニカ	5,200	1,793.00	9,323,600
白銅	3,300	2,476.00	8,170,800
伊藤忠商事	665,100	2,038.50	1,355,806,350
丸紅	744,800	807.10	601,128,080
高島	1,600	2,223.00	3,556,800
長瀬産業	54,600	1,831.00	99,972,600
蝶理	5,800	1,907.00	11,060,600
豊田通商	101,200	4,090.00	413,908,000

三共生興	15,700	514.00	8,069,800
兼松	38,600	1,432.00	55,275,200
ツカモトコーポレーション	1,700	1,246.00	2,118,200
三井物産	769,900	1,922.50	1,480,132,750
日本紙パルプ商事	4,700	4,295.00	20,186,500
日立ハイテクノロジーズ	31,500	5,080.00	160,020,000
カメイ	11,900	1,647.00	19,599,300
東都水産	1,400	1,987.00	2,781,800
OUGホールディングス	1,400	2,704.00	3,785,600
スターゼン	3,500	5,170.00	18,095,000
山善	35,400	1,206.00	42,692,400
椿本興業	2,100	3,305.00	6,940,500
住友商事	571,600	1,828.50	1,045,170,600
内田洋行	4,200	3,200.00	13,440,000
三菱商事	636,000	2,976.00	1,892,736,000
第一実業	4,100	3,230.00	13,243,000
キャノンマーケティングジャパン	25,900	2,934.00	75,990,600
西華産業	5,600	2,674.00	14,974,400
佐藤商事	8,200	1,151.00	9,438,200
菱洋エレクトロ	8,500	1,875.00	15,937,500
東京産業	9,200	599.00	5,510,800
ユアサ商事	8,600	3,765.00	32,379,000
神鋼商事	2,000	3,705.00	7,410,000
小林産業	6,200	350.00	2,170,000
阪和興業	16,900	4,950.00	83,655,000
正栄食品工業	5,000	4,045.00	20,225,000
カナデン	8,800	1,344.00	11,827,200
菱電商事	6,600	1,861.00	12,282,600
フルサト工業	5,000	1,778.00	8,890,000
岩谷産業	20,100	4,130.00	83,013,000
すてきナイスグループ	3,900	1,446.00	5,639,400
昭光通商	32,000	122.00	3,904,000
ニチモウ	1,400	1,815.00	2,541,000
極東貿易	13,000	465.00	6,045,000
イワキ	13,000	415.00	5,395,000
三愛石油	24,500	1,475.00	36,137,500
稲畑産業	21,900	1,577.00	34,536,300
G S I クレオス	2,500	1,940.00	4,850,000
明和産業	8,500	505.00	4,292,500
ワキタ	19,300	1,281.00	24,723,300
東邦ホールディングス	26,800	2,573.00	68,956,400
サンゲツ	30,600	2,253.00	68,941,800

ミツウロコグループホールディングス	13,400	770.00	10,318,000
シナネンホールディングス	4,300	2,722.00	11,704,600
伊藤忠エネクス	20,200	1,020.00	20,604,000
サンリオ	25,600	1,972.00	50,483,200
サンワテクノス	5,400	2,153.00	11,626,200
リョーサン	11,400	3,945.00	44,973,000
新光商事	10,000	1,945.00	19,450,000
トーホー	4,100	2,518.00	10,323,800
三信電気	8,400	1,932.00	16,228,800
東陽テクニカ	10,600	967.00	10,250,200
モスフードサービス	11,900	3,240.00	38,556,000
加賀電子	8,200	2,752.00	22,566,400
ソーダニッカ	9,500	695.00	6,602,500
立花エレテック	6,200	2,196.00	13,615,200
フォーバル	4,100	951.00	3,899,100
PAL TAC	12,700	5,330.00	67,691,000
三谷産業	10,000	443.00	4,430,000
西本Wismettacホールディングス	1,800	4,290.00	7,722,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,490.00	1,192,000
ヤマタネ	4,600	1,974.00	9,080,400
丸紅建材リース	9,000	233.00	2,097,000
日鉄住金物産	7,100	6,140.00	43,594,000
泉州電業	3,000	2,888.00	8,664,000
トラスコ中山	18,900	2,857.00	53,997,300
オートバックスセブン	36,000	2,105.00	75,780,000
モリト	7,400	958.00	7,089,200
加藤産業	14,200	3,715.00	52,753,000
イノテック	7,900	1,267.00	10,009,300
イエローハット	8,600	3,285.00	28,251,000
J Kホールディングス	9,300	888.00	8,258,400
日伝	7,500	2,182.00	16,365,000
北沢産業	7,700	284.00	2,186,800
杉本商事	4,900	1,847.00	9,050,300
因幡電機産業	11,900	5,000.00	59,500,000
バイテックホールディングス	4,100	1,680.00	6,888,000
東テク	3,000	2,428.00	7,284,000
ミスミグループ本社	105,200	3,150.00	331,380,000
アルテック	7,900	341.00	2,693,900
タキヒヨー	3,000	2,301.00	6,903,000
蔵王産業	1,500	1,873.00	2,809,500
スズケン	41,300	4,305.00	177,796,500
ジェコス	6,400	1,259.00	8,057,600

ルネサスイーストン	8,500	740.00	6,290,000
ローソン	22,900	7,280.00	166,712,000
サンエー	6,900	5,500.00	37,950,000
カワチ薬品	7,100	2,615.00	18,566,500
エービーシー・マート	16,500	6,860.00	113,190,000
ハードオフコーポレーション	4,100	1,166.00	4,780,600
アスクル	8,000	3,965.00	31,720,000
ゲオホールディングス	16,700	2,061.00	34,418,700
アダストリア	14,100	2,241.00	31,598,100
ジーフット	5,700	791.00	4,508,700
くらコーポレーション	5,400	6,550.00	35,370,000
キャンドウ	4,400	1,750.00	7,700,000
パルグループホールディングス	4,700	3,090.00	14,523,000
エディオン	35,500	1,339.00	47,534,500
サーラコーポレーション	16,000	680.00	10,880,000
ワッツ	3,800	1,080.00	4,104,000
ハローズ	3,500	2,534.00	8,869,000
あみやき亭	2,000	5,270.00	10,540,000
ひらまつ	12,900	549.00	7,082,100
大黒天物産	2,200	5,290.00	11,638,000
ハニーズホールディングス	9,000	1,024.00	9,216,000
ファーマライズホールディングス	2,300	620.00	1,426,000
アルペン	7,000	2,503.00	17,521,000
ハブ	1,900	1,288.00	2,447,200
クオール	9,600	2,281.00	21,897,600
ジーンズ	6,200	5,240.00	32,488,000
ビックカメラ	52,700	1,646.00	86,744,200
DCMホールディングス	49,000	1,080.00	52,920,000
Monotaro	32,300	3,540.00	114,342,000
東京一番フーズ	2,500	704.00	1,760,000
DDホールディングス	2,000	3,745.00	7,490,000
きちり	2,600	745.00	1,937,000
アークランドサービスホールディングス	7,700	2,244.00	17,278,800
J.フロント リテイリング	108,300	1,947.00	210,860,100
ドトール・日レスホールディングス	16,000	2,579.00	41,264,000
マツモトキヨシホールディングス	37,500	4,480.00	168,000,000
broncoビリー	4,800	3,335.00	16,008,000
スタートトゥデイ	89,100	2,967.00	264,359,700
トレジャー・ファクトリー	2,800	869.00	2,433,200
物語コーポレーション	2,600	10,050.00	26,130,000
ココカラファイン	9,500	7,000.00	66,500,000
三越伊勢丹ホールディングス	169,600	1,266.00	214,713,600

H a m e e	2,400	1,890.00	4,536,000	
ウエルシアホールディングス	24,000	4,730.00	113,520,000	
クリエイトSDホールディングス	13,400	2,701.00	36,193,400	
丸善CHIホールディングス	10,700	342.00	3,659,400	
ミサワ	1,900	443.00	841,700	
ティーライフ	1,300	1,313.00	1,706,900	
エー・ピーカンパニー	1,900	816.00	1,550,400	
チムニー	2,800	2,889.00	8,089,200	
シュッピン	5,600	1,263.00	7,072,800	
ネクステージ	9,900	1,105.00	10,939,500	
ジョイフル本田	13,300	3,485.00	46,350,500	
鳥貴族	3,400	2,991.00	10,169,400	
キリン堂ホールディングス	3,300	1,896.00	6,256,800	
ホットランド	5,400	1,297.00	7,003,800	
すかいらーく	56,400	1,470.00	82,908,000	
綿半ホールディングス	3,400	3,910.00	13,294,000	
ヨシックス	1,500	3,915.00	5,872,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,400	1,130.00	34,352,000	
ブックオフコーポレーション	5,200	845.00	4,394,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	1,001.00	3,903,900	
B E E N O S	1,500	1,643.00	2,464,500	
あさひ	7,000	1,316.00	9,212,000	
日本調剤	3,300	3,425.00	11,302,500	
コスモス薬品	4,600	19,820.00	91,172,000	
トーエル	4,600	1,024.00	4,710,400	
一六堂	2,300	461.00	1,060,300	
オンリー	1,500	892.00	1,338,000	
セブン&アイ・ホールディングス	379,900	4,488.00	1,704,991,200	
薬王堂	4,000	3,530.00	14,120,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	24,600	1,250.00	30,750,000	
ツルハホールディングス	19,600	15,470.00	303,212,000	
サンマルクホールディングス	6,600	3,175.00	20,955,000	
フェリシモ	2,400	1,234.00	2,961,600	
トリドールホールディングス	11,200	3,640.00	40,768,000	
T O K Y O B A S E	1,800	4,270.00	7,686,000	
サツドラホールディングス	1,300	1,973.00	2,564,900	
ダイユー・リックホールディングス	4,400	1,336.00	5,878,400	
パロックジャパンリミテッド	7,500	908.00	6,810,000	
クスリのアオキホールディングス	7,200	5,960.00	42,912,000	
スシローグローバルホールディングス	8,400	4,535.00	38,094,000	
L I X I L ビバ	8,800	2,154.00	18,955,200	

メディカルシステムネットワーク	10,600	581.00	6,158,600
総合メディカル	4,000	6,130.00	24,520,000
はるやまホールディングス	4,400	1,081.00	4,756,400
ノジマ	16,000	2,548.00	40,768,000
カッパ・クリエイト	11,300	1,276.00	14,418,800
ライトオン	7,900	910.00	7,189,000
良品計画	12,000	36,000.00	432,000,000
三城ホールディングス	11,700	530.00	6,201,000
アドヴァン	9,500	1,086.00	10,317,000
アルビス	2,100	3,005.00	6,310,500
コナカ	12,000	585.00	7,020,000
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,780.00	2,136,000
G - 7ホールディングス	2,700	2,436.00	6,577,200
イオン北海道	9,400	821.00	7,717,400
コジマ	16,200	357.00	5,783,400
ヒマラヤ	2,600	1,276.00	3,317,600
コーナン商事	13,000	2,606.00	33,878,000
エコス	3,800	1,304.00	4,955,200
マルシェ	2,600	815.00	2,119,000
ドンキホーテホールディングス	58,800	5,940.00	349,272,000
西松屋チェーン	20,100	1,229.00	24,702,900
ゼンショーホールディングス	47,100	2,240.00	105,504,000
幸楽苑ホールディングス	5,900	1,885.00	11,121,500
ハークスレイ	2,400	1,119.00	2,685,600
サイゼリヤ	13,500	3,070.00	41,445,000
V Tホールディングス	31,400	570.00	17,898,000
魚力	2,700	1,191.00	3,215,700
ポブラ	2,400	901.00	2,162,400
フジ・コーポレーション	1,600	2,541.00	4,065,600
ユナイテッドアローズ	11,300	4,175.00	47,177,500
ハイデイ日高	10,000	3,370.00	33,700,000
京都きもの友禅	6,000	784.00	4,704,000
コロワイド	30,200	2,465.00	74,443,000
ピーシーデポコーポレーション	13,900	778.00	10,814,200
壱番屋	6,400	4,580.00	29,312,000
トップカルチャー	3,600	492.00	1,771,200
P L A N T	2,200	1,393.00	3,064,600
スギホールディングス	19,900	5,820.00	115,818,000
ヴィア・ホールディングス	8,100	711.00	5,759,100
スクロール	14,400	459.00	6,609,600
ヨンドシーホールディングス	9,300	2,691.00	25,026,300
ユニー・ファミリーマートホールディングス	29,000	8,060.00	233,740,000

木曽路	11,200	2,739.00	30,676,800
S R S ホールディングス	11,000	956.00	10,516,000
タカキュー	7,700	222.00	1,709,400
ケーヨー	17,200	626.00	10,767,200
上新電機	10,800	3,880.00	41,904,000
日本瓦斯	16,700	4,505.00	75,233,500
ロイヤルホールディングス	16,100	2,857.00	45,997,700
いなげや	10,200	1,815.00	18,513,000
島忠	21,900	3,525.00	77,197,500
チヨダ	10,800	2,738.00	29,570,400
ライフコーポレーション	6,900	2,885.00	19,906,500
リンガーハット	11,300	2,451.00	27,696,300
MrMaxHD	11,700	760.00	8,892,000
テナアライド	8,500	478.00	4,063,000
AOKIホールディングス	18,300	1,697.00	31,055,100
オークワ	13,000	1,114.00	14,482,000
コメリ	14,100	3,070.00	43,287,000
青山商事	17,500	4,435.00	77,612,500
しまむら	10,600	13,040.00	138,224,000
はせがわ	5,200	487.00	2,532,400
高島屋	142,000	1,099.00	156,058,000
松屋	18,300	1,563.00	28,602,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	43,000	2,083.00	89,569,000
近鉄百貨店	3,500	4,020.00	14,070,000
パルコ	8,900	1,478.00	13,154,200
丸井グループ	86,800	2,012.00	174,641,600
アクシアル リテイリング	7,600	4,310.00	32,756,000
イオン	348,800	1,865.50	650,686,400
イズミ	16,400	7,180.00	117,752,000
東武ストア	1,100	3,100.00	3,410,000
平和堂	18,400	2,446.00	45,006,400
フジ	10,900	2,283.00	24,884,700
ヤオコー	10,300	5,850.00	60,255,000
ゼビオホールディングス	12,400	2,194.00	27,205,600
ケーズホールディングス	38,500	3,045.00	117,232,500
Olympicグループ	5,700	599.00	3,414,300
日産東京販売ホールディングス	13,900	401.00	5,573,900
Genky DrugStores	3,600	3,360.00	12,096,000
アインホールディングス	12,200	6,800.00	82,960,000
元気寿司	2,300	2,762.00	6,352,600
ヤマダ電機	304,000	675.00	205,200,000
アーランドサカモト	15,500	1,779.00	27,574,500

ニトリホールディングス	36,000	17,540.00	631,440,000
グルメ杵屋	7,000	1,158.00	8,106,000
愛眼	7,300	475.00	3,467,500
ケーユーホールディングス	4,900	1,108.00	5,429,200
吉野家ホールディングス	30,000	1,972.00	59,160,000
松屋フーズ	4,400	3,920.00	17,248,000
サガミチェーン	12,400	1,383.00	17,149,200
関西スーパーマーケット	7,100	1,136.00	8,065,600
王将フードサービス	6,700	5,040.00	33,768,000
プレナス	10,300	2,121.00	21,846,300
ミニストップ	6,800	2,176.00	14,796,800
アークス	17,100	2,617.00	44,750,700
パローホールディングス	21,100	2,968.00	62,624,800
藤久	800	1,670.00	1,336,000
ベルク	4,100	6,130.00	25,133,000
大庄	5,000	1,727.00	8,635,000
ファーストリテイリング	15,200	42,940.00	652,688,000
サンドラッグ	38,400	4,895.00	187,968,000
サックスパー ホールディングス	8,800	1,151.00	10,128,800
ヤマザワ	2,000	1,737.00	3,474,000
やまや	1,900	3,020.00	5,738,000
ベルーナ	22,500	1,279.00	28,777,500
島根銀行	1,900	1,403.00	2,665,700
じもとホールディングス	62,100	187.00	11,612,700
めぶきフィナンシャルグループ	471,600	441.00	207,975,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	12,300	2,783.00	34,230,900
九州フィナンシャルグループ	148,900	611.00	90,977,900
ゆうちょ銀行	257,100	1,461.00	375,623,100
富山第一銀行	23,400	509.00	11,910,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	551,800	617.00	340,460,600
西日本フィナンシャルホールディングス	61,600	1,328.00	81,804,800
新生銀行	78,600	1,683.00	132,283,800
あおぞら銀行	54,100	4,435.00	239,933,500
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,412,000	769.10	4,931,469,200
りそなホールディングス	995,900	618.90	616,362,510
三井住友トラスト・ホールディングス	178,400	4,358.00	777,467,200
三井住友フィナンシャルグループ	686,900	4,717.00	3,240,107,300
第四銀行	11,100	4,915.00	54,556,500
北越銀行	9,100	2,401.00	21,849,100
千葉銀行	325,000	882.00	286,650,000
群馬銀行	184,300	654.00	120,532,200
武蔵野銀行	14,500	3,605.00	52,272,500

千葉興業銀行	25,300	505.00	12,776,500	
筑波銀行	38,200	368.00	14,057,600	
七十七銀行	28,500	2,683.00	76,465,500	
青森銀行	7,000	3,375.00	23,625,000	
秋田銀行	5,800	2,906.00	16,854,800	
山形銀行	10,200	2,392.00	24,398,400	
岩手銀行	6,300	4,325.00	27,247,500	
東邦銀行	81,700	394.00	32,189,800	
東北銀行	4,700	1,473.00	6,923,100	
みちのく銀行	5,900	1,800.00	10,620,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	368,000	562.00	206,816,000	
静岡銀行	240,000	1,094.00	262,560,000	
十六銀行	12,200	2,918.00	35,599,600	
スルガ銀行	92,800	1,880.00	174,464,000	
八十二銀行	164,300	640.00	105,152,000	
山梨中央銀行	56,000	434.00	24,304,000	
大垣共立銀行	14,300	2,802.00	40,068,600	
福井銀行	7,800	2,606.00	20,326,800	
北國銀行	10,300	4,405.00	45,371,500	
清水銀行	3,100	2,991.00	9,272,100	
富山銀行	1,700	3,930.00	6,681,000	
滋賀銀行	85,000	562.00	47,770,000	
南都銀行	10,600	3,000.00	31,800,000	
百五銀行	87,100	532.00	46,337,200	
京都銀行	34,700	5,980.00	207,506,000	
紀陽銀行	34,100	1,768.00	60,288,800	
三重銀行	4,000	2,338.00	9,352,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	60,400	1,551.00	93,680,400	
広島銀行	134,000	844.00	113,096,000	
山陰合同銀行	53,800	1,036.00	55,736,800	
中国銀行	62,800	1,343.00	84,340,400	
鳥取銀行	2,900	1,745.00	5,060,500	
伊予銀行	129,500	866.00	112,147,000	
百十四銀行	96,000	359.00	34,464,000	
四国銀行	13,900	1,538.00	21,378,200	
阿波銀行	73,000	669.00	48,837,000	
大分銀行	5,200	4,120.00	21,424,000	
宮崎銀行	6,000	3,465.00	20,790,000	
佐賀銀行	5,500	2,541.00	13,975,500	
十八銀行	56,000	282.00	15,792,000	
沖縄銀行	8,800	4,355.00	38,324,000	
琉球銀行	17,700	1,629.00	28,833,300	

セブン銀行	340,400	378.00	128,671,200
みずほフィナンシャルグループ	12,330,900	199.40	2,458,781,460
高知銀行	3,300	1,368.00	4,514,400
山口フィナンシャルグループ	85,000	1,284.00	109,140,000
長野銀行	3,000	1,892.00	5,676,000
名古屋銀行	7,300	4,000.00	29,200,000
北洋銀行	136,800	371.00	50,752,800
愛知銀行	3,000	5,390.00	16,170,000
第三銀行	5,200	1,660.00	8,632,000
中京銀行	3,700	2,318.00	8,576,600
大光銀行	3,100	2,370.00	7,347,000
愛媛銀行	12,700	1,274.00	16,179,800
トマト銀行	3,600	1,528.00	5,500,800
みなと銀行	8,400	2,103.00	17,665,200
京葉銀行	80,000	496.00	39,680,000
関西アーバン銀行	12,900	1,419.00	18,305,100
栃木銀行	47,300	426.00	20,149,800
北日本銀行	2,800	3,010.00	8,428,000
東和銀行	16,000	1,392.00	22,272,000
福島銀行	8,700	803.00	6,986,100
大東銀行	4,400	1,412.00	6,212,800
トモニホールディングス	74,800	486.00	36,352,800
フィデアホールディングス	88,100	198.00	17,443,800
池田泉州ホールディングス	96,300	423.00	40,734,900
F P G	31,800	1,419.00	45,124,200
マーキュリアインベストメント	2,000	1,259.00	2,518,000
S B Iホールディングス	102,700	2,498.00	256,544,600
ジャフコ	13,000	5,510.00	71,630,000
大和証券グループ本社	777,000	717.60	557,575,200
野村ホールディングス	1,561,600	653.00	1,019,724,800
岡三証券グループ	78,000	686.00	53,508,000
丸三証券	29,300	1,032.00	30,237,600
東洋証券	33,000	307.00	10,131,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	100,700	783.00	78,848,100
光世証券	2,300	1,401.00	3,222,300
水戸証券	29,000	387.00	11,223,000
いちよし証券	19,300	1,276.00	24,626,800
松井証券	44,600	1,065.00	47,499,000
だいこう証券ビジネス	4,700	673.00	3,163,100
マネックスグループ	96,700	382.00	36,939,400
カブドットコム証券	59,000	376.00	22,184,000
極東証券	12,300	1,565.00	19,249,500

岩井コスモホールディングス	9,400	1,375.00	12,925,000
藍澤証券	17,200	802.00	13,794,400
マネーパートナーズグループ	12,200	389.00	4,745,800
かんぽ生命保険	34,300	2,744.00	94,119,200
S O M P Oホールディングス	178,000	4,070.00	724,460,000
アニコム ホールディングス	6,200	3,480.00	21,576,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	237,300	3,361.00	797,565,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	74,600	1,966.00	146,663,600
第一生命ホールディングス	513,400	2,142.00	1,099,702,800
東京海上ホールディングス	341,900	4,982.00	1,703,345,800
アドバンテッジリスクマネジメント	2,200	1,388.00	3,053,600
T & Dホールディングス	280,700	1,776.00	498,523,200
アドバンスクリエイト	2,100	1,967.00	4,130,700
全国保証	25,600	4,795.00	122,752,000
イントラスト	700	1,820.00	1,274,000
アルヒ	7,800	1,469.00	11,458,200
クレディセゾン	68,900	1,892.00	130,358,800
アクリーティブ	5,000	340.00	1,700,000
芙蓉総合リース	10,400	7,180.00	74,672,000
興銀リース	17,100	2,781.00	47,555,100
東京センチュリー	18,300	6,070.00	111,081,000
日本証券金融	37,400	669.00	25,020,600
アイフル	152,300	374.00	56,960,200
リコーリース	7,100	3,605.00	25,595,500
イオンフィナンシャルサービス	64,400	2,536.00	163,318,400
アコム	182,400	479.00	87,369,600
ジャックス	11,000	2,526.00	27,786,000
オリエントコーポレーション	196,400	172.00	33,780,800
日立キャピタル	25,000	2,825.00	70,625,000
アプラスフィナンシャル	44,200	108.00	4,773,600
オリックス	605,300	1,919.50	1,161,873,350
三菱U F Jリース	230,300	672.00	154,761,600
九州リースサービス	3,900	864.00	3,369,600
日本取引所グループ	266,700	1,861.00	496,328,700
イー・ギャランティ	2,400	4,110.00	9,864,000
アサックス	1,300	1,883.00	2,447,900
N E Cキャピタルソリューション	3,700	2,120.00	7,844,000
いちご	129,800	455.00	59,059,000
日本駐車場開発	109,800	185.00	20,313,000
ヒューリック	189,500	1,204.00	228,158,000
三栄建築設計	3,700	2,149.00	7,951,300
スター・マイカ	3,300	1,885.00	6,220,500

野村不動産ホールディングス	60,400	2,658.00	160,543,200
三重交通グループホールディングス	18,800	522.00	9,813,600
サムティ	7,800	1,867.00	14,562,600
ディア・ライフ	9,300	552.00	5,133,600
コーセーアールイー	1,600	1,072.00	1,715,200
エー・ディー・ワークス	123,300	43.00	5,301,900
日本商業開発	5,200	1,910.00	9,932,000
プレサンスコーポレーション	12,600	1,657.00	20,878,200
ユニゾホールディングス	10,600	2,963.00	31,407,800
THEグローバル社	4,400	915.00	4,026,000
日本管理センター	6,100	1,769.00	10,790,900
サンセイランディック	2,700	1,413.00	3,815,100
エストラスト	1,300	1,053.00	1,368,900
フージャースホールディングス	10,200	778.00	7,935,600
オープンハウス	14,800	6,670.00	98,716,000
東急不動産ホールディングス	219,800	816.00	179,356,800
飯田グループホールディングス	75,700	1,990.00	150,643,000
イーランド	1,100	1,244.00	1,368,400
ムゲンエステート	5,700	1,321.00	7,529,700
ファーストブラザーズ	2,600	1,463.00	3,803,800
ハウズドゥ	1,500	2,895.00	4,342,500
シーアールイー	1,500	1,652.00	2,478,000
ケイアイスター不動産	3,300	2,837.00	9,362,100
パーク24	50,300	2,555.00	128,516,500
パラカ	2,900	2,427.00	7,038,300
三井不動産	453,200	2,578.50	1,168,576,200
三菱地所	675,500	1,896.50	1,281,085,750
平和不動産	16,000	2,026.00	32,416,000
東京建物	99,200	1,707.00	169,334,400
ダイビル	23,400	1,354.00	31,683,600
京阪神ビルディング	15,300	869.00	13,295,700
住友不動産	218,000	3,932.00	857,176,000
大京	14,600	2,231.00	32,572,600
テーオーシー	31,500	846.00	26,649,000
東京楽天地	1,500	5,120.00	7,680,000
レオパレス21	108,300	806.00	87,289,800
スターツコーポレーション	12,400	2,868.00	35,563,200
フジ住宅	11,800	879.00	10,372,200
空港施設	9,600	633.00	6,076,800
明和地所	5,100	811.00	4,136,100
ゴールドクレスト	7,200	2,214.00	15,940,800
日本エスリード	3,600	2,195.00	7,902,000

日神不動産	12,300	803.00	9,876,900
日本エスコン	16,300	1,058.00	17,245,400
タカラレーベン	42,600	488.00	20,788,800
サンヨーハウジング名古屋	4,800	1,245.00	5,976,000
イオンモール	58,500	2,220.00	129,870,000
ファースト住建	3,400	1,748.00	5,943,200
カチタス	9,300	3,220.00	29,946,000
トーセイ	11,200	1,351.00	15,131,200
穴吹興産	1,000	3,080.00	3,080,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	56,500	1,313.00	74,184,500
サンフロンティア不動産	11,100	1,241.00	13,775,100
エフ・ジェー・ネクスト	7,100	862.00	6,120,200
インテリックス	2,600	1,128.00	2,932,800
ランドビジネス	5,400	333.00	1,798,200
グランディハウス	8,100	478.00	3,871,800
日本空港ビルデング	26,600	4,030.00	107,198,000
日本工営	5,900	2,963.00	17,481,700
LIFULL	30,900	1,081.00	33,402,900
ジェイエイシーリクルートメント	7,200	2,239.00	16,120,800
日本M&Aセンター	30,400	6,850.00	208,240,000
メンバーズ	2,400	865.00	2,076,000
中広	1,100	729.00	801,900
タケエイ	9,200	1,256.00	11,555,200
トラスト・テック	4,000	3,250.00	13,000,000
コシダカホールディングス	4,600	6,670.00	30,682,000
パソナグループ	7,300	2,368.00	17,286,400
CDS	2,500	1,366.00	3,415,000
リンクアンドモチベーション	16,500	1,101.00	18,166,500
GCA	10,200	939.00	9,577,800
エス・エム・エス	17,400	4,350.00	75,690,000
パーソルホールディングス	81,200	2,793.00	226,791,600
リニカル	5,800	1,467.00	8,508,600
クックパッド	27,800	606.00	16,846,800
エスクリ	3,200	967.00	3,094,400
アイ・ケイ・ケイ	5,400	754.00	4,071,600
学情	4,100	1,624.00	6,658,400
スタジオアリス	4,500	2,707.00	12,181,500
シミックホールディングス	4,900	2,695.00	13,205,500
NJS	2,300	1,646.00	3,785,800
総合警備保障	35,000	5,210.00	182,350,000
カカクコム	67,600	1,933.00	130,670,800
アイロムグループ	3,000	3,005.00	9,015,000

セントケア・ホールディング	3,900	731.00	2,850,900
サイネックス	1,500	867.00	1,300,500
ルネサンス	4,400	1,776.00	7,814,400
ディップ	12,400	3,345.00	41,478,000
オプトホールディング	6,300	1,163.00	7,326,900
ツクイ	20,800	851.00	17,700,800
キャリアデザインセンター	2,100	2,128.00	4,468,800
エムスリー	92,600	4,370.00	404,662,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,300	618.00	4,511,400
プラス	600	1,029.00	617,400
アウトソーシング	26,400	2,068.00	54,595,200
ウェルネット	7,400	1,152.00	8,524,800
ワールドホールディングス	2,900	3,905.00	11,324,500
ディー・エヌ・エー	47,400	1,923.00	91,150,200
博報堂D Yホールディングス	122,200	1,577.00	192,709,400
ぐるなび	14,000	1,445.00	20,230,000
エスアールジータカミヤ	10,700	670.00	7,169,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,100	844.00	9,368,400
ファンコミュニケーションズ	24,800	749.00	18,575,200
ライク	3,500	2,014.00	7,049,000
ビジネス・ブレークスルー	4,400	484.00	2,129,600
WDBホールディングス	4,000	4,260.00	17,040,000
ティア	4,800	1,068.00	5,126,400
C D G	900	1,758.00	1,582,200
バリューコマース	8,000	1,354.00	10,832,000
インフォマート	44,600	901.00	40,184,600
J Pホールディングス	28,400	328.00	9,315,200
E P Sホールディングス	13,300	2,385.00	31,720,500
レグス	2,300	895.00	2,058,500
プレステージ・インターナショナル	18,400	1,421.00	26,146,400
アミューズ	5,900	3,905.00	23,039,500
ドリームインキュベータ	3,000	2,800.00	8,400,000
クイック	5,600	2,110.00	11,816,000
T A C	5,800	318.00	1,844,400
ケネディクス	116,600	707.00	82,436,200
電通	107,100	4,970.00	532,287,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,002.00	4,308,600
ぴあ	2,900	5,540.00	16,066,000
イオンファンタジー	2,800	5,000.00	14,000,000
シーティーエス	9,200	804.00	7,396,800
ネクシィーズグループ	3,500	1,720.00	6,020,000
みらかホールディングス	26,200	4,205.00	110,171,000

アルプス技研	7,800	2,272.00	17,721,600
ダイオーズ	1,800	1,332.00	2,397,600
日本空調サービス	9,500	772.00	7,334,000
オリエンタルランド	103,900	10,740.00	1,115,886,000
ダスキン	23,700	2,668.00	63,231,600
明光ネットワークジャパン	11,200	1,285.00	14,392,000
ファルコホールディングス	4,600	1,741.00	8,008,600
ラウンドワン	27,300	1,845.00	50,368,500
リゾートトラスト	37,300	2,431.00	90,676,300
ビー・エム・エル	11,400	2,661.00	30,335,400
ワタベウェディング	1,600	607.00	971,200
りらいあコミュニケーションズ	14,000	1,312.00	18,368,000
リソー教育	15,100	822.00	12,412,200
早稲田アカデミー	1,300	1,718.00	2,233,400
ユー・エス・エス	107,400	2,209.00	237,246,600
東京個別指導学院	3,300	1,310.00	4,323,000
サイバーエージェント	57,800	4,525.00	261,545,000
楽天	450,900	924.60	416,902,140
クリーク・アンド・リバー社	4,700	979.00	4,601,300
テー・オー・ダブリュー	7,900	921.00	7,275,900
セントラルスポーツ	3,300	3,950.00	13,035,000
フルキャストホールディングス	7,700	2,547.00	19,611,900
リソルホールディングス	1,000	4,395.00	4,395,000
テクノプロ・ホールディングス	15,700	6,230.00	97,811,000
アトラ	1,700	813.00	1,382,100
インターワークス	2,100	1,134.00	2,381,400
Keeper 技研	3,000	1,383.00	4,149,000
ファーストロジック	1,400	932.00	1,304,800
三機サービス	1,100	2,183.00	2,401,300
Gunosy	4,000	2,599.00	10,396,000
デザインワン・ジャパン	1,900	1,222.00	2,321,800
イー・ガーディアン	4,500	3,225.00	14,512,500
リブセンス	6,000	552.00	3,312,000
ジャパンマテリアル	8,000	4,255.00	34,040,000
ベクトル	10,600	2,097.00	22,228,200
ウチヤマホールディングス	4,600	669.00	3,077,400
ライクキッズネクスト	1,000	2,019.00	2,019,000
キャリアリンク	3,100	571.00	1,770,100
I B J	6,700	1,141.00	7,644,700
アサンテ	3,300	1,890.00	6,237,000
N・フィールド	5,100	2,104.00	10,730,400
バリューHR	2,000	2,237.00	4,474,000

M & Aキャピタルパートナーズ	1,800	8,010.00	14,418,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,042.00	3,959,600
E R Iホールディングス	2,600	962.00	2,501,200
アビスト	1,300	4,905.00	6,376,500
シグマクシス	3,700	1,586.00	5,868,200
ウィルグループ	3,900	1,640.00	6,396,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,400	498.00	6,175,200
日本ビューホテル	2,100	1,507.00	3,164,700
リクルートホールディングス	678,400	2,660.00	1,804,544,000
エラン	2,300	1,553.00	3,571,900
土木管理総合試験所	2,800	612.00	1,713,600
日本郵政	499,000	1,299.00	648,201,000
ベルシステム24ホールディングス	14,800	1,496.00	22,140,800
鎌倉新書	1,200	2,268.00	2,721,600
一蔵	1,200	1,067.00	1,280,400
L I T A L I C O	1,600	1,724.00	2,758,400
グローバルグループ	1,000	1,494.00	1,494,000
エボラブルアジア	1,900	2,137.00	4,060,300
ストライク	800	6,120.00	4,896,000
ソラスト	5,300	2,753.00	14,590,900
セラク	1,600	754.00	1,206,400
インソース	1,100	3,280.00	3,608,000
キャリアインデックス	1,000	2,090.00	2,090,000
M S - J a p a n	700	6,320.00	4,424,000
船場	1,400	1,337.00	1,871,800
リログループ	48,100	2,993.00	143,963,300
東祥	5,500	3,875.00	21,312,500
エイチ・アイ・エス	13,700	4,010.00	54,937,000
ラックランド	1,800	2,124.00	3,823,200
共立メンテナンス	15,700	4,605.00	72,298,500
イチネンホールディングス	9,900	1,545.00	15,295,500
建設技術研究所	6,300	1,322.00	8,328,600
スペース	5,800	1,385.00	8,033,000
長大	2,800	811.00	2,270,800
燦ホールディングス	2,100	2,645.00	5,554,500
スバル興業	600	6,860.00	4,116,000
東京テアトル	3,800	1,467.00	5,574,600
タナベ経営	1,800	1,842.00	3,315,600
ナガワ	1,800	4,295.00	7,731,000
よみうりランド	1,900	4,740.00	9,006,000
東京都競馬	6,600	3,745.00	24,717,000
カナモト	13,400	3,390.00	45,426,000

東京ドーム	35,700	991.00	35,378,700	
西尾レントオール	7,800	3,330.00	25,974,000	
トランス・コスモス	9,800	2,921.00	28,625,800	
乃村工藝社	20,600	2,171.00	44,722,600	
藤田観光	3,500	3,230.00	11,305,000	
KNT-CTホールディングス	5,500	1,797.00	9,883,500	
日本管財	9,500	2,123.00	20,168,500	
トーカイ	8,500	2,695.00	22,907,500	
白洋舎	1,000	3,360.00	3,360,000	
セコム	93,300	7,889.00	736,043,700	
セントラル警備保障	4,300	2,517.00	10,823,100	
丹青社	18,100	1,057.00	19,131,700	
メイテック	10,300	6,140.00	63,242,000	
応用地質	10,100	1,452.00	14,665,200	
船井総研ホールディングス	18,300	2,152.00	39,381,600	
進学会ホールディングス	4,300	598.00	2,571,400	
オオバ	7,100	686.00	4,870,600	
いであ	1,900	1,118.00	2,124,200	
学究社	2,500	1,637.00	4,092,500	
ベネッセホールディングス	32,200	3,975.00	127,995,000	
イオンディライト	10,900	3,820.00	41,638,000	
ナック	6,100	952.00	5,807,200	
ニチイ学館	16,800	1,220.00	20,496,000	
ダイセキ	14,800	3,100.00	45,880,000	
ステップ	3,300	1,813.00	5,982,900	
合計	110,662,300		231,766,780,190	

(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
新株予約権証券	株式会社フージャースホールディングス第2回新株予約権	11,900	3,308,200	
	合計	11,900	3,308,200	

(注) 券面総額欄の数値は、証券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

注記事項(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

	平成30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	1,086,079,415
国債証券	256,738,266,940
地方債証券	17,643,055,893
特殊債券	22,048,816,417
社債券	13,238,755,000
派生商品評価勘定	1,129,028
未収入金	697,316,000
未収利息	896,012,660
前払費用	8,196,654
差入委託証拠金	180,000
流動資産合計	312,357,808,007
資産合計	312,357,808,007
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	972
前受金	1,130,000
未払解約金	224,150,047
未払利息	2,163
流動負債合計	225,283,182
負債合計	225,283,182
純資産の部	
元本等	
元本	230,447,888,966
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	81,684,635,859
元本等合計	312,132,524,825
純資産合計	312,132,524,825
負債純資産合計	312,357,808,007

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引</p>

平成30年 2月21日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 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	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)

平成30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	230,447,888,966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 103,737,000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 1.3545円 (1万口当たり純資産額) (13,545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

平成30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。

	平成30年 2月21日現在
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コンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成30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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成30年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 2月22日
期首元本額	236,110,846,189円
期中追加設定元本額	19,630,950,988円
期中一部解約元本額	25,293,908,211円
期末元本額	230,447,888,966円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	954,524,510円
D C日本債券インデックスファンド	2,904,457,620円
D C日本債券インデックスファンドL	34,528,666,294円
D Cバランスファンド3 0	7,277,011,636円
D Cバランスファンド5 0	5,028,569,757円
D Cバランスファンド7 0	1,229,112,306円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	230,965,084円
日本債券インデックスe	1,520,288,692円
インデックスコレクション（国内債券）	15,343,964,294円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	19,118,803,255円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	2,298,343,553円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	869,506,051円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	45,235,926,594円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	3,017,513,161円
バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	695,989,298円
バランスVA5 0（適格機関投資家専用）	2,754,683,457円
VAバランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	239,919,493円
VAバランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	414,929,221円
VAバランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	1,913,824,726円
バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	5,469,999,962円
バランスVA3 7 . 5（適格機関投資家専用）	1,408,867,094円
バランスVA5 0 L（適格機関投資家専用）	15,979,288,803円
バランスVA7 5（適格機関投資家専用）	162,745,188円
VAバランスファンド（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	2,922,225,973円
VAポートフォリオ4 0（適格機関投資家専用）	3,918,352,655円
VAポートフォリオ2 0（適格機関投資家専用）	289,134,782円
バランスVA4 0（適格機関投資家専用）	902,515,396円
VAバランス株式4 0（適格機関投資家専用）	86,469,663円

区分	平成30年 2月21日現在
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,893,771,999円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	495,696,363円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	1,104,837,749円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	222,713,305円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,470,793,985円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	4,773,558,367円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	286,711,236円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	2,137,978,629円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	35,619,234,687円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	643,143,491円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	225,451,761円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	46,620,939円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	801,511,277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）	7,535,462円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,731,198円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成30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	521,701,970
地方債証券	10,055,785
特殊債券	12,450,691
社債券	12,369,000
合計	556,577,446

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成30年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	903,551,944	-	904,680,000	1,128,056
合計		903,551,944	-	904,680,000	1,128,056

(注)1.時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第374回利付国債(2年)	180,000,000	180,484,200	
	第375回利付国債(2年)	1,130,000,000	1,133,288,300	
	第376回利付国債(2年)	590,000,000	591,840,800	
	第377回利付国債(2年)	810,000,000	812,697,300	
	第378回利付国債(2年)	1,660,000,000	1,665,876,400	
	第379回利付国債(2年)	1,955,000,000	1,962,350,800	
	第380回利付国債(2年)	760,000,000	763,024,800	
	第381回利付国債(2年)	1,100,000,000	1,104,609,000	
	第382回利付国債(2年)	1,290,000,000	1,295,688,900	
	第384回利付国債(2年)	545,000,000	547,637,800	
	第385回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,005,050,000	
	第117回利付国債(5年)	2,830,000,000	2,840,584,200	
	第118回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,556,959,500	
	第119回利付国債(5年)	660,000,000	662,092,200	
	第120回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,598,506,500	
	第121回利付国債(5年)	650,000,000	652,457,000	
	第122回利付国債(5年)	2,770,000,000	2,781,634,000	
	第123回利付国債(5年)	2,320,000,000	2,331,066,400	
	第124回利付国債(5年)	2,630,000,000	2,643,754,900	
	第125回利付国債(5年)	2,200,000,000	2,212,474,000	
	第126回利付国債(5年)	2,870,000,000	2,887,851,400	
	第127回利付国債(5年)	3,820,000,000	3,845,861,400	
	第128回利付国債(5年)	2,490,000,000	2,508,251,700	
	第129回利付国債(5年)	2,870,000,000	2,892,127,700	
	第130回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,895,134,000	
	第131回利付国債(5年)	1,910,000,000	1,926,387,800	
	第132回利付国債(5年)	1,325,000,000	1,337,070,750	
	第133回利付国債(5年)	2,330,000,000	2,351,925,300	
	第134回利付国債(5年)	1,780,000,000	1,797,675,400	

第1回利付国債（40年）	230,000,000	329,580,800	
第2回利付国債（40年）	350,000,000	485,208,500	
第3回利付国債（40年）	410,000,000	571,064,400	
第4回利付国債（40年）	595,000,000	832,422,850	
第5回利付国債（40年）	630,000,000	847,135,800	
第6回利付国債（40年）	670,000,000	882,704,900	
第7回利付国債（40年）	570,000,000	716,604,000	
第8回利付国債（40年）	920,000,000	1,071,689,600	
第9回利付国債（40年）	830,000,000	697,490,500	
第10回利付国債（40年）	870,000,000	867,485,700	
第299回利付国債（10年）	1,140,000,000	1,157,681,400	
第300回利付国債（10年）	550,000,000	559,707,500	
第301回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,532,535,000	
第302回利付国債（10年）	870,000,000	887,782,800	
第303回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,679,802,800	
第304回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,288,589,400	
第305回利付国債（10年）	2,040,000,000	2,093,448,000	
第306回利付国債（10年）	1,370,000,000	1,413,470,100	
第307回利付国債（10年）	880,000,000	906,092,000	
第308回利付国債（10年）	970,000,000	1,002,281,600	
第309回利付国債（10年）	960,000,000	987,475,200	
第310回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,440,642,000	
第311回利付国債（10年）	670,000,000	685,992,900	
第312回利付国債（10年）	2,037,000,000	2,113,122,690	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	910,000,000	949,939,900	
第314回利付国債（10年）	250,000,000	259,432,500	
第315回利付国債（10年）	1,020,000,000	1,065,063,600	
第316回利付国債（10年）	360,000,000	374,702,400	
第317回利付国債（10年）	280,000,000	292,255,600	
第318回利付国債（10年）	1,050,000,000	1,092,189,000	
第319回利付国債（10年）	560,000,000	586,230,400	
第320回利付国債（10年）	1,270,000,000	1,324,610,000	
第321回利付国債（10年）	1,340,000,000	1,401,063,800	
第322回利付国債（10年）	990,000,000	1,031,065,200	
第323回利付国債（10年）	690,000,000	720,249,600	
第324回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,039,500,000	
第325回利付国債（10年）	2,205,000,000	2,296,154,700	
第326回利付国債（10年）	560,000,000	581,845,600	
第327回利付国債（10年）	1,180,000,000	1,231,754,800	
第328回利付国債（10年）	1,680,000,000	1,739,908,800	
第329回利付国債（10年）	2,245,000,000	2,351,817,100	
第330回利付国債（10年）	1,820,000,000	1,909,635,000	

第331回利付国債(10年)	970,000,000	1,006,918,200	
第332回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,629,859,100	
第333回利付国債(10年)	2,660,000,000	2,767,756,600	
第334回利付国債(10年)	2,660,000,000	2,771,374,200	
第335回利付国債(10年)	2,625,000,000	2,721,101,250	
第336回利付国債(10年)	370,000,000	383,926,800	
第337回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,447,240,500	
第338回利付国債(10年)	2,170,000,000	2,238,463,500	
第339回利付国債(10年)	2,645,000,000	2,729,428,400	
第340回利付国債(10年)	2,570,000,000	2,652,856,800	
第341回利付国債(10年)	2,120,000,000	2,172,279,200	
第342回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,946,347,100	
第343回利付国債(10年)	2,605,000,000	2,625,579,500	
第344回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,175,703,200	
第345回利付国債(10年)	2,680,000,000	2,697,688,000	
第346回利付国債(10年)	2,685,000,000	2,700,760,950	
第347回利付国債(10年)	3,065,000,000	3,082,072,050	
第348回利付国債(10年)	2,930,000,000	2,945,353,200	
第349回利付国債(10年)	1,695,000,000	1,703,271,600	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	65,332,000	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	126,728,000	
第3回利付国債(30年)	140,000,000	176,271,200	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	254,679,800	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	226,564,200	
第6回利付国債(30年)	270,000,000	348,729,300	
第7回利付国債(30年)	190,000,000	244,043,600	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	208,837,800	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	189,879,800	
第11回利付国債(30年)	280,000,000	337,663,200	
第12回利付国債(30年)	370,000,000	469,082,300	
第13回利付国債(30年)	350,000,000	438,879,000	
第14回利付国債(30年)	350,000,000	461,254,500	
第15回利付国債(30年)	500,000,000	668,025,000	
第16回利付国債(30年)	250,000,000	334,980,000	
第17回利付国債(30年)	420,000,000	556,340,400	
第18回利付国債(30年)	540,000,000	706,752,000	
第19回利付国債(30年)	300,000,000	393,603,000	
第20回利付国債(30年)	290,000,000	390,949,000	
第21回利付国債(30年)	360,000,000	473,392,800	
第22回利付国債(30年)	380,000,000	513,600,400	
第23回利付国債(30年)	370,000,000	500,495,300	
第24回利付国債(30年)	335,000,000	453,874,750	

第25回利付国債(30年)	335,000,000	442,538,350
第26回利付国債(30年)	610,000,000	816,741,200
第27回利付国債(30年)	490,000,000	667,090,900
第28回利付国債(30年)	900,000,000	1,228,284,000
第29回利付国債(30年)	620,000,000	837,396,800
第30回利付国債(30年)	645,000,000	862,184,400
第31回利付国債(30年)	600,000,000	791,676,000
第32回利付国債(30年)	695,000,000	934,351,050
第33回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,350,289,500
第34回利付国債(30年)	930,000,000	1,239,048,300
第35回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,356,379,500
第36回利付国債(30年)	970,000,000	1,256,926,000
第37回利付国債(30年)	1,385,000,000	1,766,789,100
第38回利付国債(30年)	825,000,000	1,035,086,250
第39回利付国債(30年)	520,000,000	664,934,400
第40回利付国債(30年)	515,000,000	646,994,500
第41回利付国債(30年)	655,000,000	807,955,600
第42回利付国債(30年)	705,000,000	870,005,250
第43回利付国債(30年)	705,000,000	870,393,000
第44回利付国債(30年)	760,000,000	938,683,600
第45回利付国債(30年)	600,000,000	712,410,000
第46回利付国債(30年)	910,000,000	1,080,579,500
第47回利付国債(30年)	920,000,000	1,116,291,200
第48回利付国債(30年)	760,000,000	884,997,200
第49回利付国債(30年)	840,000,000	978,062,400
第50回利付国債(30年)	895,000,000	906,420,200
第51回利付国債(30年)	895,000,000	791,672,250
第52回利付国債(30年)	950,000,000	887,841,500
第53回利付国債(30年)	450,000,000	431,446,500
第54回利付国債(30年)	775,000,000	782,378,000
第55回利付国債(30年)	810,000,000	816,787,800
第56回利付国債(30年)	690,000,000	694,981,800
第57回利付国債(30年)	645,000,000	648,902,250
第41回利付国債(20年)	520,000,000	529,178,000
第42回利付国債(20年)	380,000,000	391,183,400
第43回利付国債(20年)	340,000,000	356,289,400
第44回利付国債(20年)	370,000,000	390,139,100
第45回利付国債(20年)	270,000,000	284,137,200
第46回利付国債(20年)	290,000,000	305,764,400
第47回利付国債(20年)	470,000,000	498,167,100
第48回利付国債(20年)	230,000,000	247,077,500
第49回利付国債(20年)	280,000,000	299,222,000
第50回利付国債(20年)	590,000,000	626,863,200

第5 1 回利付国債（20年）	240,000,000	256,975,200	
第5 2 回利付国債（20年）	430,000,000	464,107,600	
第5 3 回利付国債（20年）	350,000,000	379,687,000	
第5 4 回利付国債（20年）	280,000,000	304,822,000	
第5 5 回利付国債（20年）	490,000,000	532,389,900	
第5 6 回利付国債（20年）	410,000,000	447,457,600	
第5 7 回利付国債（20年）	360,000,000	391,327,200	
第5 8 回利付国債（20年）	250,000,000	273,030,000	
第5 9 回利付国債（20年）	440,000,000	478,486,800	
第6 0 回利付国債（20年）	570,000,000	611,570,100	
第6 1 回利付国債（20年）	390,000,000	411,851,700	
第6 2 回利付国債（20年）	250,000,000	261,895,000	
第6 3 回利付国債（20年）	570,000,000	627,592,800	
第6 4 回利付国債（20年）	410,000,000	455,567,400	
第6 5 回利付国債（20年）	370,000,000	412,727,600	
第6 6 回利付国債（20年）	330,000,000	366,177,900	
第6 7 回利付国債（20年）	310,000,000	347,110,100	
第6 8 回利付国債（20年）	230,000,000	261,737,700	
第6 9 回利付国債（20年）	530,000,000	599,907,000	
第7 0 回利付国債（20年）	490,000,000	566,297,900	
第7 1 回利付国債（20年）	400,000,000	457,208,000	
第7 2 回利付国債（20年）	710,000,000	810,656,700	
第7 3 回利付国債（20年）	540,000,000	615,562,200	
第7 4 回利付国債（20年）	310,000,000	355,501,800	
第7 5 回利付国債（20年）	360,000,000	414,608,400	
第7 6 回利付国債（20年）	340,000,000	386,753,400	
第7 7 回利付国債（20年）	290,000,000	331,934,000	
第7 8 回利付国債（20年）	20,000,000	22,823,400	
第7 9 回利付国債（20年）	100,000,000	114,851,000	
第8 0 回利付国債（20年）	250,000,000	288,960,000	
第8 1 回利付国債（20年）	180,000,000	207,496,800	
第8 2 回利付国債（20年）	485,000,000	562,978,300	
第8 3 回利付国債（20年）	270,000,000	314,595,900	
第8 4 回利付国債（20年）	190,000,000	219,894,600	
第8 5 回利付国債（20年）	360,000,000	421,167,600	
第8 6 回利付国債（20年）	240,000,000	284,652,000	
第8 7 回利付国債（20年）	170,000,000	200,256,600	
第8 8 回利付国債（20年）	340,000,000	404,895,800	
第8 9 回利付国債（20年）	320,000,000	378,419,200	
第9 0 回利付国債（20年）	620,000,000	735,983,400	
第9 1 回利付国債（20年）	510,000,000	609,771,300	
第9 2 回利付国債（20年）	790,000,000	934,293,500	

第93回利付国債(20年)	260,000,000	306,321,600	
第94回利付国債(20年)	545,000,000	647,024,000	
第95回利付国債(20年)	400,000,000	484,168,000	
第96回利付国債(20年)	300,000,000	357,552,000	
第97回利付国債(20年)	510,000,000	615,044,700	
第98回利付国債(20年)	370,000,000	442,682,800	
第99回利付国債(20年)	660,000,000	792,237,600	
第100回利付国債(20年)	860,000,000	1,043,661,600	
第101回利付国債(20年)	360,000,000	444,085,200	
第102回利付国債(20年)	370,000,000	458,097,000	
第103回利付国債(20年)	335,000,000	411,333,100	
第104回利付国債(20年)	260,000,000	313,918,800	
第105回利付国債(20年)	500,000,000	605,570,000	
第106回利付国債(20年)	270,000,000	329,834,700	
第107回利付国債(20年)	270,000,000	327,987,900	
第108回利付国債(20年)	725,000,000	865,171,500	
第109回利付国債(20年)	290,000,000	346,953,100	
第110回利付国債(20年)	465,000,000	566,495,550	
第111回利付国債(20年)	470,000,000	579,510,000	
第112回利付国債(20年)	550,000,000	672,001,000	
第113回利付国債(20年)	805,000,000	986,358,450	
第114回利付国債(20年)	700,000,000	860,055,000	
第115回利付国債(20年)	270,000,000	334,875,600	
第116回利付国債(20年)	400,000,000	497,496,000	
第117回利付国債(20年)	580,000,000	714,490,400	
第118回利付国債(20年)	500,000,000	611,155,000	
第119回利付国債(20年)	390,000,000	467,278,500	
第120回利付国債(20年)	420,000,000	493,071,600	
第121回利付国債(20年)	750,000,000	909,712,500	
第122回利付国債(20年)	450,000,000	540,288,000	
第123回利付国債(20年)	720,000,000	893,246,400	
第124回利付国債(20年)	370,000,000	454,393,300	
第125回利付国債(20年)	350,000,000	439,708,500	
第126回利付国債(20年)	430,000,000	529,244,000	
第127回利付国債(20年)	400,000,000	487,220,000	
第128回利付国債(20年)	690,000,000	842,193,300	
第129回利付国債(20年)	350,000,000	422,656,500	
第130回利付国債(20年)	780,000,000	943,659,600	
第131回利付国債(20年)	360,000,000	430,783,200	
第132回利付国債(20年)	600,000,000	718,632,000	
第133回利付国債(20年)	640,000,000	775,116,800	
第134回利付国債(20年)	260,000,000	315,411,200	
第135回利付国債(20年)	495,000,000	593,752,500	

	第136回利付国債（20年）	450,000,000	533,286,000	
	第137回利付国債（20年）	520,000,000	624,244,400	
	第138回利付国債（20年）	510,000,000	598,133,100	
	第139回利付国債（20年）	330,000,000	391,591,200	
	第140回利付国債（20年）	1,225,000,000	1,472,670,500	
	第141回利付国債（20年）	940,000,000	1,131,562,600	
	第142回利付国債（20年）	350,000,000	426,314,000	
	第143回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,451,787,800	
	第145回利付国債（20年）	1,160,000,000	1,398,890,400	
	第146回利付国債（20年）	1,150,000,000	1,387,463,500	
	第147回利付国債（20年）	1,010,000,000	1,204,687,600	
	第148回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,623,887,400	
	第149回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,342,395,600	
	第150回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,649,670,800	
	第151回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,399,650,000	
	第152回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,331,889,600	
	第153回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,522,650,500	
	第154回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,601,248,800	
	第155回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,540,481,400	
	第156回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,254,137,700	
	第157回利付国債（20年）	1,560,000,000	1,482,686,400	
	第158回利付国債（20年）	1,010,000,000	1,010,858,500	
	第159回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,433,011,200	
	第160回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,558,501,200	
	第161回利付国債（20年）	915,000,000	925,412,700	
	第162回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,342,927,600	
	第163回利付国債（20年）	635,000,000	639,527,550	
	国債証券合計	236,137,000,000	256,738,266,940	
地方債証券	第1回東京都公募公債（東京グリーンbond（30年））	100,000,000	102,510,000	
	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,312,000	
	第7回東京都公募公債（30年）	200,000,000	265,834,000	
	第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	236,408,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,336,000	
	第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	241,938,000	
	第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,159,000	
	第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	121,589,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	103,864,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	103,689,000	
	第714回東京都公募公債	100,000,000	103,449,000	
	第722回東京都公募公債	200,000,000	208,076,000	
	第740回東京都公募公債	100,000,000	102,600,000	

第751回東京都公募公債	100,000,000	101,977,000	
平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,157,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	102,503,000	
平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	103,968,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	300,000,000	301,524,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	121,443,000	
第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	117,863,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	102,429,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	102,960,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	102,658,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	102,472,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	103,300,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	103,672,000	
第196回神奈川県公募公債	100,000,000	103,230,000	
第334回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,787,000	
第335回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,921,000	
第339回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,160,000	
第356回大阪府公募公債（10年）	130,000,000	135,144,100	
第363回大阪府公募公債（10年）	114,000,000	117,727,800	
第371回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	205,418,000	
第376回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,178,000	
第403回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	307,371,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	102,425,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,254,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	105,556,181	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	110,172,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	102,744,000	
平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	103,582,000	
平成25年度第14回兵庫県公募公債	100,000,000	103,841,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	103,389,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	103,050,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	104,285,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	103,788,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,233,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,756,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,827,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,041,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,900,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	121,296,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,868,000	

平成23年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,710,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,993,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,424,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,758,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	121,482,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	282,308,800	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	103,576,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	167,739,660	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,781,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,789,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,722,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,577,000	
平成27年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	204,230,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	134,653,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	200,000,000	257,080,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	102,253,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	112,781,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	121,430,000	
第8回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	121,764,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	102,768,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,678,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,378,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	102,606,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,386,000	
平成21年度第2回新潟県公募公債	133,900,000	137,489,859	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	199,504,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債(10年)	139,630,000	144,663,661	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,675,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,840,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,826,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,067,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,958,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,768,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,463,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,760,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,887,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,751,000	

第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,819,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,038,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,578,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,586,000	
第103回共同発行市場公募地方債	177,400,000	183,727,858	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,007,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,962,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,448,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,635,000	
第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,535,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,868,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,247,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,398,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,778,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,787,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,193,000	
第153回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,770,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	103,572,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,824,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	102,060,000	
平成21年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	102,049,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	102,783,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	111,143,000	
第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	100,623,000	
第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,032,000	
第488回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,355,000	
第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,713,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	115,009,000	
平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,860,000	
平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	200,938,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	115,049,000	
平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	102,466,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	103,777,000	
平成25年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	103,765,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,573,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,643,000	
平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,300,000	
平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,267,000	
第88回川崎市公募公債	100,000,000	102,547,000	
平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	157,893,974	
平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,551,000	

	平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	104,238,000	
	平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,551,000	
	平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	103,572,000	
	平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	103,576,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	102,760,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	104,035,000	
	地方債証券合計	16,686,690,000	17,643,055,893	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	209,430,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	226,398,900	
	第69回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	296,775,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,912,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,619,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	177,282,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	591,330,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,721,000	
	第21回道路債券	100,000,000	133,070,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	286,088,000	
	第27回道路債券	100,000,000	113,976,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,123,000	
	第33回道路債券	100,000,000	136,572,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,785,000	
	第38回道路債券	100,000,000	113,964,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,598,000	
	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	120,313,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,720,000	
	第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,604,000	
	第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,869,000	
	第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,945,000	
	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	119,459,000	
	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,136,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,566,000	

第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,080,000	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,532,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,272,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,176,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	244,518,000	
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,896,000	
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	131,042,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,765,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,138,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,208,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,026,000	
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	129,158,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,144,000	
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	120,313,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,000,000	174,391,100	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,377,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,248,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,913,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,807,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	129,881,250	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,741,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,192,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,958,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,833,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,614,000	
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	117,762,000	
	200,000,000	208,398,000	

第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	118,533,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	216,235,580	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,710,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,189,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,925,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,426,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	106,715,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	121,527,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,268,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	120,414,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,036,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,179,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	243,404,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,489,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	121,770,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,445,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,743,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,087,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,899,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	121,120,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,078,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,726,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,000,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	362,208,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,654,000	
第17回公営企業債券（20年）	200,000,000	235,480,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	118,879,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,584,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,062,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	351,207,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	120,239,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,855,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,589,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,554,000	

第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	225,627,920	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,218,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,462,000	
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,701,000	
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,932,840	
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	201,304,790	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	430,944,020	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,944,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	103,261,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	103,447,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	102,188,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	103,308,000	
第38回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	104,076,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	103,470,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,929,000	15,413,744	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,180,000	93,931,510	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,154,000	37,244,959	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,984,000	19,176,519	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,021,000	46,888,020	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,464,000	16,080,858	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,149,000	17,109,542	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,559,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,750,000	10,846,642	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	64,776,000	68,598,431	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,060,000	18,066,881	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,456,000	41,615,032	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,017,000	18,020,832	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,074,000	25,580,745	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,437,000	18,495,774	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,527,000	13,698,522	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,603,000	14,002,928	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,401,000	22,823,310	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	73,005,000	75,676,983	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,165,000	14,642,502	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,419,000	25,217,257	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,386,000	32,940,862	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,963,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,362,000	29,677,919	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,490,000	16,018,828	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,660,000	32,224,107	

第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,488,000	59,820,503	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,963,000	18,745,827	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,085,000	52,061,854	
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,757,000	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,626,000	18,292,967	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,892,000	59,151,181	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,571,000	21,547,093	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,175,000	40,768,609	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,857,000	41,343,459	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,725,000	18,530,246	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,657,000	42,074,887	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,441,000	19,299,059	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,430,000	55,817,252	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,680,000	88,972,429	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,762,000	43,089,917	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,283,000	20,375,574	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,733,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,467,000	18,524,452	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,277,000	54,984,425	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,814,000	53,839,973	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,610,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,993,000	161,203,146	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,484,000	183,676,486	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,620,000	18,707,506	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,057,000	42,568,173	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,304,000	42,680,323	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,321,000	54,289,919	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,873,000	46,494,850	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,564,000	19,649,808	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,591,000	51,236,779	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,517,000	54,345,798	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,407,000	58,342,462	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,890,000	55,740,242	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,005,000	63,449,470	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,535,000	65,698,020	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,141,000	58,791,978	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,739,000	56,833,314	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,363,000	59,604,172	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,449,000	65,747,556	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,578,000	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,207,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,897,000	

第102回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,956,000	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,085,000	90,769,830	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,632,000	185,234,747	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,050,000	92,823,588	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,709,000	94,640,809	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,927,000	94,614,690	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,290,000	95,418,641	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,759,000	96,427,397	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,211,000	96,706,486	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,675,000	97,326,589	
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,628,000	97,909,168	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,159,000	99,345,418	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,477,000	99,408,360	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,866,000	99,956,878	
い第770号商工債	100,000,000	100,142,000	
い第771号商工債	100,000,000	100,151,000	
い第773号商工債	200,000,000	200,334,000	
い第786号商工債	100,000,000	100,279,000	
い第787号商工債	100,000,000	100,283,000	
い第766号農林債	300,000,000	300,834,000	
い第769号農林債	100,000,000	100,342,000	
い第779号農林債	100,000,000	100,434,000	
第295回信金中金債（5年）	100,000,000	100,275,000	
第299回信金中金債（5年）	200,000,000	200,518,000	
第308回信金中金債（5年）	100,000,000	100,460,000	
第322回信金中金債（5年）	100,000,000	99,768,000	
第327回信金中金債（5年）	200,000,000	199,640,000	
第331回信金中金債（5年）	100,000,000	99,891,000	
第201号商工債（3年）	100,000,000	99,850,000	
第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,687,000	
第18回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	207,794,000	
第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,050,000	
第21回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,795,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,740,000	
第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,661,000	

特殊債券合計		20,410,983,000	22,048,816,417	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,937,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,552,000	
	第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,646,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,837,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,543,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,991,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,895,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,078,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA/B円貨社債	100,000,000	100,301,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,911,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・ア非上位円貨社債	100,000,000	100,224,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,375,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,258,000	
	第3回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社債	100,000,000	99,975,000	
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	103,173,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,784,000	
	第9回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,019,000	
	第2回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	100,241,000	
	第21回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	101,243,000	
	第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,059,000	
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,109,000	
	第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	103,096,000	
	第45回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,847,000	
	第1回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	99,696,000	
	第1回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,925,000	
	第2回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,762,000	
第5回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,776,000		
第1回J X T Gホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,108,000		
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,790,000		
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	104,230,000		

第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	103,522,000	
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,460,000	
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,847,000	
第9回株式会社LIXILグループ無担保社債	100,000,000	99,646,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,074,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,195,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	100,808,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,502,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,032,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,167,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	101,022,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,591,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,479,000	
第32回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第5回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,371,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,275,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,235,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,442,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス無担保社債	100,000,000	100,095,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,262,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,860,000	
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	114,692,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,166,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,103,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,578,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,042,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,848,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,140,000	
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	102,221,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,124,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,338,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,124,000	

第24回株式会社三井住友銀行無担保社債 (劣後特約付)	100,000,000	104,482,000	
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	114,233,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後 特約付)	100,000,000	104,649,000	
第1回NTTファイナンス株式会社無担保社 債	100,000,000	99,996,000	
第41回株式会社日産フィナンシャルサー ビス無担保社債	100,000,000	99,288,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保 社債	100,000,000	99,843,000	
第42回株式会社ホンダファイナンス無担保 社債	100,000,000	99,911,000	
第74回トヨタファイナンス株式会社無担保 社債	100,000,000	99,871,000	
第25回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,096,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,417,000	
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社 債	100,000,000	99,816,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社 債	100,000,000	99,859,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担 保社債	100,000,000	102,409,000	
第23回野村ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	103,905,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	117,571,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	118,860,000	
第104回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	103,479,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,165,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投 資法人債	100,000,000	103,991,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,477,000	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,735,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,823,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	105,145,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	118,198,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	122,080,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	103,491,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普 通社債	100,000,000	102,351,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,505,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	93,750,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,454,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社 債	100,000,000	121,730,000	

第 8 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	119,808,000	
第 1 0 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	121,846,000	
第 1 3 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	116,849,000	
第 4 6 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	103,185,000	
第 4 回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,432,000	
第 5 回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,800,000	
第 1 8 回 K D D I 株式会社無担保社債	100,000,000	102,468,000	
第 4 5 7 回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,430,000	
第 5 4 2 回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,265,000	
第 5 4 4 回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,641,000	
第 4 8 2 回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,859,000	
第 5 0 0 回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,821,000	
第 5 1 8 回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,001,000	
第 4 9 5 回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,171,000	
第 5 0 5 回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,837,000	
第 5 0 9 回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,210,000	
第 5 1 0 回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,346,000	
第 3 7 0 回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,548,000	
第 3 7 7 回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,816,000	
第 3 9 3 回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,025,000	
第 3 0 7 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,712,000	
第 4 7 9 回東北電力株式会社社債	200,000,000	201,798,000	
第 2 5 3 回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,194,000	
第 3 7 1 回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,914,000	
第 4 3 1 回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,252,000	
第 4 3 6 回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,897,000	
第 3 1 6 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,459,000	
第 1 3 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,360,000	
第 3 3 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,959,000	
第 3 8 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,124,000	
第 1 1 回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,854,000	
第 6 回 S C S K 株式会社無担保社債	100,000,000	99,997,000	
社債券合計	12,800,000,000	13,238,755,000	
合計		309,668,894,250	

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

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	平成30年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,006,100,645
コール・ローン	1,091,226,266
株式	216,896,847,282
投資信託受益証券	155,998,198
投資証券	4,804,095,980
派生商品評価勘定	56,133,090
未収入金	34,655
未収配当金	302,314,538
前払金	252,273,328
差入委託証拠金	1,961,770,423
流動資産合計	234,526,794,405
資産合計	234,526,794,405
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	317,865,896
未払金	10,591,521,111
未払解約金	98,757,278
未払利息	2,173
流動負債合計	11,008,146,458
負債合計	11,008,146,458
純資産の部	
元本等	
元本	87,229,261,605
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	136,289,386,342
元本等合計	223,518,647,947
純資産合計	223,518,647,947
負債純資産合計	234,526,794,405

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	平成30年 2月21日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成30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		87,229,261,605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)	2.5624円 (25,624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

	平成30年 2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成30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

	平成30年 2月21日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成30年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 2月22日
期首元本額	101,927,363,083円
期中追加設定元本額	13,578,427,493円
期中一部解約元本額	28,276,528,971円
期末元本額	87,229,261,605円
期末元本額の内訳	

区分	平成30年 2月21日現在
外国株式インデックスファンド	1,967,944,734円
D C外国株式インデックスファンド	4,420,678,689円
D C外国株式インデックスファンドL	18,741,738,840円
D Cバランスファンド30	657,717,884円
D Cバランスファンド50	1,330,272,924円
D Cバランスファンド70	768,186,837円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	438,185,414円
外国株式インデックスe	6,054,375,803円
インデックスコレクション(外国株式)	4,726,808,318円
インデックスコレクション(バランス株式30)	1,768,627,657円
インデックスコレクション(バランス株式50)	605,173,631円
インデックスコレクション(バランス株式70)	543,939,166円
私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	20,960,989,473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)	1,400,322,065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)	1,120,768,564円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	157,962,427円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	1,455,393,280円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	102,061,400円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	538,726,233円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	10,752,193円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	3,213,817,736円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	758,700,466円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	444,753,771円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	8,596,971,895円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	828,457,748円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	1,723,976,926円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,289,114,429円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	35,678,660円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	317,555,802円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	42,865,647円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	183,520,167円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	545,434,402円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	30,230,936円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	856,230,532円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	20,617,532円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	156,281,648円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	395,613,219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)	18,814,557円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年 2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,601,527,080	
投資信託受益証券	4,291,677	
投資証券	14,374,133	
合計	2,591,444,624	

(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

(平成30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	11,495,732,845	-	11,243,459,517	252,273,328
	合計	11,495,732,845	-	11,243,459,517	252,273,328

(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。

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

(平成30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	11,007,972,648	-	10,998,513,170	9,459,478
	アメリカドル	7,329,414,850	-	7,321,332,540	8,082,310
	カナダドル	362,220,132	-	362,185,200	34,932
	ユーロ	1,473,827,910	-	1,472,661,000	1,166,910
	イギリスポンド	788,247,024	-	788,248,200	1,176
	スイスフラン	314,890,938	-	314,880,800	10,138
	スウェーデンクローナ	119,430,637	-	119,427,040	3,597
	ノルウェークローネ	33,613,265	-	33,589,500	23,765
	デンマーククローネ	81,963,921	-	81,961,620	2,301

オーストラリアドル	283,421,044	-	283,399,000	22,044
ニュージーランドドル	10,108,684	-	10,108,160	524
香港ドル	134,884,598	-	134,787,410	97,188
シンガポールドル	59,047,485	-	59,042,200	5,285
イスラエルシェケル	16,902,160	-	16,890,500	11,660
合計	11,007,972,648	-	10,998,513,170	9,459,478

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	31,810	59.25	1,884,742.50	
	ANDEAVOR	7,990	94.18	752,498.20	
	ANTERO RESOURCES CORP	12,192	18.56	226,283.52	
	APACHE CORP	20,175	38.30	772,702.50	
	BAKER HUGHES A GE CO	21,381	26.44	565,313.64	
	CABOT OIL & GAS CORP	24,594	23.92	588,288.48	
	CHENIERE ENERGY INC	10,538	58.03	611,520.14	
	CHEVRON CORP	105,538	110.98	11,712,607.24	
	CIMAREX ENERGY CO	5,025	98.37	494,309.25	
	CONCHO RESOURCES INC	8,513	147.15	1,252,687.95	
	CONOCOPHILLIPS	67,926	54.84	3,725,061.84	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,386	54.73	294,775.78	
	DEVON ENERGY CORPORATION	29,200	34.65	1,011,780.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,750	122.81	583,347.50	
	EOG RESOURCES INC	32,262	107.96	3,483,005.52	
	EQT CORPORATION	14,856	51.40	763,598.40	
	EXXON MOBIL	235,851	75.75	17,865,713.25	
	HALLIBURTON CO	48,932	47.16	2,307,633.12	
HELMERICH & PAYNE	6,339	64.51	408,928.89		
HESS CORP	15,109	45.84	692,596.56		

HOLLYFRONTIER CORP	10,575	45.98	486,238.50
KINDER MORGAN INC	113,702	17.00	1,932,934.00
MARATHON OIL CORP	44,903	15.85	711,712.55
MARATHON PETROLEUM CORP	28,684	66.25	1,900,315.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	20,041	35.38	709,050.58
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,321	25.73	342,749.33
NOBLE ENERGY INC	27,338	29.12	796,082.56
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	42,916	67.99	2,917,858.84
ONEOK INC	21,967	57.02	1,252,558.34
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	12,200	23.29	284,138.00
PHILLIPS 66	24,428	90.99	2,222,703.72
PIONEER NATURAL RESOURCES	9,720	178.25	1,732,590.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	10,331	21.96	226,868.76
RANGE RESOURCES CORP	11,219	13.08	146,744.52
SCHLUMBERGER	77,493	65.61	5,084,315.73
TARGA RESOURCES CORP	13,301	47.75	635,122.75
TECHNIPFMC PLC	23,499	29.38	690,400.62
VALERO ENERGY CORP	24,798	91.58	2,271,000.84
WILLIAMS COS	47,151	29.09	1,371,622.59
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,318	162.91	2,006,725.38
ALBEMARLE CORP	5,954	114.58	682,209.32
AVERY DENNISON CORP	5,286	117.08	618,884.88
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	30.99	336,055.56
BALL CORP	17,586	39.21	689,547.06
CELANESE CORP-SERIES A	7,497	102.38	767,542.86
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,239	41.82	511,834.98
CHEMOURS CO/THE	11,442	50.08	573,015.36
CROWN HOLDINGS INC	7,348	50.58	371,661.84
DOWDUPONT INC	130,103	71.62	9,317,976.86
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,768	100.29	779,052.72
ECOLAB INC	14,734	131.72	1,940,762.48
FMC CORP	8,186	83.55	683,940.30
FREEPORT-MCMORAN INC	79,109	18.43	1,457,978.87
INT'L PAPER CO	22,531	58.00	1,306,798.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,198	142.38	597,711.24
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,002	108.59	2,063,427.18
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,686	214.09	789,135.74
MONSANTO CO	24,647	120.31	2,965,280.57
MOSAIC CO/THE	17,569	26.76	470,146.44
NEWMONT MINING CORP	30,871	38.39	1,185,137.69
NUCOR CORP	18,456	67.56	1,246,887.36
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,966	118.86	590,258.76

PPG INDUSTRIES INC	14,635	115.40	1,688,879.00
PRAXAIR INC	16,096	153.60	2,472,345.60
SEALED AIR CORP	9,792	42.07	411,949.44
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,765	396.67	1,890,132.55
STEEL DYNAMICS INC	14,374	48.86	702,313.64
VULCAN MATERIALS CO	7,023	124.47	874,152.81
WESTROCK CO	14,893	65.11	969,683.23
WR GRACE & CO	3,649	67.26	245,431.74
3 M COMPANY	33,270	235.07	7,820,778.90
ACUITY BRANDS INC	2,326	148.81	346,132.06
AERCAP HOLDINGS NV	7,756	51.58	400,054.48
AGCO CORP	3,843	66.40	255,175.20
ALLEGION PLC	4,805	85.66	411,596.30
AMETEK INC	12,258	75.72	928,175.76
ARCONIC INC	20,136	24.86	500,580.96
BOEING CO	31,290	353.35	11,056,321.50
CATERPILLAR	32,959	155.56	5,127,102.04
CUMMINS INC	9,149	166.82	1,526,236.18
DEERE&CO	15,345	164.77	2,528,395.65
DOVER CORP	8,227	100.21	824,427.67
EATON CORP	25,118	81.71	2,052,391.78
EMERSON ELECTRIC CO	35,953	71.07	2,555,179.71
FASTENAL CO	15,334	54.24	831,716.16
FLOWSERVE CORP	8,571	43.70	374,552.70
FLUOR CORP	7,798	58.04	452,595.92
FORTIVE CORP	16,839	75.85	1,277,238.15
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8,144	63.83	519,831.52
GENERAL DYNAMICS CORP	14,252	221.83	3,161,521.16
GENERAL ELECTRIC CO	481,860	14.74	7,102,616.40
GRAINGER (WW) INC	2,999	263.61	790,566.39
HARRIS CORP	6,483	157.01	1,017,895.83
HD SUPPLY HOLDINGS INC	10,197	36.16	368,723.52
HONEYWELL INTL INC	40,226	154.34	6,208,480.84
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,490	266.11	662,613.90
IDEX CORP	4,460	136.83	610,261.80
ILLINOIS TOOL WORKS	17,383	161.34	2,804,573.22
INGERSOLL-RAND PLC	13,665	90.04	1,230,396.60
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,708	62.47	419,048.76
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	62.59	794,893.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	12,000	38.08	456,960.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	52,689	37.87	1,995,332.43
L3 TECHNOLOGIES INC	4,589	210.98	968,187.22

LENNOX INTERNATIONAL INC	1,937	203.16	393,520.92
LOCKHEED MARTIN CORP	14,450	358.69	5,183,070.50
MASCO CORP	18,777	42.52	798,398.04
MIDDLEBY CORP	3,030	133.72	405,171.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,256	350.36	3,242,932.16
OWENS CORNING	6,694	87.23	583,917.62
PACCAR INC	18,914	68.99	1,304,876.86
PARKER HANNIFIN CORP	7,165	181.61	1,301,235.65
PENTAIR PLC	9,130	70.59	644,486.70
RAYTHEON COMPANY	16,220	216.54	3,512,278.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,909	184.67	1,275,885.03
ROCKWELL COLLIN	8,761	135.26	1,185,012.86
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,803	276.74	1,605,922.22
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,985	53.50	480,697.50
SMITH (A.O.) CORP	9,112	65.44	596,289.28
SNAP-ON INC	2,943	160.94	473,646.42
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	7,247	90.66	657,013.02
STANLEY BLACK&DECKER	8,836	159.21	1,406,779.56
TEXTRON	14,314	60.06	859,698.84
TRANSDIGM GROUP INC	3,023	298.75	903,121.25
UNITED RENTALS INC	4,452	172.25	766,857.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	42,296	126.46	5,348,752.16
WABCO HOLDINGS INC	2,741	140.71	385,686.11
WABTEC CORP	4,324	80.00	345,920.00
XYLEM INC	9,461	74.73	707,020.53
CINTAS CORP	5,229	166.65	871,412.85
EQUIFAX INC	6,359	115.55	734,782.45
IHS MARKIT LTD	21,616	46.60	1,007,305.60
MANPOWER GROUP	4,170	121.76	507,739.20
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,961	33.11	627,798.71
REPUBLIC SERVICES INC	12,626	64.86	818,922.36
ROBERT HALF INTL INC	6,347	56.32	357,463.04
ROLLINS INC	4,760	49.95	237,762.00
STERICYCLE INC	4,468	75.22	336,082.96
TRANSUNION	9,544	58.23	555,747.12
VERISK ANALYTICS INC	8,428	97.04	817,853.12
WASTE CONNECTIONS INC	13,965	70.47	984,113.55
WASTE MANAGEMENT INC	24,839	84.87	2,108,085.93
AMERCO	376	354.50	133,292.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6,277	51.72	324,646.44
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,489	89.97	673,785.33
CSX CORP	48,730	54.59	2,660,170.70

DELTA AIR LINES INC	9,273	52.47	486,554.31
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,765	61.93	666,676.45
FEDEX CORP	14,243	240.98	3,432,278.14
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,727	118.20	558,731.40
KANSAS CITY SOUTHERN	5,677	107.35	609,425.95
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	47.76	334,320.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	3,900	64.37	251,043.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,181	140.03	2,265,825.43
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,844	135.23	519,824.12
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,809	57.73	450,813.57
UNION PACIFIC CORP	44,594	130.23	5,807,476.62
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	4,613	66.59	307,179.67
UNITED PARCEL SERVICE B	38,338	104.71	4,014,371.98
APTIV PLC	15,395	92.34	1,421,574.30
AUTOLIV INC	4,653	144.78	673,661.34
BORGWARNER INC	11,963	52.26	625,186.38
FORD MOTOR COMPANY	208,290	10.63	2,214,122.70
GENERAL MOTORS CO	73,545	40.77	2,998,429.65
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	13,776	29.48	406,116.48
HARLEY-DAVIDSON	9,347	46.64	435,944.08
LEAR CORP	3,716	189.70	704,925.20
TESLA INC	7,483	334.77	2,505,083.91
DR HORTON INC	18,752	45.16	846,840.32
GARMIN LTD	6,761	64.86	438,518.46
HANESBRANDS INC	19,888	19.93	396,367.84
HASBRO INC	5,941	97.77	580,851.57
LEGGETT & PLATT INC	7,015	44.37	311,255.55
LENNAR CORP-CL A	16,521	59.15	977,217.15
LULULEMON ATHLETICA INC	5,051	80.58	407,009.58
MATTEL INC	18,030	16.47	296,954.10
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	8,077	63.97	516,685.69
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,344	247.07	826,202.08
NEWELL BRANDS INC	28,256	27.39	773,931.84
NIKE B	73,190	67.49	4,939,593.10
NVR INC	207	3,194.63	661,288.41
POLARIS INDUSTRIES INC	2,942	115.43	339,595.06
PULTE GROUP INC	16,982	29.47	500,459.54
PVH CORP	4,007	146.68	587,746.76
RALPH LAUREN CORPORATION	3,528	105.39	371,815.92
TAPESTRY INC	14,838	49.41	733,145.58
TOLL BROTHERS INC	8,145	46.78	381,023.10
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,148	17.14	191,076.72

UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,227	15.41	173,008.07
VF CORP	19,053	73.57	1,401,729.21
WHIRLPOOL CORP	3,979	168.50	670,461.50
ARAMARK	14,734	41.42	610,282.28
BLOCK H & R INC	10,235	27.17	278,084.95
CARNIVAL CORPORATION	18,749	69.45	1,302,118.05
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,327	317.57	421,415.39
DARDEN RESTAURANTS INC	7,416	94.90	703,778.40
DOMINO'S PIZZA INC	2,536	221.49	561,698.64
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,476	84.31	883,231.56
LAS VEGAS SANDS CORP	22,582	75.04	1,694,553.28
MARRIOTT INTL A	17,757	140.44	2,493,793.08
MCDONALD'S CORP	45,172	157.16	7,099,231.52
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	15,711	28.13	441,950.43
MGM RESORTS INTERNATIONAL	24,294	34.71	843,244.74
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,674	58.95	570,282.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,765	131.56	1,284,683.40
STARBUCKS CORP	80,391	55.97	4,499,484.27
VAIL RESORTS INC	2,021	216.00	436,536.00
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	5,351	120.77	646,240.27
WYNN RESORTS LTD	4,295	164.92	708,331.40
YUM BRANDS INC	17,606	78.08	1,374,676.48
CBS CORP-CL B	18,735	56.25	1,053,843.75
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	10,777	358.77	3,866,464.29
COMCAST CORP-CL A	262,047	39.47	10,342,995.09
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,886	24.31	191,708.66
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,985	23.04	299,174.40
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,018	44.57	535,642.26
INTERPUBLIC GROUP OF COS	19,962	24.70	493,061.40
LIBERTY BROADBAND-C	5,651	91.12	514,919.12
LIBERTY GLOBAL PLC-A	10,471	32.34	338,632.14
LIBERTY GLOBAL PLC-C	32,662	31.46	1,027,546.52
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	12,570	35.18	442,212.60
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	8,852	41.58	368,066.16
LIBERTY SIRIUSXM-A	4,837	42.02	203,250.74
LIVE NATION ENTERTAINMENT	9,043	46.86	423,754.98
NEWS CORP-CLASS A	22,501	15.95	358,890.95
OMNICOM GROUP	12,506	78.36	979,970.16
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,724	88.16	416,467.84
SIRIUS XM HOLDINGS INC	83,565	6.11	510,582.15
THE WALT DISNEY CO	85,295	105.98	9,039,564.10
TIME WARNER INC	43,281	95.07	4,114,724.67

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	58,816	37.13	2,183,838.08
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	23,286	36.61	852,500.46
VIACOM INC-CLASS B	18,443	33.98	626,693.14
ADVANCE AUTO PARTS	3,895	105.35	410,338.25
AMAZON.COM	22,725	1,468.35	33,368,253.75
AUTONATION INC	4,199	51.98	218,264.02
AUTOZONE INC	1,514	713.23	1,079,830.22
BEST BUY COMPANY INC	14,835	71.92	1,066,933.20
CARMAX INC	10,070	63.31	637,531.70
DOLLAR GENERAL CORP	15,532	94.56	1,468,705.92
DOLLAR TREE INC	12,740	106.81	1,360,759.40
EXPEDIA INC	6,557	104.10	682,583.70
GAP	13,143	31.61	415,450.23
GENUINE PARTS CO	7,885	94.67	746,472.95
HOME DEPOT	65,647	186.71	12,256,951.37
KOHL'S CORP	9,438	64.37	607,524.06
L BRANDS INC	12,863	47.41	609,834.83
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	27,323	27.84	760,672.32
LKQ CORP	17,868	41.46	740,807.28
LOWES COMPANIES	46,666	95.65	4,463,602.90
MACY'S INC	17,317	25.65	444,181.05
NETFLIX INC	24,086	278.55	6,709,155.30
NORDSTROM INC	6,807	50.49	343,685.43
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,115	252.38	1,290,923.70
PRICELINE GROUP INC/THE	2,735	1,894.62	5,181,785.70
ROSS STORES INC	21,936	77.98	1,710,569.28
TARGET (DAYTON HUDSON)	28,999	72.86	2,112,867.14
TIFFANY & CO	6,588	100.70	663,411.60
TJX COMPANIES INC	35,725	76.37	2,728,318.25
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,923	67.22	465,364.06
TRIPADVISOR INC	5,778	42.65	246,431.70
ULTA BEAUTY INC	3,147	201.13	632,956.11
COSTCO WHOLESALE CORP	24,419	188.12	4,593,702.28
CVS HEALTH CORP	56,585	70.66	3,998,296.10
KROGER CO	48,244	27.49	1,326,227.56
SYSCO CORP	28,665	58.88	1,687,795.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	48,421	70.91	3,433,533.11
WALMART INC	83,155	94.11	7,825,717.05
ALTRIA GROUP INC	107,012	64.19	6,869,100.28
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,488	42.57	1,383,014.16
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,158	68.31	762,202.98
BUNGE LIMITED	7,376	76.07	561,092.32

CAMPBELL SOUP CO (US)	10,126	46.08	466,606.08
COCA-COLA CO	225,830	43.99	9,934,261.70
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,354	38.51	437,242.54
CONAGRA BRANDS INC	22,086	36.08	796,862.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,617	217.33	2,090,062.61
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,762	116.06	1,132,977.72
GENERAL MILLS INC	32,777	55.95	1,833,873.15
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,645	99.90	763,735.50
HORMEL FOODS CORP	14,782	33.80	499,631.60
INGREDION INC	3,629	129.25	469,048.25
JM SMUCKER CO	6,179	123.87	765,392.73
KELLOGG CO	14,044	69.68	978,585.92
KRAFT HEINZ CO/THE	34,291	68.69	2,355,448.79
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,935	104.60	725,401.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,015	79.75	798,696.25
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	84,151	43.76	3,682,447.76
MONSTER BEVERAGE CORP	21,386	64.60	1,381,535.60
PEPSICO INC	79,361	109.48	8,688,442.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	86,464	102.85	8,892,822.40
TYSON FOODS INC	15,608	76.13	1,188,237.04
CHURCH & DWIGHT CO INC	13,701	48.38	662,854.38
CLOROX COMPANY	6,840	128.78	880,855.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	46,796	70.03	3,277,123.88
COTY INC-CL A	25,578	21.19	541,997.82
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,616	139.35	1,758,039.60
KIMBERLY-CLARK CORP	19,839	114.45	2,270,573.55
PROCTER & GAMBLE CO	142,020	81.34	11,551,906.80
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,000	101.90	101,900.00
ABBOTT LABORATORIES	96,865	59.12	5,726,658.80
AETNA INC	18,554	178.03	3,303,168.62
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,386	255.45	1,120,403.70
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,757	99.94	875,174.58
ANTHEM INC	14,677	232.22	3,408,292.94
BAXTER INTERNATIONAL	27,853	67.04	1,867,265.12
BECTON DICKINSON & CO	14,795	219.82	3,252,236.90
BOSTON SCIENTIFIC CORP	77,460	26.83	2,078,251.80
CARDINAL HEALTH	18,400	68.84	1,266,656.00
CENTENE CORP	9,984	100.26	1,000,995.84
CERNER CORP	17,188	63.00	1,082,844.00
CIGNA CORP	14,142	192.60	2,723,749.20
DANAHER CORP	34,947	96.85	3,384,616.95
DAVITA INC	7,925	72.77	576,702.25

DENTSPLY SIRONA INC	12,246	58.15	712,104.90
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,988	134.32	1,610,228.16
ENVISION HEALTHCARE	6,373	37.39	238,286.47
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	32,507	76.05	2,472,157.35
HCA HEALTHCARE INC	16,571	101.00	1,673,671.00
HENRY SCHEIN INC	8,146	67.97	553,683.62
HOLOGIC INC	16,710	38.87	649,517.70
HUMANA INC	8,078	267.33	2,159,491.74
IDEXX LABORATORIES INC	5,094	183.16	933,017.04
INTUITIVE SURGICAL INC	6,291	421.76	2,653,292.16
LABORATORY CRP OF AMER	5,465	174.41	953,150.65
MCKESSON CORP	11,848	148.85	1,763,574.80
MEDTRONIC PLC	75,632	81.61	6,172,327.52
QUEST DIAGNOSTICS	7,350	102.26	751,611.00
RESMED INC	7,447	92.83	691,305.01
STRYKER CORP	18,879	158.74	2,996,852.46
TELEFLEX INC	2,665	269.07	717,071.55
THE COOPER COS INC	2,574	230.37	592,972.38
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,842	226.66	12,203,827.72
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,744	117.18	555,901.92
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,742	120.17	569,846.14
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,351	60.34	322,879.34
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,419	118.72	1,355,663.68
ABBVIE INC	88,802	117.98	10,476,859.96
AGILENT TECHNOLOGIES	17,329	71.08	1,231,745.32
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,808	118.85	1,522,230.80
ALKERMES PLC	8,974	64.75	581,066.50
ALLERGAN PLC	18,738	160.59	3,009,135.42
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,278	120.83	637,740.74
AMGEN	40,710	182.98	7,449,115.80
BIOGEN INC	11,821	287.45	3,397,946.45
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,134	83.85	849,735.90
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	91,295	67.35	6,148,718.25
CELGENE CORP	43,513	93.85	4,083,695.05
GILEAD SCIENCES INC	72,767	80.94	5,889,760.98
ILLUMINA INC	8,286	226.57	1,877,359.02
INCYTE CORP	10,238	85.51	875,451.38
IQVIA HOLDINGS INC	8,351	100.26	837,271.26
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,158	144.78	457,215.24
JOHNSON & JOHNSON	149,354	130.87	19,545,957.98
LILLY (ELI) & CO	55,395	77.55	4,295,882.25
MERCK & CO	151,851	54.98	8,348,767.98

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,471	624.22	918,227.62
MYLAN NV	24,169	41.34	999,146.46
PERRIGO CO PLC	7,708	87.04	670,904.32
PFIZER	331,213	36.01	11,926,980.13
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,502	323.04	1,454,326.08
SEATTLE GENETICS INC	6,901	54.16	373,758.16
TESARO INC	1,865	62.30	116,189.50
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	48,940	19.98	977,821.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,274	207.84	4,629,428.16
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,483	134.96	335,105.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,161	160.98	2,279,637.78
WATERS CORP	4,630	203.87	943,918.10
ZOETIS INC	27,561	80.35	2,214,526.35
BANK OF AMERICA CORP	557,893	31.93	17,813,523.49
BB&T CORP	45,456	54.60	2,481,897.60
CIT GROUP INC	7,240	53.84	389,801.60
CITIGROUP	150,778	76.46	11,528,485.88
CITIZENS FINANCIAL GROUP	26,986	46.09	1,243,784.74
COMERICA INC	10,048	97.20	976,665.60
EAST WEST BANCORP INC	8,210	66.38	544,979.80
FIFTH THIRD BANCORP	39,666	33.21	1,317,307.86
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,201	95.29	876,763.29
HUNTINGTON BANCSHARES INC	57,546	15.90	914,981.40
JPMORGAN CHASE & CO	195,233	114.71	22,395,177.43
KEY CORP	62,427	20.95	1,307,845.65
M & T BANK CORP	7,355	190.64	1,402,157.20
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,490	14.09	401,424.10
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,390	19.62	380,431.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,681	159.13	4,245,747.53
REGIONS FINL CORP	64,404	19.40	1,249,437.60
SIGNATURE BANK	2,827	151.08	427,103.16
SUNTRUST BANKS	27,198	71.52	1,945,200.96
SVB FINANCIAL GROUP	3,180	249.41	793,123.80
US BANCORP	93,288	54.91	5,122,444.08
WELLS FARGO & CO	262,606	59.95	15,743,229.70
ZIONS BANCORPORATION	12,093	54.97	664,752.21
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,891	187.30	541,484.30
ALLY FINANCIAL INC	26,496	28.70	760,435.20
AMERICAN EXPRESS	41,825	97.19	4,064,971.75
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,072	158.76	1,281,510.72
BANK NEW YORK CO	57,819	56.42	3,262,147.98
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,568	203.05	14,328,832.40

BLACKROCK INC	6,740	542.60	3,657,124.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,179	98.46	2,676,044.34
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,914	110.78	655,152.92
CME GROUP INC	19,049	163.35	3,111,654.15
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,294	79.63	1,695,641.22
E*TRADE FINANCIAL CORP	16,338	52.01	849,739.38
EATON VANCE CORP	6,907	55.84	385,686.88
FRANKLIN RESOURCES INC	17,434	38.86	677,485.24
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,485	264.89	5,426,271.65
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	33,024	72.86	2,406,128.64
INVESCO LTD	23,841	33.21	791,759.61
LEUCADIA NATIONAL CORP	17,074	25.10	428,557.40
MOODY'S CORP	9,859	168.13	1,657,593.67
MORGAN STANLEY	76,694	55.06	4,222,771.64
MSCI INC	5,300	144.38	765,214.00
NASDAQ INC	6,910	78.80	544,508.00
NORTHERN TRUST CORP	12,439	104.72	1,302,612.08
PRICE T ROWE GROUP INC	12,925	109.91	1,420,586.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,691	92.23	709,340.93
S&P GLOBAL INC	14,437	187.90	2,712,712.30
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,354	52.34	3,525,308.36
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,077	72.73	587,440.21
STATE STREET CORP	20,900	103.79	2,169,211.00
SYNCHRONY FINANCIAL	45,501	36.56	1,663,516.56
TD AMERITRADE HOLDING CORP	13,431	56.04	752,673.24
VOYA FINANCIAL INC	9,470	50.44	477,666.80
AFLAC	22,340	88.92	1,986,472.80
ALLEGHANY CORP	782	589.09	460,668.38
ALLSTATE CORP	20,475	93.65	1,917,483.75
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,742	111.81	418,393.02
AMERICAN INT'L GROUP	50,665	60.04	3,041,926.60
AON PLC	14,798	140.72	2,082,374.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,851	88.71	696,462.21
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,410	69.31	652,207.10
ASSURANT INC	3,380	88.58	299,400.40
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5,757	48.45	278,926.65
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,145	50.80	261,366.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,534	57.66	261,430.44
CHUBB LTD	25,945	145.44	3,773,440.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,280	75.69	626,713.20
EVEREST RE GROUP LTD	2,083	243.26	506,710.58
FNF GROUP	15,560	38.38	597,192.80

HARTFORD FINANCIAL SVCS	19,674	53.82	1,058,854.68
LINCOLN NATIONAL CORP	12,006	78.03	936,828.18
LOEWS CORP	15,181	49.89	757,380.09
MARKEL CORP	742	1,108.00	822,136.00
MARSH & MCLENNAN COS	28,758	83.51	2,401,580.58
METLIFE INC	50,700	46.89	2,377,323.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,287	62.70	958,494.90
PROGRESSIVE CORP	33,027	56.54	1,867,346.58
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,014	108.48	2,605,038.72
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,350	155.39	520,556.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,393	130.89	313,219.77
TORCHMARK CORP	5,657	86.38	488,651.66
TRAVELERS COS INC/THE	15,423	139.07	2,144,876.61
UNUM GROUP	12,274	52.34	642,421.16
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,908	159.65	1,102,862.20
WR BERKLEY CORP	5,098	68.73	350,385.54
XL GROUP LTD	14,226	43.00	611,718.00
CBRE GROUP INC-A	16,045	44.90	720,420.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	61,800	7.00	432,600.00
JONES LANG LASALLE INC	2,230	159.44	355,551.20
WEYERHAEUSER CO	40,479	34.94	1,414,336.26
ACCENTURE PLC-CL A	34,459	161.44	5,563,060.96
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,039	70.84	2,836,362.76
ADOBE SYSTEMS INC	27,482	202.98	5,578,296.36
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	9,160	66.77	611,613.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,578	244.57	630,501.46
ALPHABET INC-CL A	16,590	1,103.59	18,308,558.10
ALPHABET INC-CL C	17,419	1,102.46	19,203,750.74
ANSYS INC	4,986	167.81	836,700.66
AUTODESK INC	10,696	114.27	1,222,231.92
AUTOMATIC DATA PROCESS	24,923	115.41	2,876,363.43
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,994	98.59	590,948.46
CA INC	18,870	35.06	661,582.20
CADENCE DESIGN SYSTEMS	15,121	40.17	607,410.57
CDK GLOBAL INC	6,693	69.06	462,218.58
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,045	102.21	720,069.45
CITRIX SYSTEMS INC	8,265	91.78	758,561.70
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	33,194	81.54	2,706,638.76
COSTAR GROUP INC	1,956	351.84	688,199.04
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	11,892	69.82	830,299.44
DXC TECHNOLOGY CO	16,278	100.67	1,638,706.26
EBAY	57,207	43.39	2,482,211.73

ELECTRONIC ARTS INC	17,398	126.34	2,198,063.32
FACEBOOK INC-A	131,914	176.01	23,218,183.14
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	18,880	97.32	1,837,401.60
FIRST DATA CORP- CLASS A	28,193	15.82	446,013.26
FISERV INC	12,004	141.71	1,701,086.84
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,920	199.45	981,294.00
FORTINET INC	8,520	49.06	417,991.20
GARTNER INC	5,564	115.97	645,257.08
GLOBAL PAYMENTS INC	8,140	114.73	933,902.20
IAC/INTERACTIVECORP	4,525	149.83	677,980.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	49,391	155.16	7,663,507.56
INTUIT INC	13,662	173.57	2,371,313.34
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,919	121.01	474,238.19
LEIDOS HOLDINGS	8,457	66.23	560,107.11
MASTERCARD INC-CLASS A	52,571	175.35	9,218,324.85
MERCADOLIBRE INC	2,285	375.78	858,657.30
MICROSOFT CORP	407,162	92.72	37,752,060.64
ORACLE CORP	172,727	49.89	8,617,350.03
PAYCHEX INC	17,458	65.41	1,141,927.78
PAYPAL HOLDINGS INC	63,716	77.06	4,909,954.96
RED HAT INC	9,562	144.32	1,379,987.84
SABRE CORP	10,169	23.11	235,005.59
SALESFORCE.COM INC	38,012	114.35	4,346,672.20
SERVICENOW INC	9,765	156.76	1,530,761.40
SPLUNK INC	8,153	93.68	763,773.04
SQUARE INC - A	15,395	44.93	691,697.35
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,735	50.45	541,580.75
SYMANTEC CORP	35,613	27.02	962,263.26
SYNOPSYS INC	8,003	89.76	718,349.28
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,294	107.48	676,479.12
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	8,723	87.01	758,988.23
TWITTER INC	33,767	32.84	1,108,908.28
VERISIGN INC	4,957	116.34	576,697.38
VISA INC-CLASS A SHARES	101,873	122.01	12,429,524.73
VMWARE INC-CLASS A	4,340	123.60	536,424.00
WESTERN UNION CO	25,608	20.25	518,562.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,773	126.02	979,553.46
WORLDPAY INC-CLASS A	16,772	75.94	1,273,665.68
ZILLOW GROUP INC-C	6,531	47.42	309,700.02
AMPHENOL CORPORATION	17,336	90.36	1,566,480.96
APPLE INC	286,994	171.85	49,319,918.90
ARISTA NETWORKS INC	2,795	249.65	697,771.75

ARROW ELECTRONICS INC	4,954	81.95	405,980.30
AVNET INC	6,677	42.23	281,969.71
CDW CORP/DE	8,508	70.91	603,302.28
CISCO SYSTEMS	278,442	44.06	12,268,154.52
COGNEX CORP	10,630	56.44	599,957.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	9,775	38.78	379,074.50
CORNING	51,345	29.65	1,522,379.25
F5 NETWORKS INC	3,273	143.04	468,169.92
FLEX LTD	27,142	17.91	486,113.22
FLIR SYSTEMS INC	6,707	48.82	327,435.74
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	87,362	16.52	1,443,220.24
HP INC	95,110	21.39	2,034,402.90
IPG PHOTONICS CORP	2,326	239.09	556,123.34
JUNIPER NETWORKS INC	20,221	26.23	530,396.83
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,762	105.75	926,581.50
NETAPP INC	15,904	58.08	923,704.32
PALO ALTO NETWORKS INC	5,479	162.92	892,638.68
SEAGATE TECHNOLOGY	15,615	52.12	813,853.80
TE CONNECTIVITY LTD	19,966	102.51	2,046,714.66
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,193	38.96	513,999.28
WESTERN DIGITAL CORP	16,996	86.46	1,469,474.16
XEROX CORP	11,291	31.03	350,359.73
AT&T INC	341,905	36.77	12,571,846.85
CENTURYLINK INC	52,180	18.47	963,764.60
SPRINT CORP	39,898	5.45	217,444.10
T-MOBILE US INC	16,374	60.51	990,790.74
VERIZON COMMUNICATIONS	227,211	48.92	11,115,162.12
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,950	37.23	370,438.50
AES CORP	33,217	10.40	345,456.80
ALLIANT ENERGY CORPORATION	11,999	39.14	469,640.86
AMEREN CORPORATION	12,859	55.08	708,273.72
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,922	66.37	1,853,183.14
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,437	79.85	753,544.45
ATMOS ENERGY CORP	5,476	82.07	449,415.32
CENTERPOINT ENERGY INC	21,644	26.73	578,544.12
CMS ENERGY CORP	14,825	43.36	642,812.00
CONSOLIDATED EDISON INC	17,825	76.36	1,361,117.00
DOMINION ENERGY INC	36,096	74.75	2,698,176.00
DTE ENERGY COMPANY	9,536	103.20	984,115.20
DUKE ENERGY CORP	39,255	75.69	2,971,210.95
EDISON INTL	17,612	60.31	1,062,179.72
ENTERGY CORP	9,495	75.43	716,207.85

EVERSOURCE ENERGY	18,271	58.17	1,062,824.07	
EXELON CORP	54,237	37.68	2,043,650.16	
FIRSTENERGY CORP	26,542	32.80	870,577.60	
NEXTERA ENERGY INC	26,118	153.81	4,017,209.58	
NISOURCE INC	16,007	23.02	368,481.14	
OGE ENERGY CORP	11,648	31.21	363,534.08	
PG&E CORP	29,434	40.01	1,177,654.34	
PINNACLE WEST CAPITAL	5,873	77.20	453,395.60	
PPL CORPORATION	37,024	30.83	1,141,449.92	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	27,232	49.29	1,342,265.28	
SCANA CORP	6,890	36.94	254,516.60	
SEMPRA ENERGY	12,833	107.54	1,380,060.82	
SOUTHERN CO	56,238	43.47	2,444,665.86	
UGI CORP	8,757	43.22	378,477.54	
VISTRA ENERGY CORP	11,876	18.88	224,218.88	
WEC ENERGY GROUP INC	18,160	60.90	1,105,944.00	
WESTAR ENERGY INC	9,017	49.65	447,694.05	
XCEL ENERGY INC	27,390	44.12	1,208,446.80	
ADVANCED MICRO DEVICES	42,000	12.02	504,840.00	
ANALOG DEVICES	20,718	88.41	1,831,678.38	
APPLIED MATERIALS	59,670	56.66	3,380,902.20	
BROADCOM LTD	22,671	249.62	5,659,135.02	
INTEL CORP	261,696	46.32	12,121,758.72	
KLA-TENCOR CORP	8,294	110.55	916,901.70	
LAM RESEARCH CORP	9,282	193.44	1,795,510.08	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	24,854	23.20	576,612.80	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,006	62.12	932,172.72	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,396	84.86	1,136,784.56	
MICRON TECHNOLOGY	59,518	44.90	2,672,358.20	
NVIDIA CORP	33,415	249.08	8,323,008.20	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,549	125.56	2,454,572.44	
QORVO INC	6,735	80.17	539,944.95	
QUALCOMM	82,284	63.99	5,265,353.16	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,942	106.41	1,057,928.22	
TEXAS INSTRUMENTS	55,198	105.29	5,811,797.42	
XILINX INC	14,418	69.19	997,581.42	
アメリカドル 小計	17,040,075		1,328,306,620.92 (142,846,094,013)	
カナダドル				
ALTAGAS INCOME LTD	8,078	26.45	213,663.10	
ARC RESOURCES LTD	20,535	12.90	264,901.50	
CAMECO CORP	19,186	11.48	220,255.28	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	59,735	39.52	2,360,727.20	

CENOVUS ENERGY INC	52,049	9.40	489,260.60
CRESCENT POINT ENERGY CORP	26,742	9.09	243,084.78
ENBRIDGE	92,746	43.06	3,993,642.76
ENCANA CORP	56,719	13.75	779,886.25
HUSKY ENERGY INC	18,846	16.56	312,089.76
IMPERIAL OIL	15,145	34.26	518,867.70
INTER PIPELINE LTD	18,189	22.41	407,615.49
KEYERA CORP	11,025	33.61	370,550.25
PEMBINA PIPELINE CORP	29,200	41.28	1,205,376.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,703	29.04	281,775.12
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	15,297	15.69	240,009.93
SUNCOR ENERGY	93,488	43.84	4,098,513.92
TOURMALINE OIL CORP	12,981	19.30	250,533.30
TRANSCANADA CORP	47,400	56.89	2,696,586.00
VERMILION ENERGY INC	6,153	42.51	261,564.03
AGNICO EAGLE MINES	14,064	52.70	741,172.80
BARRICK GOLD CORP	61,196	16.22	992,599.12
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,850	57.31	449,883.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	40,925	20.59	842,645.75
FRANCO-NEVADA CORP	10,847	91.42	991,632.74
GOLDCORP INC	52,063	16.60	864,245.80
KINROSS GOLD CORP	60,197	4.79	288,343.63
LUNDIN MINING CORP	30,173	8.62	260,091.26
METHANEX CORP	4,891	72.46	354,401.86
NUTRIEN LTD	35,312	56.92	2,009,959.04
TECK RESOURCES LTD-CL B	33,009	36.64	1,209,449.76
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	3.58	173,783.94
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,615	86.80	400,582.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	22,516	24.43	550,065.88
BOMBARDIER B	104,404	3.92	409,263.68
CAE INC	14,339	23.26	333,525.14
FINNING INTERNATIONAL INC	11,028	33.59	370,430.52
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	53.17	466,566.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,312	95.33	4,033,602.96
CP RAILWAY LIMITED	8,056	230.17	1,854,249.52
LINAMAR CORP	2,700	70.06	189,162.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,255	68.66	1,390,708.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14,500	38.63	560,135.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,328	74.90	998,267.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,329	25.26	538,770.54
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,390	177.80	602,742.00
DOLLARAMA INC	5,699	157.00	894,743.00

ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	24,116	62.47	1,506,526.52
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	23.35	171,155.50
JEAN COUTU GROUP INC A	4,000	24.27	97,080.00
LOBLAW COMPANIES LTD	11,468	65.76	754,135.68
METRO INC	11,606	39.78	461,686.68
WESTON (GEORGE) LTD	2,481	104.81	260,033.61
SAPUTO INC	10,742	40.83	438,595.86
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	20,744	23.48	487,069.12
BANK MONTREAL	36,697	97.62	3,582,361.14
BANK NOVA SCOTIA	67,514	77.10	5,205,329.40
CANADIAN IMPERIAL BANK	24,823	114.85	2,850,921.55
NATIONAL BANK OF CANADA	19,768	61.69	1,219,487.92
ROYAL BANK OF CANADA	81,772	100.49	8,217,268.28
TORONTO-DOMINION BANK	103,491	72.49	7,502,062.59
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	45,887	50.80	2,331,059.60
CI FINANCIAL CORP	16,457	28.39	467,214.23
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	21,290	4.40	93,676.00
IGM FINANCIAL INC	3,890	39.12	152,176.80
ONEX CORP	4,702	90.27	424,449.54
THOMSON REUTERS CORP	14,949	50.28	751,635.72
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,602	645.43	1,033,978.86
GREAT-WEST LIFECO INC	14,947	33.61	502,368.67
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	7,229	57.07	412,559.03
INTACT FINANCIAL CORP	8,533	97.10	828,554.30
MANULIFE FINANCIAL CORP	107,526	24.68	2,653,741.68
POWER CORP OF CANADA	17,809	30.01	534,448.09
POWER FINANCIAL CORP	12,518	32.98	412,843.64
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,859	53.75	1,819,921.25
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	19.70	137,900.00
BLACKBERRY LIMITED	25,075	15.31	383,898.25
CGI GROUP INC - CL A	10,917	74.17	809,713.89
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,159	840.00	973,560.00
OPEN TEXT CORP	13,349	44.24	590,559.76
SHOPIFY INC - CLASS A	4,902	180.68	885,693.36
BCE INC	7,663	55.80	427,595.40
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,189	57.68	1,222,181.52
TELUS CORP	11,560	45.56	526,673.60
ATCO LTD -CLASS I	4,372	43.24	189,045.28
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	35.00	209,230.00
EMERA INC	1,710	41.43	70,845.30
FORTIS INC	24,474	41.71	1,020,810.54
HYDRO ONE LTD	14,740	20.89	307,918.60

	カナダドル 小計	2,201,371		94,907,893.42 (8,070,018,177)
ユーロ	ENAGAS	11,653	20.51	239,003.03
	ENI	143,570	13.70	1,968,057.56
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,347	14.67	445,342.22
	NESTE OIL OYJ	7,752	58.78	455,662.56
	OMV AG	8,029	48.18	386,837.22
	REPSOL SA	69,000	14.12	974,280.00
	SNAM SPA	117,058	3.62	424,803.48
	TENARIS SA	24,795	13.70	339,815.47
	TOTAL SA	131,741	46.60	6,139,130.60
	VOPAK	3,661	38.73	141,790.53
	AIR LIQUIDE	23,736	102.10	2,423,445.60
	AKZO NOBEL	13,655	78.98	1,078,471.90
	ARCELORMITTAL	36,249	28.83	1,045,239.91
	ARKEMA	3,446	102.45	353,042.70
	BASF SE	51,415	87.48	4,497,784.20
	COVESTRO AG	8,966	93.00	833,838.00
	CRH PLC	43,853	28.38	1,244,548.14
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,342	30.51	315,534.42
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	45.70	148,342.20
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,668	83.78	726,205.04
	IMERYS SA	2,111	85.20	179,857.20
	K+S AG	11,391	22.24	253,335.84
	KONINKLIJKE DSM NV	10,475	84.14	881,366.50
	LANXESS	5,764	68.24	393,335.36
	LINDE AG - TENDER	10,484	185.10	1,940,588.40
	SOLVAY SA	4,422	113.90	503,665.80
	STORA ENSO OYJ R	28,950	14.35	415,577.25
	SYMRISE AG	6,301	66.34	418,008.34
	THYSSEN KRUPP	24,540	23.04	565,401.60
	UMICORE	12,401	46.10	571,686.10
	UPM KYMMENE OYJ	28,303	28.11	795,597.33
	VOESTALPINE AG	5,948	46.38	275,868.24
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,861	29.13	432,900.93
AIRBUS SE	33,261	96.99	3,225,984.39	
ALSTOM	8,179	33.64	275,141.56	
ANDRITZ AG	3,617	48.46	175,279.82	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,606	31.19	143,661.14	
BOUYGUES ORD	11,310	42.69	482,823.90	
BRENTAG AG	7,892	52.26	412,435.92	
CNH INDUSTRIAL NV	53,801	11.67	627,857.67	

DASSAULT AVIATION SA	121	1,387.00	167,827.00
EIFFAGE	3,707	92.20	341,785.40
FERROVIAL SA	25,431	17.64	448,729.99
GEA GROUP AG	11,373	38.62	439,225.26
HOCHTIEF AG	1,172	137.70	161,384.40
KION GROUP AG	3,430	71.42	244,970.60
KONE OYJ-B	17,919	45.00	806,355.00
LEGRAND SA	14,055	63.50	892,492.50
LEONARDO SPA	22,011	9.07	199,815.85
MAN SE	1,966	94.80	186,376.80
METSO OYJ	6,409	26.61	170,543.49
MTU AERO ENGINES AG	3,209	141.50	454,073.50
OSRAM LICHT AG	5,768	68.80	396,838.40
PRYSMIAN SPA	11,275	26.70	301,042.50
REXEL SA	17,749	14.83	263,217.67
SAFRAN SA	18,001	89.86	1,617,569.86
SAINT-GOBAIN	28,009	44.26	1,239,678.34
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,416	72.52	2,278,288.32
SIEMENS	42,953	112.24	4,821,044.72
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	12.83	158,152.87
THALES SA	5,447	92.12	501,777.64
VINCI S.A.	27,970	82.78	2,315,356.60
WARTSILA OYJ	7,800	59.22	461,916.00
ZODIAC AEROSPACE	11,896	24.98	297,162.08
BUREAU VERITAS SA	13,374	21.72	290,483.28
EDENRED	12,153	27.40	332,992.20
RANDSTAD HOLDING NV	6,192	58.96	365,080.32
RELX NV	52,492	17.01	893,151.38
SOCIETE BIC SA	1,751	83.90	146,908.90
TELEPERFORMANCE	2,773	119.90	332,482.70
WOLTERS KLUWER	15,914	40.36	642,289.04
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	38,700	19.40	750,780.00
ADP	1,532	164.50	252,014.00
AENA SME SA	3,526	166.90	588,489.40
ATLANTIA SPA	26,561	25.68	682,086.48
BOLLORE	52,200	4.58	239,284.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,445	27.23	393,337.35
DEUTSCHE POST AG-REG	54,775	37.44	2,050,776.00
FRAPORT AG	1,934	89.90	173,866.60
GETLINK	26,998	10.63	287,123.73
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	32,810	6.99	229,604.38
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,877	86.80	1,638,523.60

BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,141	74.70	234,632.70
CONTINENTAL AG	5,971	229.30	1,369,150.30
DAIMLER AG	53,965	70.62	3,811,008.30
FAURECIA	3,558	69.26	246,427.08
FERRARI NV	6,958	104.50	727,111.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	59,425	18.04	1,072,027.00
MICHELIN	9,513	126.30	1,201,491.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,157	37.65	231,811.05
PEUGEOT SA	32,780	17.90	586,762.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,108	69.70	634,827.60
RENAULT SA	10,529	86.90	914,970.10
SCHAEFFLER AG	8,942	13.40	119,867.51
VALEO SA	12,585	60.58	762,399.30
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,498	164.86	1,730,700.28
VOLKSWAGEN STAMM	1,924	168.40	324,001.60
ADIDAS AG	10,627	182.75	1,942,084.25
HERMES INTERNATIONAL	1,744	439.10	765,790.40
HUGO BOSS AG	3,285	72.22	237,242.70
KERING	4,194	390.20	1,636,498.80
LUXOTTICA GROUP SPA	8,719	49.55	432,026.45
LVMH	15,481	245.10	3,794,393.10
SEB SA	1,716	164.70	282,625.20
ACCOR	9,765	45.45	443,819.25
PADDY POWER PLC	4,606	95.35	439,182.10
SODEXO	4,814	99.30	478,030.20
ALTICE NV -A	35,384	7.84	277,410.56
AXEL SPRINGER SE	3,235	72.95	235,993.25
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,675	18.80	163,133.37
JC DECAUX SA	3,750	33.02	123,825.00
LAGADERE S.C.A	6,893	24.80	170,946.40
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	11,988	31.45	377,022.60
PUBLICIS GROUPE	11,404	61.50	701,346.00
RTL GROUP	2,176	70.25	152,864.00
SES	18,856	12.01	226,460.56
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	56.40	159,668.40
VIVENDI	57,385	21.30	1,222,300.50
INDITEX	59,181	27.33	1,617,416.73
ZALANDO SE	7,250	47.52	344,520.00
CARREFOUR	32,231	19.25	620,446.75
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	46.01	151,740.98
COLRUYT SA	3,653	44.35	162,010.55
JERONIMO MARTINS	13,062	17.62	230,152.44

KONINKLIJKE AHOLD NV	69,100	17.65	1,219,615.00
METRO AG	8,880	16.17	143,589.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,767	85.40	3,652,301.80
DANONE (GROUPE)	33,451	64.51	2,157,924.01
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	26,648	6.23	166,017.04
HEINEKEN HOLDING NV	6,086	80.90	492,357.40
HEINEKEN NV	13,985	85.00	1,188,725.00
KERRY GROUP PLC-A	8,164	81.80	667,815.20
PERNOD-RICARD	11,752	133.00	1,563,016.00
REMY COINTREAU	1,020	107.70	109,854.00
BEIERSDORF AG	5,172	91.92	475,410.24
HENKEL AG & CO KGAA	5,864	97.85	573,792.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,760	107.20	1,046,272.00
LOREAL	14,004	175.60	2,459,102.40
UNILEVER NV-CVA	91,277	43.43	3,964,160.11
BIOMERIEUX	1,835	71.00	130,285.00
ESSILOR INTERNATIONAL	11,526	109.15	1,258,062.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	12,428	86.74	1,078,004.72
FRESENIUS SE&CO KGAA	22,538	63.52	1,431,613.76
KONINKLIJKE PHILIPS	53,240	31.22	1,662,419.00
BAYER	46,456	98.93	4,595,892.08
EUROFINS SCIENTIFIC	774	486.20	376,318.80
GRIFOLS SA	15,514	23.87	370,319.18
IPSEN	1,866	120.15	224,199.90
MERCK KGAA	6,731	83.50	562,038.50
ORION OYJ-CLASS B	5,393	27.38	147,660.34
QIAGEN N.V.	11,006	27.66	304,425.96
RECORDATI SPA	5,195	30.02	155,953.90
SANOFI	63,060	64.55	4,070,523.00
UCB (GROUPE)	6,519	66.56	433,904.64
ABN AMRO GROUP NV-CVA	25,191	25.27	636,576.57
AIB GROUP PLC	37,786	5.32	201,021.52
BANCO BILBAO VIZCAYA	375,267	7.02	2,636,625.94
BANCO DE SABADELL SA	278,761	1.82	509,156.96
BANCO SANTANDER SA	906,473	5.67	5,147,860.16
BANK OF IRELAND GROUP PLC	46,790	7.77	363,558.30
BANKIA SA	51,949	3.98	207,224.56
BANKINTER SA	34,589	8.91	308,187.99
BNP PARIBAS	62,270	65.08	4,052,531.60
CAIXABANK	199,348	4.04	806,960.70
COMMERZBANK AG	62,846	12.98	815,741.08
CREDIT AGRICOLE SA	63,198	13.86	876,240.27

ERSTE GROUP BANK AG	17,861	38.83	693,542.63
ING GROEP NV-CVA	219,085	14.71	3,222,740.35
INTESA SANPAOLO	758,865	3.08	2,344,133.98
INTESA SANPAOLO-RNC	44,487	3.22	143,292.62
KBC GROEP NV	13,885	72.76	1,010,272.60
MEDIOBANCA	29,447	9.87	290,759.67
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	31.44	247,307.04
SOCIETE GENERALE	42,844	46.25	1,981,749.22
UNICREDIT SPA	113,027	17.56	1,985,658.33
AMUNDI SA	2,812	69.28	194,815.36
DEUTSCHE BANK NAMEN	112,037	13.39	1,500,623.57
DEUTSCHE BOERSE	11,116	105.15	1,168,847.40
EURAZEO SA	2,123	79.95	169,733.85
EXOR NV	6,186	60.58	374,747.88
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,009	92.50	463,332.50
NATIXIS	50,808	7.06	358,806.09
WENDEL	1,767	141.70	250,383.90
AEGON	91,649	5.62	515,067.38
AGEAS	9,709	41.85	406,321.65
ALLIANZ SE-REG	25,238	192.52	4,858,819.76
ASSICURAZIONI GENERALI	72,240	15.42	1,114,302.00
AXA	107,552	25.40	2,731,820.80
CNP ASSURANCES	8,406	19.92	167,447.52
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	111.80	341,884.40
MAPFRE SA	56,454	2.77	156,377.58
MUENCHENER RUECKVERSICH.	8,877	184.80	1,640,469.60
NN GROUP NV	18,100	36.26	656,306.00
POSTE ITALIANE SPA	25,777	6.78	174,768.06
SAMPO OYJ-A SHS	24,654	47.15	1,162,436.10
SCOR SE	9,111	35.89	326,993.79
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	59,209	2.02	120,075.85
DEUTSCHE WOHNEN SE	20,887	33.76	705,145.12
VONOVIA SE	28,177	37.33	1,051,847.41
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	23,879	59.50	1,420,800.50
ATOS SE	5,204	121.75	633,587.00
CAPGEMINI SA	8,567	103.60	887,541.20
DASSAULT SYSTEMES SA	7,192	103.50	744,372.00
SAP SE	55,054	84.51	4,652,613.54
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,929	68.20	199,757.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,625	56.00	427,000.00
WIRECARD AG	6,970	100.05	697,348.50
INGENICO GROUP	3,351	92.62	310,369.62

	NOKIA OYJ	319,120	4.66	1,487,737.44
	1&1 DRILLISCH AG	2,406	64.50	155,187.00
	DEUTSCHE TELEKOM	187,505	13.29	2,491,941.45
	ELISA A	7,434	35.15	261,305.10
	ILIAD SA	1,337	198.00	264,726.00
	KPN (KON.)	179,463	2.59	465,706.48
	ORANGE	110,387	13.67	1,509,542.22
	PROXIMUS	7,531	25.85	194,676.35
	TELECOM ITALIA ORD	601,141	0.71	431,979.92
	TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.61	211,264.84
	TELEFONICA	256,569	7.65	1,963,779.12
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	4.04	165,437.31
	E.ON SE	127,680	8.25	1,053,743.04
	ELECTRICITE DE FRANCE	31,965	10.43	333,394.95
	ENDESA	16,465	17.29	284,679.85
	ENEL	457,804	4.77	2,183,725.08
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	125,070	2.70	338,189.28
	ENGIE	98,950	12.61	1,248,254.25
	FORTUM OYJ	23,370	17.91	418,673.55
	GAS NATURAL SDG SA	18,170	18.34	333,237.80
	IBERDROLA SA	328,582	6.15	2,020,779.30
	INNOGY SE	6,865	30.40	208,696.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	22,517	15.98	359,934.24
	RWE STAMM	31,894	16.46	524,975.24
	SUEZ	17,194	10.86	186,812.81
	TERNA SPA	88,647	4.53	401,925.49
	UNIPER SE	12,950	24.66	319,347.00
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,851	19.35	480,991.10
	ASML HOLDING NV	21,881	159.25	3,484,549.25
	INFINEON TECHNOLOGIES	61,664	22.51	1,388,056.64
	STMICROELECTRONICS	40,389	18.45	745,378.99
	ユーロ 小計	10,830,929		219,628,692.07 (29,138,138,576)
イギリスポンド	BP PLC	1,100,464	4.75	5,227,204.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	251,258	22.56	5,668,380.48
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	208,707	22.81	4,760,606.67
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	33,000	6.27	207,108.00
	ANGLO AMERICAN PLC	74,728	17.39	1,300,117.74
	ANTOFAGASTA PLC	21,571	8.93	192,715.31
	BHP BILLITTON PLC	118,824	14.90	1,770,952.89
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,806	44.66	348,615.96
	FRESNILLO PLC	10,869	13.40	145,698.94

GLENCORE PLC	690,426	3.84	2,653,997.54
JOHNSON MATTHEY PLC	9,810	31.71	311,075.10
MONDI PLC	18,808	19.17	360,549.36
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,478	61.50	398,397.00
RIO TINTO PLC REG	69,186	39.90	2,760,867.33
ASHTED GROUP PLC	28,731	20.65	593,295.15
BAE SYSTEMS PLC	178,641	5.95	1,064,343.07
BUNZL PLC	17,241	20.00	344,820.00
COBHAM PLC	125,000	1.24	155,562.50
DCC PLC	4,508	66.85	301,359.80
FERGUSON PLC	13,930	52.36	729,374.80
IMI PLC	14,582	12.63	184,170.66
MEGGITT PLC	43,669	4.80	209,611.20
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	93,200	8.40	783,439.20
SMITHS GROUP PLC	20,046	15.96	319,934.16
TRAVIS PERKINS PLC	15,153	14.17	214,793.77
WEIR GROUP PLC/THE	12,587	20.36	256,271.32
BABCOCK INTL GROUP PLC	14,809	6.46	95,695.75
CAPITA GROUP PLC	40,800	1.80	73,603.20
EXPERIAN PLC	51,031	15.59	795,573.29
G4S PLC	77,964	2.60	203,174.18
INTERTEK GROUP PLC	8,212	49.73	408,382.76
RELX PLC	59,947	14.93	895,008.71
EASYJET PLC	9,909	16.75	166,025.29
ROYAL MAIL PLC	44,164	5.56	245,905.15
NEW GKN	87,193	4.18	364,989.89
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.62	286,598.31
BURBERRY GROUP PLC	22,630	15.60	353,141.15
PERSIMMON PLC	15,742	24.65	388,040.30
TAYLOR WIMPAY PLC	166,048	1.91	317,234.70
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	38.49	252,109.50
CARNIVAL PLC	9,818	48.70	478,136.60
COMPASS GROUP PLC	85,598	15.52	1,328,480.96
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,227	45.68	467,169.36
MERLIN ENTERTAINME	43,424	3.53	153,373.56
TUI AG-DI	25,058	15.42	386,519.65
WHITBREAD PLC	9,381	39.18	367,547.58
ITV PLC	185,979	1.71	318,675.01
PEARSON	41,558	6.96	289,493.02
SKY PLC	59,062	11.06	653,225.72
WPP PLC	69,453	14.00	972,342.00
KINGFISHER PLC	114,680	3.61	414,453.52

MARKS & SPENCER GROUP PLC	82,369	3.00	247,436.47
NEXT PLC	8,359	49.92	417,281.28
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	2.23	249,810.17
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.54	208,735.81
TESCO	459,749	2.06	949,381.68
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,423	26.51	488,393.73
BRITISH AMERICAN TOBACCO	127,757	44.93	5,740,122.01
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,565	24.64	235,681.60
DIAGEO	140,464	24.93	3,501,767.52
IMPERIAL BRANDS PLC	53,653	26.75	1,435,486.01
RECKITT BENCKISER PLC	37,394	59.28	2,216,716.32
UNILEVER PLC	70,451	37.44	2,637,685.44
CONVATEC GROUP PLC	57,895	2.14	124,358.46
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	21,500	5.88	126,420.00
SMITH & NEPHEW PLC	45,722	12.69	580,212.18
ASTRAZENECA	70,596	47.22	3,333,543.12
GLAXOSMITHKLINE	275,161	13.25	3,645,883.25
SHIRE PLC	52,700	30.72	1,619,207.50
BARCLAYS	957,989	2.01	1,926,036.88
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,118,989	7.37	8,246,948.93
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,032,760	0.67	2,736,227.66
ROYAL BANK OF SCOTLAND	205,762	2.74	565,639.73
STANDARD CHARTERED PLC	184,957	8.20	1,517,017.31
3I GROUP PLC	49,801	9.17	456,774.77
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,303	17.02	260,533.57
INVESTEC PLC	32,355	6.19	200,471.58
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	17,870	40.05	715,693.50
SCHRODERS PLC	7,525	34.77	261,644.25
ST JAMES' S PLACE PLC	26,728	11.33	302,961.88
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	142,821	3.81	545,290.57
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	18.94	187,025.04
AVIVA PIC	218,859	5.00	1,095,170.43
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.88	267,165.16
LEGAL & GENERAL GROUP	337,768	2.57	868,063.76
OLD MUTUAL PLC	281,685	2.48	700,832.28
PRUDENTIAL	144,262	18.44	2,660,191.28
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	6.12	316,361.16
AUTO TRADER GROUP PLC	60,396	3.64	220,264.21
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	23,405	20.66	483,547.30
SAGE GROUP PLC	55,165	7.02	387,699.62
BT GROUP PLC	457,520	2.30	1,055,956.16
VODAFONE GROUP PLC	1,493,552	2.03	3,031,910.56

	CENTRICA PLC	286,017	1.30	373,967.22
	NATIONAL GRID PLC	191,332	7.48	1,431,163.36
	SEVERN TRENT PLC	11,927	17.11	204,130.60
	SSE PLC	53,154	12.13	644,758.02
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	6.64	230,653.10
	イギリスbond 小計	16,798,126		101,590,383.55 (15,298,495,858)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	14,239	23.82	339,172.98
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	625.50	255,204.00
	GIVAUDAN-REG	507	2,156.00	1,093,092.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	24,798	55.34	1,372,321.32
	SIKA AG-BR	125	7,755.00	969,375.00
	ABB LTD	103,904	23.74	2,466,680.96
	GEBERIT AG-REG	2,149	428.30	920,416.70
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,159	219.20	254,052.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,118	225.00	476,550.00
	ADECCO GROUP AG-REG	8,484	75.24	638,336.16
	SGS SA	286	2,408.00	688,688.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,765	164.30	454,289.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	29,560	84.82	2,507,279.20
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,792	410.60	735,795.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	78.35	235,363.40
	DUFREY AG-REG	1,811	138.05	250,008.55
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	129	1,895.00	244,455.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	67,500.00	337,500.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	56	5,640.00	315,840.00
	NESTLE SA - REGISTERED	173,575	75.20	13,052,840.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	145.25	388,108.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	637	664.50	423,286.50
	LONZA GROUP AG-REG	4,326	246.90	1,068,089.40
	NOVARTIS	124,263	80.46	9,998,200.98
	ROCHE HOLDING GENUSS	39,272	223.90	8,793,000.80
	VIFOR PHARMA AG	3,035	135.10	410,028.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG	136,960	17.55	2,403,648.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,064	61.74	806,571.36
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	82.15	188,041.35
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,038	683.50	709,473.00
	UBS GROUP AG	206,375	17.98	3,711,654.37
	BALOISE HOLDING AG	2,548	149.60	381,180.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,672	342.60	572,827.20
	SWISS RE LTD	17,876	96.38	1,722,888.88
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,534	310.80	2,652,367.20

	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	88.25	319,641.50	
	SWISSCOM	1,539	510.40	785,505.60	
	スイスフラン 小計	940,596		62,941,774.21 (7,233,268,692)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,250	191.60	1,772,300.00	
	BOLIDEN AB	16,893	287.70	4,860,116.10	
	ALFA LAVAL AB	18,213	201.70	3,673,562.10	
	ASSA ABLOY AB-B	55,667	180.80	10,064,593.60	
	ATLAS COPCO A	36,849	353.60	13,029,806.40	
	ATLAS COPCO B	23,119	314.00	7,259,366.00	
	SANDVIK AB	64,789	150.80	9,770,181.20	
	SKANSKA B	17,528	162.95	2,856,187.60	
	SKF AB-B	23,501	174.95	4,111,499.95	
	VOLVO B	85,429	158.20	13,514,867.80	
	SECURITAS B	20,175	141.30	2,850,727.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	14,772	266.00	3,929,352.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	87.70	1,915,455.70	
	HENNES & MAURITZ B	55,058	140.90	7,757,672.20	
	ICA GRUPPEN AB	5,386	298.20	1,606,105.20	
	SWEDISH MATCH AB	11,216	336.80	3,777,548.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,079	226.00	7,249,854.00	
	GETINGE AB-B SHS	8,952	102.00	913,104.00	
	NORDEA BANK AB	165,566	94.72	15,682,411.52	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	87,747	98.40	8,634,304.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	84,950	116.30	9,879,685.00	
	SWEDBANK AB-A	50,209	206.40	10,363,137.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	201.50	1,739,146.50	
	INVESTOR AB-B SHS	25,351	368.20	9,334,238.20	
	KINNEVIK AB - B	14,484	292.30	4,233,673.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,760	621.50	1,715,340.00	
ERICSSON (LM) B	178,077	54.74	9,747,934.98		
HEXAGON AB-B SHS	15,175	488.80	7,417,540.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,878	560.00	2,171,680.00		
TELE2 AB-B SHS	18,919	97.84	1,851,034.96		
TELIA CO AB	165,559	37.45	6,200,184.55		
	スウェーデンクローナ 小計	1,342,023		189,882,611.46 (2,521,641,080)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	66,270	177.70	11,776,179.00	
	NORSK HYDRO	80,998	56.26	4,556,947.48	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,904	353.20	3,851,292.80	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	201.50	948,259.00	
	MARINE HARVEST	25,848	150.50	3,890,124.00	

	ORKLA	48,425	84.56	4,094,818.00	
	DNB ASA	56,830	156.30	8,882,529.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	143.90	1,604,916.70	
	TELENOR ASA	44,068	176.50	7,778,002.00	
	ノルウェークローネ 小計	349,202		47,383,067.98 (650,095,692)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,228	517.60	2,706,012.80	
	NOVOZYMES A/S	12,241	321.10	3,930,585.10	
	VESTAS WIND SYSEMS	12,552	447.00	5,610,744.00	
	ISS A/S	8,803	222.10	1,955,146.30	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	10,030.00	1,995,970.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	348	10,565.00	3,676,620.00	
	DSV A/S	10,005	482.00	4,822,410.00	
	PANDORA A/S	6,365	622.00	3,959,030.00	
	CARLSBERG AS-B	6,298	729.60	4,595,020.80	
	COLOPLAST-B	6,257	518.80	3,246,131.60	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	8,166	195.10	1,593,186.60	
	GENMAB A/S	3,049	1,050.00	3,201,450.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	321.10	1,171,051.70	
	NOVO NORDISK A/S-B	104,709	309.55	32,412,670.95	
	DANSKE BANK A/S	41,094	245.00	10,068,030.00	
	TRYG A/S	5,192	145.10	753,359.20	
TDC A/S	43,672	49.35	2,155,213.20		
ORSTED A/S	11,238	366.10	4,114,231.80		
	デンマーククローネ 小計	289,063		91,966,864.05 (1,637,929,848)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,821	33.63	431,170.23	
	OIL SEARCH LTD	68,668	7.55	518,443.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	92,410	9.22	852,020.20	
	SANTOS	83,568	5.18	432,882.24	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,831	29.10	1,362,782.10	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD RTS	5,203	1.53	7,960.59	
	ALUMINA LIMITED	135,453	2.32	314,250.96	
	AMCOR	59,759	14.16	846,187.44	
	BHP BILLITON LTD	172,334	31.30	5,394,054.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	30,171	16.00	482,736.00	
	BORAL LIMITED	56,485	7.77	438,888.45	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	77,834	5.36	417,190.24	
	INCITEC PIVOT LTD	81,242	3.67	298,158.14	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	23,221	23.00	534,083.00	
	NEWCREST MINING LIMITED	39,517	22.36	883,600.12	
ORICA LTD	19,570	18.96	371,047.20		

RIO TINTO LTD	23,382	81.60	1,907,971.20
SOUTH32 LTD	272,725	3.21	875,447.25
CIMIC GROUP LIMITED	6,260	45.74	286,332.40
BRAMBLES LTD	81,398	9.64	784,676.72
SEEK LTD	17,113	19.68	336,783.84
AURIZON HOLDINGS LTD	94,727	4.57	432,902.39
TRANSURBAN GROUP	123,903	11.88	1,471,967.64
ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,496	24.23	617,768.08
CROWN RESORTS LTD	22,372	12.50	279,650.00
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,974	42.50	126,395.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	48.30	144,320.40
TABCORP HOLDINGS LTD	102,705	4.72	484,767.60
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	4.38	162,151.98
WESFARMERS LTD	61,771	40.76	2,517,785.96
WOOLWORTHS GROUP LTD	71,230	27.39	1,950,989.70
COCA-COLA AMATIL LIMITED	17,693	8.69	153,752.17
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,741	17.60	646,641.60
COCHLEAR LIMITED	3,025	176.20	533,005.00
HEALTHSCOPE LTD	92,574	1.88	174,501.99
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,451	68.69	511,809.19
SONIC HEALTHCARE LTD	19,613	24.08	472,281.04
CSL LIMITED	24,451	156.00	3,814,356.00
AUST AND NZ BANKING GROUP	158,017	27.98	4,421,315.66
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	12.37	236,242.26
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,879	11.14	266,012.06
COMMONWEALTH BANK OF AUST	92,560	74.26	6,873,505.60
NATIONAL AUSTRALIA BANK	144,648	29.30	4,238,186.40
WESTPAC BANKING	181,958	30.11	5,478,755.38
AMP LTD	169,110	5.37	908,120.70
ASX LTD	10,197	56.88	580,005.36
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	12.33	376,447.23
MACQUARIE GROUP LIMITED	17,830	103.35	1,842,730.50
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	124,658	7.73	963,606.34
MEDIBANK PRIVATE LTD	121,502	3.20	388,806.40
QBE INSURANCE GROUP	70,777	10.53	745,281.81
SUNCORP GROUP LIMITED	66,486	13.46	894,901.56
COMPUTERSHARE LIMITED	20,300	17.92	363,776.00
REA GROUP LTD	3,000	78.00	234,000.00
TELSTRA CORP	216,367	3.44	744,302.48
TPG TELECOM LTD	22,697	6.18	140,267.46
AGL ENERGY LTD	34,713	22.68	787,290.84
AUSNET SERVICES	117,666	1.68	197,678.88

	オーストラリアドル 小計	3,798,694		62,952,944.58 (5,342,186,877)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,101	6.86	275,092.86
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	6.50	319,241.00
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,518	12.98	344,203.64
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	10.58	232,760.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	105,967	3.45	366,115.98
	MERCURY NZ LTD	27,226	3.27	89,029.02
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	2.84	182,176.73
	ニュージーランドドル 小計	334,960		1,808,619.23 (142,844,746)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	147,448	97.85	14,427,786.80
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	14.52	1,067,220.00
	MTR CORP	77,500	41.25	3,196,875.00
	MINTH GROUP LTD	34,000	43.65	1,484,100.00
	LI & FUNG	377,400	3.91	1,475,634.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	66,500	48.75	3,241,875.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	33.35	1,567,450.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	115,000	68.00	7,820,000.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	23.40	1,413,360.00
	SANDS CHINA LTD	127,800	45.10	5,763,780.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	38,000	17.04	647,520.00
	SJM HOLDINGS LTD	140,000	7.61	1,065,400.00
	WYNN MACAU LTD	70,000	27.70	1,939,000.00
	WH GROUP LTD	438,000	9.05	3,963,900.00
	BANK EAST ASIA	67,964	33.30	2,263,201.20
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	196,000	38.90	7,624,400.00
	HANG SENG BANK	40,500	189.20	7,662,600.00
	FIRST PACIFIC CO	112,000	5.20	582,400.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	63,600	277.80	17,668,080.00
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	184,000	5.02	923,680.00
	AIA GROUP LTD	646,000	63.25	40,859,500.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	143,448	68.00	9,754,464.00
	HANG LUNG GROUP LTD	34,000	26.50	901,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	117,000	18.38	2,150,460.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	63,274	49.85	3,154,208.90
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	43.50	1,348,500.00
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	35.00	1,295,000.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	11.56	3,525,800.00
	SINO LAND CO	126,600	13.60	1,721,760.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	126.80	10,144,000.00	
SWIRE PACIFIC A	28,500	75.30	2,146,050.00	

	SWIRE PROPERTIES LTD	67,000	26.55	1,778,850.00	
	WHARF HOLDINGS	61,000	29.05	1,772,050.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	50.55	3,083,550.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	40,000	56.60	2,264,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.45	943,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	65.10	2,083,200.00	
	CLP HOLDINGS	93,000	76.65	7,128,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	444,428	15.12	6,719,751.36	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	65.65	4,825,275.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	110.50	1,292,850.00	
	香港ドル 小計	5,184,062		194,690,381.26 (2,675,045,838)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	77,300	8.09	625,357.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	3.28	203,360.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.36	251,328.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	158,500	1.45	229,825.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.04	232,356.00	
	SINGAPORE AIRLINES	32,500	11.20	364,000.00	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	52,600	5.18	272,468.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	319,700	1.29	412,413.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	84,550	2.65	224,057.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	37.90	174,340.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.35	172,785.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	76,800	3.05	234,240.00	
	DBS GROUP	97,900	28.66	2,805,814.00	
	OCBC BANK	172,650	12.83	2,215,099.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	73,600	27.22	2,003,392.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	7.54	320,450.00	
	CAPITALAND LTD	159,400	3.56	567,464.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	12.51	275,220.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,300	8.33	269,059.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	454,180	3.38	1,535,128.40	
STARHUB LTD	21,000	2.58	54,180.00		
	シンガポールドル 小計	2,619,500		13,442,337.00 (1,096,357,005)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,831	312.40	884,404.40	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	14.81	421,848.04	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,706	515.80	879,954.80	
	BANK HAPOALIM BM	66,756	24.39	1,628,178.84	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	89,987	20.47	1,842,033.89	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	63.21	396,453.12	
	AZRIELI GROUP	1,471	168.30	247,569.30	

	NICE LTD	3,244	324.30	1,052,029.20
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	117,181	5.24	614,028.44
	イスラエルシェケル 小計	317,932		7,966,500.03 (244,730,880)
	合 計	62,046,533		216,896,847,282 (216,896,847,282)

(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	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	299,000	106,145.00	
		アメリカドル 小計	299,000	106,145.00 (11,414,833)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	58,685	484,738.10	
		LENDLEASE GROUP	27,483	438,628.68	
		SYDNEY AIRPORT	53,915	363,387.10	
	オーストラリアドル 小計	140,083	1,286,753.88 (109,193,934)		
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	943,800.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	165,000	1,631,850.00	
	香港ドル 小計	295,000	2,575,650.00 (35,389,431)		
	投資信託受益証券合計			734,083	155,998,198 (155,998,198)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	23,936	450,714.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,887	591,180.39	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	23,998	3,341,481.52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	68,132	706,528.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,446	1,194,487.32	
		BOSTON PROPERTIES	8,178	976,371.42	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15,955	249,695.75	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,153	421,000.10	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	26,900	221,925.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	22,854	2,481,258.78	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,064	1,101,753.12	
		DUKE REALTY CORP	18,713	476,620.11	
		EQUINIX INC	4,393	1,741,560.92	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,826	1,142,770.64	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,477	783,854.88	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,639	536,099.25	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,790	434,182.40	

	GGP INC	36,240	783,508.80	
	HCP INC	24,801	556,782.45	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	39,222	765,221.22	
	INVITATION HOMES INC	19,958	424,307.08	
	IRON MOUNTAIN INC	15,087	484,594.44	
	KIMCO REALTY CORP	22,428	342,027.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,682	304,130.38	
	MACERICH CO/THE	5,933	352,301.54	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,265	552,886.25	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,300	273,604.00	
	PROLOGIS INC	30,197	1,848,962.31	
	PUBLIC STORAGE	8,956	1,668,592.36	
	REALTY INCOME CORP	16,079	794,302.60	
	REGENCY CENTERS CORP	8,074	468,776.44	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	6,502	1,103,519.44	
	SIMON PROPERTY GROUP	17,462	2,716,912.58	
	SL GREEN REALTY CORP	5,123	493,088.75	
	UDR INC	14,110	483,126.40	
	VENTAS INC	18,846	947,388.42	
	VEREIT INC	51,309	350,953.56	
	VORNADO REALTY TRUST	9,035	607,965.15	
	WELLTOWER INC	20,937	1,147,347.60	
	アメリカドル 小計	666,887	34,321,784.09 (3,690,964,661)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,959	201,968.52	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	213,248.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	88,230.58	
	カナダドル 小計	21,846	503,447.90 (42,808,174)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	FONCIERE DES REGIONS	1,902	165,283.80	
	GECINA SA	2,385	364,428.00	
	ICADE	1,843	150,849.55	
	KLEPIERRE	11,404	383,972.68	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,546	1,045,975.60	
	ユーロ 小計	1,628,664	2,110,509.63 (280,001,312)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,566	320,989.41	
	HAMMERSON PLC	46,892	218,422.93	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	38,147	358,009.59	
	SEGRO PLC	57,118	331,741.34	
		191,723	1,229,163.27	

イギリスポンド 小計			(185,099,696)	
オーストラリアドル	DEXUS	48,367	450,296.77	
	GOODMAN GROUP	94,201	779,042.27	
	GPT GROUP	81,988	390,262.88	
	MIRVAC GROUP	195,169	409,854.90	
	SCENTRE GROUP	277,205	1,058,923.10	
	STOCKLAND	121,481	487,138.81	
	VICINITY CENTERS	163,023	407,557.50	
	WESTFIELD CORP	101,837	873,761.46	
オーストラリアドル 小計		1,083,271	4,856,837.69	(412,151,246)
香港ドル	LINK REIT	123,500	8,027,500.00	
香港ドル 小計		123,500	8,027,500.00	(110,297,850)
シンガポールドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	120,300	313,983.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	193,600.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	144,600	289,200.00	
	SUNTEC REIT	113,000	218,090.00	
シンガポールドドル 小計		487,900	1,014,873.00	(82,773,041)
投資証券合計		4,203,791	4,804,095,980	(4,804,095,980)
合計			4,960,094,178	(4,960,094,178)

(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

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

通貨	銘柄数	組入株式 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	97.5%			64.4%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 39銘柄			2.5%	1.7%
カナダドル	株式 88銘柄	99.5%			3.6%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			13.1%
	投資証券 6銘柄			1.0%	0.1%

イギリスポンド	株式	98銘柄	98.8%			6.9%
	投資証券	4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	37銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデンクローナ	株式	31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式	58銘柄	91.1%			2.4%
	投資信託受益証券	3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券	8銘柄			7.0%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	41銘柄	94.8%			1.2%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式	21銘柄	93.0%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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

	平成30年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	303,791,577
コール・ローン	2,885,083,574
国債証券	137,674,514,736
派生商品評価勘定	521,786
未収入金	4,506
未収利息	1,144,932,946
前払金	13,849,359
前払費用	22,482,109
差入委託証拠金	96,017,620
流動資産合計	142,141,198,213

	平成30年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産合計	142,141,198,213
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,597,344
未払金	4,897,444
未払解約金	95,631,928
未払利息	5,747
流動負債合計	137,132,463
負債合計	137,132,463
純資産の部	
元本等	
元本	61,331,732,290
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	80,672,333,460
元本等合計	142,004,065,750
純資産合計	142,004,065,750
負債純資産合計	142,141,198,213

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 2月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

平成30年 2月21日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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)

平成30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	61,331,732,290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 2.3153円 (1万口当たり純資産額) (23,153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

平成30年 2月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。

	平成30年 2月21日現在
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コンプライアンス・リスク統括部が、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を担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成30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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成30年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 2月22日
期首元本額	72,701,567,546円
期中追加設定元本額	4,555,980,743円
期中一部解約元本額	15,925,815,999円
期末元本額	61,331,732,290円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,408,052,360円
DC外国債券インデックスファンド	1,800,181,484円
DC外国債券インデックスファンドL	11,167,341,736円
DCバランスファンド30	631,813,492円
DCバランスファンド50	670,493,141円
DCバランスファンド70	124,551,025円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	483,781,251円
外国債券インデックスe	1,476,628,751円
インデックスコレクション(外国債券)	3,049,023,797円
インデックスコレクション(バランス株式30)	1,734,057,765円
インデックスコレクション(バランス株式50)	300,562,888円
インデックスコレクション(バランス株式70)	81,950,904円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	3,476,017,596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)	2,478,056,522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)	1,056,643,261円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	389,640,022円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	1,553,602,994円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	565,909,022円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	995,830,233円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	6,225,214円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,845,816,822円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,670,434,113円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	863,274,368円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	8,965,685,097円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	431,815,067円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	2,326,234,913円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	2,233,433,818円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	164,810,920円

区分	平成30年 2月21日現在
バランスVA40（適格機関投資家専用）	509,955,286円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	95,569,303円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	141,265,030円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	69,978,530円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	127,520,027円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,956,312,044円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	15,001,079円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	349,814,932円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	105,383,053円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,979,552,923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）	29,420,380円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	91,127円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成30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	704,808,217
合計	704,808,217

(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

（平成30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	1,882,871,657	-	1,869,022,298	13,849,359
合計		1,882,871,657	-	1,869,022,298	13,849,359

(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。

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

（平成30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	2,625,957,699	-	2,603,731,500	22,226,199
	アメリカドル	1,205,990,500	-	1,193,325,100	12,665,400
	カナダドル	112,981,081	-	111,284,500	1,696,581
	ユーロ	1,115,909,030	-	1,107,961,500	7,947,530
	イギリスポンド	191,077,088	-	191,160,400	83,312
	合計	2,625,957,699	-	2,603,731,500	22,226,199

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.875% 06/15/19	2,800,000.00	2,754,024.39	
		T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,908,551.35	
		T 0.875% 09/15/19	7,100,000.00	6,956,733.36	
		T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,952,461.04	
		T 1.125% 05/31/19	2,850,000.00	2,813,613.96	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	3,825,809.20	
		T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,096,798.56	
		T 1.25% 01/31/20	4,000,000.00	3,924,346.48	
		T 1.25% 03/31/19	2,920,000.00	2,892,913.87	
		T 1.25% 03/31/21	2,300,000.00	2,218,445.65	
		T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,979,403.70	
		T 1.25% 06/30/19	1,500,000.00	1,481,972.50	
		T 1.375% 01/31/21	1,600,000.00	1,552,997.84	
		T 1.375% 02/28/19	4,050,000.00	4,020,982.07	

T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,911,568.90	
T 1.375% 04/30/20	8,250,000.00	8,087,420.38	
T 1.375% 04/30/21	3,000,000.00	2,901,163.32	
T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,895,557.70	
T 1.375% 08/31/20	1,750,000.00	1,708,596.94	
T 1.375% 09/30/20	2,950,000.00	2,876,995.96	
T 1.375% 09/30/23	7,100,000.00	6,606,339.05	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,845,329.00	
T 1.5% 01/31/19	1,900,000.00	1,890,030.52	
T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	2,881,650.00	
T 1.5% 02/28/19	5,900,000.00	5,865,556.92	
T 1.5% 02/28/23	4,200,000.00	3,972,008.88	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,778,490.52	
T 1.5% 05/31/19	1,350,000.00	1,339,174.59	
T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	7,432,853.76	
T 1.5% 10/31/19	3,200,000.00	3,162,456.99	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,937,166.65	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,239,109.51	
T 1.625% 03/31/19	4,400,000.00	4,376,783.66	
T 1.625% 04/30/19	4,000,000.00	3,976,464.88	
T 1.625% 04/30/23	8,100,000.00	7,689,109.19	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	4,903,234.23	
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,124,232.60	
T 1.625% 06/30/19	4,000,000.00	3,971,784.84	
T 1.625% 07/31/19	3,500,000.00	3,473,180.90	
T 1.625% 07/31/20	1,200,000.00	1,179,829.35	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,342,011.81	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,822,253.08	
T 1.625% 11/30/20	5,000,000.00	4,898,801.10	
T 1.625% 12/31/19	2,250,000.00	2,224,921.56	
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,539,738.37	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,537,333.80	
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,420,196.17	
T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	1,934,385.58	
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,447,759.22	
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,670,496.80	
T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,412,758.92	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,935,050.84	
T 1.75% 12/31/20	3,000,000.00	2,946,865.32	
T 1.875% 05/31/22	5,850,000.00	5,683,154.66	
T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,166,949.21	
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,518,222.87	

T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,451,247.54
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	1,933,906.42
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,418,667.66
T 1% 03/15/19	1,550,000.00	1,532,143.02
T 1% 06/30/19	1,200,000.00	1,181,544.73
T 1% 08/31/19	2,800,000.00	2,750,283.39
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,906,042.30
T 1% 11/30/19	2,600,000.00	2,545,043.38
T 2.125% 03/31/24	4,200,000.00	4,048,959.34
T 2.125% 05/15/25	5,250,000.00	5,007,879.18
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	2,965,754.52
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,078,799.42
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,441,217.11
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,863,881.86
T 2.125% 08/31/20	1,000,000.00	994,313.77
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,972,712.82
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,110,034.08
T 2.125% 12/31/22	6,800,000.00	6,639,312.93
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,697,956.67
T 2.25% 03/31/21	6,900,000.00	6,861,302.10
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,671,598.55
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,463,859.82
T 2.25% 08/15/27	6,330,000.00	5,984,773.38
T 2.25% 08/15/46	7,450,000.00	6,185,085.95
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,827,449.20
T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	6,226,735.64
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,407,179.26
T 2.25% 12/31/24	2,300,000.00	2,219,433.71
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,445,820.31
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,533,595.31
T 2.375% 12/31/20	4,300,000.00	4,297,587.18
T 2.5% 02/15/45	5,350,000.00	4,717,181.77
T 2.5% 02/15/46	7,500,000.00	6,588,932.40
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,642,051.93
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,414,811.69
T 2.625% 08/15/20	2,400,000.00	2,416,020.96
T 2.625% 11/15/20	2,350,000.00	2,364,840.32
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,012,858.86
T 2.75% 02/15/24	7,250,000.00	7,249,973.61
T 2.75% 08/15/42	2,100,000.00	1,964,741.03
T 2.75% 08/15/47	3,300,000.00	3,042,434.80
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,457,445.56
T 2.75% 11/15/42	1,900,000.00	1,775,457.16

T 2.875% 05/15/43	6,700,000.00	6,394,174.68
T 2.875% 08/15/45	7,050,000.00	6,691,468.09
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,035,246.92
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,302,103.01
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,734,261.87
T 2% 02/28/21	3,150,000.00	3,111,571.13
T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,419,168.97
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,432,615.50
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	954,233.71
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	3,968,161.68
T 2% 07/31/22	6,000,000.00	5,848,753.92
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,537,456.30
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,127,921.53
T 2% 09/30/20	4,000,000.00	3,963,820.80
T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,121,553.11
T 2% 11/15/21	4,300,000.00	4,219,667.35
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,512,641.49
T 2% 11/30/20	2,800,000.00	2,771,331.10
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,343,952.62
T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,311,615.53
T 3.125% 02/15/42	1,800,000.00	1,802,657.19
T 3.125% 02/15/43	420,000.00	419,489.01
T 3.125% 05/15/19	3,620,000.00	3,662,746.55
T 3.125% 05/15/21	6,250,000.00	6,376,697.37
T 3.125% 08/15/44	7,200,000.00	7,175,139.91
T 3.125% 11/15/41	1,970,000.00	1,973,018.68
T 3.375% 05/15/44	1,500,000.00	1,562,089.86
T 3.375% 11/15/19	5,900,000.00	6,014,766.85
T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,174,313.47
T 3.5% 05/15/20	300,000.00	307,783.35
T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	10,056,171.02
T 3.625% 02/15/21	1,050,000.00	1,086,144.26
T 3.625% 02/15/44	5,850,000.00	6,352,096.49
T 3.625% 08/15/19	5,500,000.00	5,613,602.28
T 3.625% 08/15/43	2,500,000.00	2,713,387.90
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,217,203.04
T 3.75% 11/15/43	1,400,000.00	1,550,553.32
T 3.875% 08/15/40	1,550,000.00	1,745,837.30
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,077,723.16
T 3% 05/15/45	200,000.00	194,598.14
T 3% 05/15/47	2,000,000.00	1,940,271.70
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	1,995,742.36

	T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,006,330.56	
	T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,068,922.65	
	T 4.375% 02/15/38	700,000.00	839,639.07	
	T 4.375% 05/15/40	1,600,000.00	1,930,680.59	
	T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,633,705.90	
	T 4.375% 11/15/39	1,050,000.00	1,265,255.59	
	T 4.5% 02/15/36	1,000,000.00	1,208,285.41	
	T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,530,415.12	
	T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	1,869,092.32	
	T 4.75% 02/15/41	350,000.00	444,778.36	
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	836,845.20	
	T 5.25% 02/15/29	500,000.00	609,263.52	
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,093,035.93	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	946,687.21	
	T 5.5% 08/15/28	250,000.00	308,247.64	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	735,667.69	
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,337,280.37	
	T 6.25% 05/15/30	1,200,000.00	1,607,665.60	
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,595,467.13	
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	576,333.54	
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,106,684.64	
	T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,078,224.66	
	アメリカドル 小計	548,590,000.00	539,659,174.38	(58,034,947,612)
カナダドル	CAN 0.5% 02/01/19	200,000.00	197,964.00	
	CAN 0.5% 03/01/22	850,000.00	799,867.00	
	CAN 0.75% 03/01/21	300,000.00	289,545.00	
	CAN 0.75% 09/01/20	1,550,000.00	1,506,724.00	
	CAN 0.75% 09/01/21	1,500,000.00	1,437,210.00	
	CAN 1.25% 11/01/19	1,000,000.00	991,410.00	
	CAN 1.5% 03/01/20	1,730,000.00	1,718,720.40	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,500,000.00	1,453,080.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,450,000.00	1,364,696.50	
	CAN 1.75% 03/01/19	2,340,000.00	2,343,217.50	
	CAN 1.75% 09/01/19	750,000.00	749,955.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	944,210.90	
	CAN 1% 09/01/22	1,150,000.00	1,096,507.75	
	CAN 2.25% 06/01/25	530,000.00	530,299.45	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,350,000.00	1,373,996.25	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,100,000.00	1,131,344.50	
	CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	923,135.25	
	CAN 2.75% 12/01/64	200,000.00	217,683.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,700,000.00	1,768,399.50	

	CAN 3.5% 06/01/20	3,070,000.00	3,180,688.85
	CAN 3.5% 12/01/45	1,490,000.00	1,792,090.05
	CAN 3.75% 06/01/19	2,790,000.00	2,861,898.30
	CAN 4.0% 06/01/41	1,230,000.00	1,557,727.35
	CAN 5.75% 06/01/29	1,110,000.00	1,479,802.05
	CAN 5.75% 06/01/33	1,050,000.00	1,494,244.50
	CAN 5% 06/01/37	900,000.00	1,247,571.00
	CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	706,555.20
	カナダドル 小計	33,250,000.00	35,158,543.30 (2,989,530,936)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,732,832.00
	MBONO 10% 12/05/24	23,650,000.00	26,549,490.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	5,600,000.00	4,947,544.00
	MBONO 5% 12/11/19	18,550,000.00	17,722,113.50
	MBONO 6.5% 06/09/22	13,950,000.00	13,360,752.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	25,200,000.00	24,360,336.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,300,000.00	7,190,755.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	11,850,000.00	11,791,875.75
	MBONO 7.75% 11/13/42	15,500,000.00	15,253,627.50
	MBONO 7.75% 11/23/34	7,650,000.00	7,585,434.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	8,000,000.00	8,439,720.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	8,200,000.00	8,714,263.00
	MBONO 8% 06/11/20	22,400,000.00	22,575,392.00
	MBONO 8% 11/07/47	3,000,000.00	3,024,360.00
	MBONO 8% 12/07/23	7,550,000.00	7,665,439.50
	メキシコペソ 小計	184,800,000.00	186,913,934.75 (1,074,755,124)
ユーロ	BGB 0.5% 10/22/24	350,000.00	350,066.50
	BGB 0.8% 06/22/25	1,430,000.00	1,450,677.80
	BGB 0.8% 06/22/27	450,000.00	446,260.50
	BGB 1.45% 06/22/37	200,000.00	197,730.00
	BGB 1.6% 06/22/47	550,000.00	527,172.25
	BGB 1.9% 06/22/38	460,000.00	487,804.70
	BGB 1% 06/22/26	1,200,000.00	1,223,286.00
	BGB 1% 06/22/31	1,060,000.00	1,029,032.10
	BGB 2.15% 06/22/66	240,000.00	249,943.20
	BGB 2.25% 06/22/23	1,230,000.00	1,365,072.45
	BGB 2.25% 06/22/57	220,000.00	238,705.50
	BGB 2.6% 06/22/24	1,350,000.00	1,534,038.75
	BGB 3.75% 06/22/45	800,000.00	1,158,972.00
	BGB 3.75% 09/28/20	1,480,000.00	1,638,101.00
	BGB 3% 06/22/34	500,000.00	617,932.50

BGB 3% 09/28/19	970,000.00	1,024,353.95
BGB 4.0% 03/28/19	1,000,000.00	1,050,185.00
BGB 4.25% 03/28/41	1,400,000.00	2,126,124.00
BGB 4.25% 09/28/21	1,250,000.00	1,448,768.75
BGB 4.25% 09/28/22	1,450,000.00	1,730,799.75
BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,239,013.75
BGB 4% 03/28/22	790,000.00	921,993.20
BGB 4% 03/28/32	450,000.00	612,913.50
BGB 5.5% 03/28/28	1,350,000.00	1,952,444.25
BGB 5% 03/28/35	1,630,000.00	2,535,758.40
BTPS 0.2% 10/15/20	1,350,000.00	1,353,010.50
BTPS 0.35% 06/15/20	900,000.00	906,907.50
BTPS 0.35% 11/01/21	3,300,000.00	3,293,020.50
BTPS 0.65% 10/15/23	1,650,000.00	1,608,898.50
BTPS 0.65% 11/01/20	1,200,000.00	1,217,370.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,800,000.00	1,703,340.00
BTPS 1.35% 04/15/22	300,000.00	308,712.00
BTPS 1.45% 09/15/22	250,000.00	257,711.25
BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	599,331.00
BTPS 1.5% 06/01/25	1,750,000.00	1,736,805.00
BTPS 1.5% 08/01/19	1,300,000.00	1,333,455.50
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,325,504.25
BTPS 1.65% 03/01/32	450,000.00	406,777.50
BTPS 2.05% 08/01/27	2,100,000.00	2,099,139.00
BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,806,734.50
BTPS 2.2% 06/01/27	1,720,000.00	1,746,384.80
BTPS 2.25% 09/01/36	1,320,000.00	1,228,167.60
BTPS 2.45% 09/01/33	500,000.00	489,840.00
BTPS 2.5% 05/01/19	800,000.00	826,920.00
BTPS 2.5% 12/01/24	1,800,000.00	1,918,845.00
BTPS 2.7% 03/01/47	1,800,000.00	1,675,134.00
BTPS 2.8% 03/01/67	470,000.00	418,093.20
BTPS 2.95% 09/01/38	470,000.00	474,436.80
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,069,860.75
BTPS 3.25% 09/01/46	450,000.00	466,890.75
BTPS 3.45% 03/01/48	500,000.00	529,260.00
BTPS 3.5% 03/01/30	1,850,000.00	2,063,175.50
BTPS 3.75% 03/01/21	1,550,000.00	1,715,602.00
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,720,112.50
BTPS 3.75% 08/01/21	2,400,000.00	2,677,776.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,900,000.00	2,178,549.50
BTPS 4.25% 02/01/19	1,850,000.00	1,930,891.25
BTPS 4.25% 03/01/20	2,750,000.00	2,991,683.75

BTPS 4.25% 09/01/19	4,350,000.00	4,647,888.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	2,250,000.00	2,452,027.50	
BTPS 4.5% 03/01/19	2,000,000.00	2,099,290.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,640,000.00	3,134,934.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,710,890.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	500,000.00	589,232.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	1,500,000.00	1,796,280.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,990,000.00	4,599,372.75	
BTPS 4.75% 09/01/28	1,900,000.00	2,352,219.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,450,000.00	1,887,726.00	
BTPS 4% 02/01/37	2,100,000.00	2,482,084.50	
BTPS 4% 09/01/20	1,020,000.00	1,121,087.10	
BTPS 5.0% 08/01/39	1,740,000.00	2,316,453.30	
BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	2,991,023.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	2,060,468.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,674,573.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	1,500,000.00	2,089,650.00	
BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,705,439.25	
BTPS 5% 03/01/25	1,300,000.00	1,600,313.00	
BTPS 5% 08/01/34	2,100,000.00	2,758,402.50	
BTPS 5% 09/01/40	1,650,000.00	2,187,685.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	1,250,000.00	1,739,512.50	
BTPS 6% 05/01/31	2,800,000.00	3,920,532.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	500,692.50	
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,582,064.00	
DBR 0.25% 02/15/27	2,930,000.00	2,836,122.80	
DBR 0.5% 02/15/25	700,000.00	706,457.50	
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,001,800.00	
DBR 0.5% 02/15/28	640,000.00	625,734.40	
DBR 0% 08/15/26	2,050,000.00	1,955,136.25	
DBR 1.25% 08/15/48	200,000.00	192,665.00	
DBR 1.5% 02/15/23	1,950,000.00	2,093,120.25	
DBR 1.5% 05/15/23	1,360,000.00	1,460,490.40	
DBR 1.5% 05/15/24	1,450,000.00	1,561,207.75	
DBR 1.5% 09/04/22	2,050,000.00	2,195,878.00	
DBR 1.75% 02/15/24	650,000.00	709,205.25	
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,784,268.75	
DBR 1% 08/15/24	1,950,000.00	2,038,383.75	
DBR 1% 08/15/25	2,750,000.00	2,866,008.75	
DBR 2.25% 09/04/20	1,900,000.00	2,031,755.50	
DBR 2.25% 09/04/21	2,600,000.00	2,830,854.00	
DBR 2.5% 01/04/21	2,130,000.00	2,308,281.00	

DBR 2.5% 07/04/44	1,720,000.00	2,159,503.00
DBR 2.5% 08/15/46	1,820,000.00	2,306,231.20
DBR 2% 01/04/22	1,870,000.00	2,028,744.30
DBR 2% 08/15/23	850,000.00	936,559.75
DBR 3.25% 01/04/20	550,000.00	589,696.25
DBR 3.25% 07/04/21	2,150,000.00	2,408,043.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,200,000.00	1,688,154.00
DBR 3.5% 07/04/19	3,700,000.00	3,910,567.00
DBR 3% 07/04/20	1,150,000.00	1,245,789.25
DBR 4.0% 01/04/37	1,700,000.00	2,521,040.50
DBR 4.25% 07/04/39	1,100,000.00	1,726,609.50
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	979,776.00
DBR 4.75% 07/04/34	1,550,000.00	2,406,716.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,050,000.00	1,769,869.50
DBR 5.5% 01/04/31	1,070,000.00	1,667,744.80
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,203,380.00
DBR 6.25% 01/04/24	720,000.00	974,437.20
DBR 6.25% 01/04/30	800,000.00	1,290,212.00
DBR 6.5% 07/04/27	200,000.00	306,393.00
FRTR 0.25% 11/25/20	2,050,000.00	2,080,442.50
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	1,956,284.25
FRTR 0.5% 05/25/25	3,600,000.00	3,586,518.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,212,875.00
FRTR 0.5% 11/25/19	720,000.00	732,902.40
FRTR 0% 02/25/20	2,200,000.00	2,219,690.00
FRTR 0% 03/25/23	700,000.00	692,933.50
FRTR 0% 05/25/20	2,050,000.00	2,068,532.00
FRTR 0% 05/25/21	1,000,000.00	1,006,015.00
FRTR 1.25% 05/25/36	1,450,000.00	1,393,906.75
FRTR 1.5% 05/25/31	2,550,000.00	2,630,784.00
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,812,056.00
FRTR 1.75% 05/25/66	450,000.00	419,316.75
FRTR 1.75% 06/25/39	700,000.00	720,170.50
FRTR 1.75% 11/25/24	3,000,000.00	3,255,705.00
FRTR 1% 05/25/19	450,000.00	459,024.75
FRTR 1% 05/25/27	700,000.00	708,295.00
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,302,619.20
FRTR 2.25% 05/25/24	2,390,000.00	2,666,068.90
FRTR 2.25% 10/25/22	2,550,000.00	2,808,034.50
FRTR 2.5% 05/25/30	3,230,000.00	3,725,013.65
FRTR 2.5% 10/25/20	3,450,000.00	3,711,734.25
FRTR 2.75% 10/25/27	2,800,000.00	3,280,690.00
FRTR 2% 05/25/48	200,000.00	207,663.00

FRTR 3.25% 05/25/45	2,710,000.00	3,593,703.90	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,350,000.00	4,891,401.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	3,000,000.00	3,257,550.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	3,960,000.00	4,862,068.20	
FRTR 3.75% 04/25/21	3,700,000.00	4,169,937.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	3,550,000.00	3,806,363.25	
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,224,525.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	1,750,000.00	1,849,802.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	3,250,000.00	3,983,167.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,300,000.00	3,589,334.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,250,000.00	3,415,275.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,150,000.00	1,797,875.50	
FRTR 4% 04/25/60	1,070,000.00	1,712,813.20	
FRTR 4% 10/25/38	2,100,000.00	3,023,349.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,680,362.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	2,410,000.00	3,863,097.45	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	2,042,803.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,573,176.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,350,000.00	1,555,645.50	
IRISH 0.8% 03/15/22	450,000.00	464,125.50	
IRISH 0.9% 05/15/28	280,000.00	272,777.40	
IRISH 1.7% 05/15/37	370,000.00	371,111.85	
IRISH 1% 05/15/26	650,000.00	656,223.75	
IRISH 2.4% 05/15/30	820,000.00	920,995.30	
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	639,300.60	
IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	493,821.30	
IRISH 3.9% 03/20/23	470,000.00	556,726.75	
IRISH 4.4% 06/18/19	600,000.00	639,324.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	980,000.00	1,084,477.80	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,050,000.00	1,390,877.25	
IRISH 5.9% 10/18/19	450,000.00	497,871.00	
IRISH 5% 10/18/20	620,000.00	708,846.00	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,500,000.00	1,522,935.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	810,000.00	793,800.00	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,550,000.00	1,530,803.25	
NETHER 0.75% 07/15/27	700,000.00	697,914.00	
NETHER 0% 01/15/22	1,100,000.00	1,105,065.50	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,550,000.00	1,681,238.50	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,300,000.00	1,431,371.50	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,070,000.00	1,274,765.90	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,050,000.00	1,386,147.00	
NETHER 2% 07/15/24	1,350,000.00	1,490,123.25	

NETHER 3.25% 07/15/21	1,300,000.00	1,455,395.50
NETHER 3.5% 07/15/20	640,000.00	701,152.00
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	354,063.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,110,000.00	1,666,470.75
NETHER 4% 01/15/37	1,190,000.00	1,756,600.65
NETHER 4% 07/15/19	1,220,000.00	1,299,226.80
NETHER 5.5% 01/15/28	850,000.00	1,231,922.00
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	954,457.00
OBL 0.25% 10/11/19	1,900,000.00	1,926,609.50
OBL 0.25% 10/16/20	1,800,000.00	1,833,399.00
OBL 0.5% 04/12/19	1,450,000.00	1,469,466.25
OBL 0% 04/08/22	1,900,000.00	1,910,393.00
OBL 0% 04/17/20	1,050,000.00	1,061,628.75
OBL 1% 02/22/19	2,300,000.00	2,338,973.50
RAGB 0.25% 10/18/19	100,000.00	101,284.50
RAGB 0.75% 10/20/26	1,300,000.00	1,300,494.00
RAGB 0% 07/15/23	150,000.00	148,023.00
RAGB 0% 09/20/22	270,000.00	269,518.05
RAGB 1.2% 10/20/25	1,020,000.00	1,066,517.10
RAGB 1.5% 02/20/47	70,000.00	68,542.95
RAGB 1.5% 11/02/86	190,000.00	163,378.15
RAGB 1.65% 10/21/24	800,000.00	863,516.00
RAGB 1.75% 10/20/23	700,000.00	758,362.50
RAGB 1.95% 06/18/19	650,000.00	671,411.00
RAGB 2.1% 09/20/17	270,000.00	281,460.15
RAGB 2.4% 05/23/34	510,000.00	593,219.25
RAGB 3.15% 06/20/44	800,000.00	1,090,580.00
RAGB 3.4% 11/22/22	800,000.00	926,280.00
RAGB 3.5% 09/15/21	1,230,000.00	1,390,515.00
RAGB 3.65% 04/20/22	570,000.00	656,982.00
RAGB 3.8% 01/26/62	300,000.00	494,799.00
RAGB 3.9% 07/15/20	900,000.00	992,254.50
RAGB 4.15% 03/15/37	1,000,000.00	1,475,150.00
RAGB 4.35% 03/15/19	1,500,000.00	1,578,142.50
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,270,021.75
RAGB 6.25% 07/15/27	370,000.00	554,126.80
RFGB 0.5% 04/15/26	490,000.00	483,924.00
RFGB 0.5% 09/15/27	200,000.00	193,752.00
RFGB 0.75% 04/15/31	350,000.00	335,014.75
RFGB 0.875% 09/15/25	190,000.00	194,226.55
RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	250,182.50
RFGB 1.5% 04/15/23	770,000.00	822,105.90
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	407,441.70

RFGB 2.625% 07/04/42	410,000.00	518,008.35	
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	450,837.70	
RFGB 2% 04/15/24	200,000.00	219,841.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	770,000.00	832,951.35	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,000,000.00	1,117,280.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	250,000.00	266,970.00	
RFGB 4% 07/04/25	360,000.00	449,868.60	
SPGB 0.05% 01/31/21	400,000.00	400,318.00	
SPGB 0.25% 01/31/19	400,000.00	402,500.00	
SPGB 0.4% 04/30/22	1,470,000.00	1,475,152.35	
SPGB 0.75% 07/30/21	1,000,000.00	1,022,805.00	
SPGB 1.15% 07/30/20	950,000.00	978,918.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	1,050,000.00	1,046,262.00	
SPGB 1.4% 01/31/20	1,850,000.00	1,907,738.50	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,250,000.00	2,235,003.75	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,200,000.00	1,206,648.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,302,143.75	
SPGB 1.95% 04/30/26	1,760,000.00	1,854,608.80	
SPGB 1.95% 07/30/30	1,700,000.00	1,723,834.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	950,000.00	1,020,452.00	
SPGB 2.35% 07/30/33	450,000.00	464,645.25	
SPGB 2.75% 04/30/19	550,000.00	570,443.50	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,900,000.00	2,130,755.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	960,000.00	1,013,040.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	550,000.00	623,922.75	
SPGB 3.8% 04/30/24	1,900,000.00	2,244,375.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,640,000.00	2,137,477.60	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,586,108.00	
SPGB 4.4% 10/31/23	1,850,000.00	2,238,213.25	
SPGB 4.6% 07/30/19	1,430,000.00	1,531,773.10	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,850,000.00	2,327,725.50	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,390,000.00	1,956,925.40	
SPGB 4.8% 01/31/24	1,050,000.00	1,299,590.25	
SPGB 4.85% 10/31/20	1,000,000.00	1,132,225.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,250,000.00	1,793,993.75	
SPGB 4% 04/30/20	3,350,000.00	3,654,196.75	
SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,009,053.75	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,040,000.00	1,561,144.00	
SPGB 5.4% 01/31/23	1,320,000.00	1,637,308.20	
SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,519,345.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	1,550,000.00	2,297,394.50	
SPGB 5.85% 01/31/22	2,000,000.00	2,441,170.00	

	SPGB 5.9% 07/30/26	1,850,000.00	2,533,649.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,374,940.75
	ユーロ 小計	375,550,000.00	432,584,873.25 (57,391,035,134)
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	950,000.00	927,242.75
	UKT 1.25% 07/22/27	940,000.00	911,250.10
	UKT 1.5% 01/22/21	2,780,000.00	2,830,846.20
	UKT 1.5% 07/22/26	2,400,000.00	2,403,648.00
	UKT 1.5% 07/22/47	850,000.00	761,897.50
	UKT 1.75% 07/22/19	2,900,000.00	2,944,094.50
	UKT 1.75% 07/22/57	400,000.00	393,554.00
	UKT 1.75% 09/07/22	2,000,000.00	2,061,120.00
	UKT 1.75% 09/07/37	550,000.00	531,690.50
	UKT 2.25% 09/07/23	1,820,000.00	1,923,394.20
	UKT 2.5% 07/22/65	1,350,000.00	1,675,532.25
	UKT 2.75% 09/07/24	1,820,000.00	1,986,730.20
	UKT 2% 07/22/20	1,950,000.00	2,006,130.75
	UKT 2% 09/07/25	1,450,000.00	1,515,250.00
	UKT 3.25% 01/22/44	2,280,000.00	2,861,650.80
	UKT 3.5% 01/22/45	1,150,000.00	1,511,537.00
	UKT 3.5% 07/22/68	1,550,000.00	2,457,680.00
	UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	1,633,320.60
	UKT 3.75% 09/07/19	700,000.00	732,977.00
	UKT 3.75% 09/07/20	890,000.00	955,793.25
	UKT 3.75% 09/07/21	1,050,000.00	1,153,881.75
	UKT 4.25% 03/07/36	1,740,000.00	2,363,207.10
	UKT 4.25% 06/07/32	1,250,000.00	1,631,062.50
	UKT 4.25% 09/07/39	1,550,000.00	2,173,851.75
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	931,091.25
	UKT 4.25% 12/07/40	1,170,000.00	1,659,574.80
	UKT 4.25% 12/07/46	1,600,000.00	2,398,240.00
	UKT 4.25% 12/07/49	1,170,000.00	1,815,038.55
	UKT 4.25% 12/07/55	1,450,000.00	2,407,485.75
	UKT 4.5% 09/07/34	1,650,000.00	2,265,507.75
	UKT 4.5% 12/07/42	1,340,000.00	2,001,618.30
	UKT 4.75% 03/07/20	2,100,000.00	2,271,381.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,150,000.00	1,541,989.00
	UKT 4.75% 12/07/38	770,000.00	1,140,396.95
UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	1,653,595.00	
UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,296,133.25	
UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	1,993,616.00	
UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	643,907.25	
UKT 8% 06/07/21	600,000.00	738,315.00	

	イギリスポンド 小計	54,280,000.00	66,105,232.55 (9,954,786,969)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	570,000.00	612,975.15
	SWISS 2% 04/28/21	230,000.00	249,921.45
	SWISS 3% 05/12/19	490,000.00	514,242.75
	SWISS 4% 02/11/23	100,000.00	122,086.00
	SWISS 4% 04/08/28	520,000.00	722,009.60
	スイスフラン 小計	1,910,000.00	2,221,234.95 (255,264,320)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	2,900,000.00	2,861,488.00
	SGB 1.5% 11/13/23	5,100,000.00	5,459,652.00
	SGB 1% 11/12/26	5,360,000.00	5,495,447.20
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,740,088.50
	SGB 3.5% 03/30/39	3,700,000.00	4,985,361.50
	SGB 3.5% 06/01/22	7,450,000.00	8,580,984.50
	SGB 4.25% 03/12/19	7,950,000.00	8,373,894.00
	SGB 5% 12/01/20	7,500,000.00	8,635,087.50
	スウェーデンクローナ 小計	44,110,000.00	49,132,003.20 (652,473,002)
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,150,000.00	3,078,715.50
	NGB 1.75% 02/17/27	2,500,000.00	2,469,025.00
	NGB 1.75% 03/13/25	3,190,000.00	3,198,932.00
	NGB 2% 05/24/23	4,550,000.00	4,677,923.25
	NGB 3.75% 05/25/21	6,300,000.00	6,833,326.50
	NGB 3% 03/14/24	3,550,000.00	3,843,656.00
	NGB 4.5% 05/22/19	6,500,000.00	6,812,682.50
	ノルウェークローネ 小計	29,740,000.00	30,914,260.75 (424,143,657)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	200,000.00	203,300.00
	DGB 0.5% 11/15/27	1,800,000.00	1,749,753.00
	DGB 1.5% 11/15/23	4,250,000.00	4,548,328.75
	DGB 1.75% 11/15/25	6,300,000.00	6,878,245.50
	DGB 3% 11/15/21	6,200,000.00	6,925,710.00
	DGB 4.5% 11/15/39	10,150,000.00	16,387,327.25
	DGB 4% 11/15/19	8,020,000.00	8,656,828.10
	デンマーククローネ 小計	36,920,000.00	45,349,492.60 (807,674,463)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	1,750,000.00	1,742,177.50
	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,018,993.75
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	1,979,930.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,150,000.00	2,966,685.75
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,750,000.00	1,623,212.50

	POLGB 2% 04/25/21	2,860,000.00	2,849,346.50	
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,700,000.00	2,766,366.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,000,000.00	2,006,830.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,870,000.00	3,040,018.80	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,300,000.00	2,502,066.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	1,900,000.00	2,023,576.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,101,838.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	850,000.00	966,122.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,250,000.00	1,401,375.00	
	ポーランドズロチ 小計	28,330,000.00	28,988,539.55	(926,763,609)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	1,750,000.00	1,732,193.75	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,366,103.00	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,050,000.00	2,066,102.75	
	ACGB 2.75% 06/21/35	580,000.00	542,123.10	
	ACGB 2.75% 10/21/19	1,310,000.00	1,327,390.25	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,900,000.00	1,879,565.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,550,000.00	1,524,773.75	
	ACGB 2.75% 11/21/29	600,000.00	585,882.00	
	ACGB 2% 12/21/21	1,400,000.00	1,385,034.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,050,000.00	2,120,817.25	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,530,000.00	1,574,714.25	
	ACGB 3.25% 06/21/39	550,000.00	540,353.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	820,000.00	872,697.30	
	ACGB 3% 03/21/47	800,000.00	725,768.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,450,000.00	2,709,063.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,750,000.00	2,891,858.75	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,120,000.00	1,305,830.40	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	2,765,160.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	1,570,000.00	1,626,103.95	
	ACGB 5.5% 04/21/23	1,820,000.00	2,085,592.60	
ACGB 5.75% 05/15/21	2,000,000.00	2,220,490.00		
ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,282,700.00		
	オーストラリアドル 小計	34,450,000.00	36,130,316.60	(3,066,018,666)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	140,000.00	137,164.30	
	SIGB 1.625% 10/01/19	250,000.00	250,107.50	
	SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	197,233.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	720,000.00	730,209.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	110,000.00	102,133.35	
	SIGB 2.375% 06/01/25	100,000.00	100,593.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	930,000.00	941,485.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	270,000.00	264,905.10	

	SIGB 2.75% 04/01/42	380,000.00	376,302.60
	SIGB 2.75% 07/01/23	350,000.00	361,464.25
	SIGB 2.875% 07/01/29	100,000.00	103,613.50
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	382,204.45
	SIGB 2% 07/01/20	100,000.00	100,701.00
	SIGB 3.125% 09/01/22	250,000.00	262,681.25
	SIGB 3.25% 09/01/20	630,000.00	653,706.90
	SIGB 3.375% 09/01/33	380,000.00	413,445.70
	SIGB 3.5% 03/01/27	650,000.00	709,299.50
	SIGB 3% 09/01/24	470,000.00	491,862.05
	シンガポールドル 小計	6,400,000.00	6,579,112.55 (536,592,419)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,170,300.00
	MGS 3.48% 03/15/23	1,500,000.00	1,476,645.00
	MGS 3.492% 03/31/20	1,200,000.00	1,203,108.00
	MGS 3.502% 05/31/27	670,000.00	634,587.15
	MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	955,225.00
	MGS 3.759% 03/15/19	200,000.00	201,368.00
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	802,423.00
	MGS 3.889% 07/31/20	1,350,000.00	1,364,870.25
	MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,174,230.00
	MGS 3.955% 09/15/25	50,000.00	49,908.50
	MGS 4.127% 04/15/32	1,080,000.00	1,034,650.80
	MGS 4.16% 07/15/21	1,800,000.00	1,836,900.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,650,000.00	1,673,009.25
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	577,974.00
	MGS 4.378% 11/29/19	2,450,000.00	2,495,619.00
	MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,683,618.75
	MGS 4.498% 04/15/30	1,900,000.00	1,908,350.50
	MGS 4.762% 04/07/37	400,000.00	407,608.00
MGS 4.935% 09/30/43	1,300,000.00	1,319,500.00	
MGS 5.248% 09/15/28	950,000.00	1,024,874.25	
	マレーシアリンギット 小計	23,960,000.00	23,994,769.45 (660,576,002)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	16,050,000.00	18,453,567.75
	SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,831,399.00
	SAGB 6.5% 02/28/41	6,900,000.00	5,190,870.00
	SAGB 6.75% 03/31/21	4,400,000.00	4,367,902.00
	SAGB 7.25% 01/15/20	5,280,000.00	5,325,724.80
	SAGB 7.75% 02/28/23	3,000,000.00	3,040,260.00
	SAGB 7% 02/28/31	8,840,000.00	7,722,226.20
	SAGB 8.25% 03/31/32	5,300,000.00	5,084,687.50
	SAGB 8.5% 01/31/37	8,400,000.00	7,990,038.00

	SAGB 8.75% 01/31/44	8,400,000.00	8,078,868.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	11,300,000.00	10,881,561.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,780,414.00	
	SAGB 8% 01/31/30	7,800,000.00	7,481,682.00	
	SAGB 9% 01/31/40	3,950,000.00	3,911,783.75	
	南アフリカランド 小計	102,720,000.00	98,140,984.00	(899,952,823)
	合計		137,674,514,736	(137,674,514,736)

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 163銘柄	100.0%	42.2%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 272銘柄	100.0%	41.7%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	7.2%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%

(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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DCバランスファンド30】

【純資産額計算書】

(平成30年 3月30日現在)

資産総額	16,538,975,276円
負債総額	4,547,868円
純資産総額(-)	16,534,427,408円
発行済口数	11,887,924,022口
1口当たり純資産額(/)	1.3909円
(1万口当たり純資産額)	(13,909円)

【DCバランスファンド50】

【純資産額計算書】

(平成30年 3月30日現在)

資産総額	16,950,518,099円
負債総額	11,857,053円
純資産総額(-)	16,938,661,046円
発行済口数	11,506,780,868口
1口当たり純資産額(/)	1.4721円
(1万口当たり純資産額)	(14,721円)

【DCバランスファンド70】

【純資産額計算書】

(平成30年 3月30日現在)

資産総額	6,547,148,258円
負債総額	5,648,293円
純資産総額(-)	6,541,499,965円
発行済口数	4,320,596,519口
1口当たり純資産額(/)	1.5140円
(1万口当たり純資産額)	(15,140円)

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	233,035,611,911円
負債総額	249,701,802円
純資産総額（ - ）	232,785,910,109円
発行済口数	130,351,977,469口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7858円
（1万口当たり純資産額）	（17,858円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	313,148,016,842円
負債総額	3,513,054,198円
純資産総額（ - ）	309,634,962,644円
発行済口数	227,921,457,267口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3585円
（1万口当たり純資産額）	（13,585円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	225,715,406,002円
負債総額	552,009,557円
純資産総額（ - ）	225,163,396,445円
発行済口数	91,284,408,774口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4666円
（1万口当たり純資産額）	（24,666円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	142,882,358,837円
負債総額	1,804,706,580円
純資産総額（ - ）	141,077,652,257円
発行済口数	60,820,191,358口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3196円
（1万口当たり純資産額）	（23,196円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成30年 3月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、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、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。

監査役の任期は、選任後4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。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、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、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、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、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用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、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

[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実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

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せています。

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コンプライアンス・リスク統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

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

さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は平成30年 5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。

平成30年3月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	506	9,835,881
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	65	231,485
単位型公社債投資信託	0	0
合計	571	10,067,366

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「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条及び第57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、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

す。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第32期事業年度の中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		16,534,066		20,260,630
前払費用		102,445		143,622
未収委託者報酬		5,528,610		5,252,944
繰延税金資産		121,367		61,677
その他		5,566		5,474
流動資産合計		22,292,056		25,724,348
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	55,487	1	47,993
器具備品	1	90,924	1	73,765
その他	1	3,748	1	2,830
有形固定資産合計		150,160		124,589
無形固定資産				
ソフトウェア		215,175		221,499
その他		5,886		6,656
無形固定資産合計		221,062		228,156
投資その他の資産				
投資有価証券		63,797		71,153
長期前払費用		8,021		9,828
長期貸付金		22,838		19,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		123,235		137,359
その他		235		145
貸倒引当金		22,838		19,838
投資その他の資産合計		220,289		243,485
固定資産合計		591,512		596,231
資産合計		22,883,569		26,320,580

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日現在）	当事業年度 （平成29年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
固定負債		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	68,500	71,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)		(自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		32,163,066		30,245,448
営業収益合計		32,163,066		30,245,448
営業費用				
支払手数料		14,102,687		12,880,325
広告宣伝費		126,914		95,688
公告費		2,765		3,094
調査費		6,758,898		6,239,223
調査費		331,886		360,520
委託調査費		6,425,175		5,876,937
図書費		1,836		1,766
営業雑経費		1,399,773		1,460,885
通信費		17,552		24,920
印刷費		349,902		370,785
協会費		26,659		30,665
諸会費		105		105
情報機器関連費		927,524		943,725
その他営業雑経費		78,029		90,684
営業費用合計		22,391,039		20,679,217
一般管理費				
給料		2,123,392		1,874,710
役員報酬		89,280		89,520
給料・手当		1,759,320		1,526,244
賞与		274,792		258,946
退職給付費用		73,742		76,106
福利費		222,276		221,018
交際費		6,004		5,612
旅費交通費		67,392		61,961
租税公課		73,989		106,691
不動産賃借料		125,339		113,697
減価償却費		126,985		134,710
業務委託費	1	209,510	1	486,690
諸経費		217,580		223,685
一般管理費合計		3,246,214		3,304,885
営業利益		6,525,812		6,261,346

(単位：千円)

前事業年度

当事業年度

（自 平成27年4月 1日
至 平成28年3月31日）

（自 平成28年4月 1日
至 平成29年3月31日）

営業外収益				
受取利息		8,092		4,669
収益分配金		2,026		129
投資有価証券売却益		350		307
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
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	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
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	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	評価・換算差額等
--	----------

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく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。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

(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、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28千円増加しております。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

注記事項

(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 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
建 物	54,302	千円	62,231	千円
器具備品	263,257	"	298,576	"
そ の 他	841	"	1,759	"
計	318,401	"	362,567	"

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
業務委託費	39,733	千円	39,286	千円
長期前払費用償却	27,866	"	4,644	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

決議	株式の 種類	配当金の総 額 (千円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年6月30日 定時株主総会	普通株 式	30,000	利益 剰余金	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
-------	---------	---------	---------	--------

普通株式（株）	3,000	-	-	3,000
---------	-------	---	---	-------

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

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

平成29年6月30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（千円）	配当金の原資	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については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、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きわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

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

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、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、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）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。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください。

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	16,534,066	16,534,066	-
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

（*）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。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	20,260,630	20,260,630	-
(2) 未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
(4) 未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
(5) 未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

（*）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。

（注1）金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

これらは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）投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

これらは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。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額（単位：千円）

区分	平成28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（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（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	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	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	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	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499

（有価証券関係）

1．その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

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	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

当事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

2．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
-----	---------	---------

12,699	307	604
--------	-----	-----

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（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．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
（1）退職給付債務	389,941	437,197
（2）退職給付引当金	389,941	437,197

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
（1）退職給付費用	73,742	76,106

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,434千円、当事業年度で14,321千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（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 （平成28年3月31日）		当事業年度 （平成29年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	86,931	千円	28,688	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,993	"	6,074	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,437	"	30,265	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	119,400	"	133,869	"
その他	7,674	"	6,972	"
繰延税金資産 合計	251,436	"	205,870	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	244,602	"	199,037	"

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。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（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 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,979,867千円

（注）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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,568,158千円

（注）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。

（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

重要性がないため、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

該当事項はありません。

（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 平成27年4月1日 至 平成28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（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	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	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

(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

投信販売代行手数料

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	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	投信販売代行手数料等の支払	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

(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

投信販売代行手数料

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

(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（平成28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（平成29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 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	5,848,968円06銭	7,282,436円46銭
1株当たり当期純利益金額	1,447,521円33銭	1,443,463円05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 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円

普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株
--------------	--------	--------

中間貸借対照表

(単位：千円)

		第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		22,430,598
未収委託者報酬		5,219,968
繰延税金資産		79,306
その他流動資産		138,600
流動資産合計		27,868,472
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	39,695
器具備品	1	74,492
その他有形固定資産	1	2,371
有形固定資産合計		116,559
無形固定資産		
投資その他の資産		220,928
投資有価証券		72,823
長期貸付金		18,588
会員権		25,000
その他の投資		6,424
繰延税金資産		144,499
貸倒引当金		18,588
投資その他の資産合計		248,747
固定資産合計		586,236
資産合計		28,454,709
負債の部		
流動負債		
未払金		2,893,700
未払費用		97,854
未払法人税等		958,933
賞与引当金		101,223
その他流動負債	2	126,412
流動負債合計		4,178,123
固定負債		
退職給付引当金		464,737
資産除去債務		13,260
その他固定負債		1,569
固定負債合計		479,568
負債合計		4,657,692

(単位：千円)

第32期中間会計期間末
（平成29年9月30日）

純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	74,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	20,972,132
利益剰余金合計	23,146,632
株主資本合計	23,796,632
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	384
評価・換算差額等合計	384
純資産合計	23,797,016
負債・純資産合計	28,454,709

中間損益計算書

（単位：千円）

第32期中間会計期間
（自 平成29年4月1日
至 平成29年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		14,889,835
営業収益合計		14,889,835
営業費用		10,297,526
一般管理費	1	1,725,338
営業利益		2,866,970
営業外収益	2	6,124
営業外費用		8,308
経常利益		2,864,786
税引前中間純利益		2,864,786
法人税、住民税及び事業税		912,037
法人税等調整額		25,439
法人税等合計		886,598
中間純利益		1,978,187

中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000

当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,978,187	1,978,187	1,978,187
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,945,187	1,948,187	1,948,187
当中間期末残高	74,500	2,100,000	20,972,132	23,146,632	23,796,632

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,978,187
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	1,519	1,519	1,519
当中間期変動額合計	1,519	1,519	1,949,707
当中間期末残高	384	384	23,797,016

重要な会計方針

<p>第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）</p>
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> その他有価証券</p> <p> 時価のあるもの</p> <p> 中間会計期間末日の市場価格等に基づく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。）</p> <p> 時価のないもの</p> <p> 移動平均法による原価法によっております。</p>

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

(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）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 60,917千円
	器具備品 309,829千円
	その他有形固定資産 2,218千円
	計 372,965千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第32期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 16,811千円
	無形固定資産 41,202千円

2 営業外収益の主要項目 受取利息	1,314千円
----------------------	---------

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

平成29年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	22,430,598	22,430,598	-
(2)未収委託者報酬	5,219,968	5,219,968	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	72,820	72,820	-
(4)未払金	(2,893,700)	(2,893,700)	-
(5)未払法人税等	(958,933)	(958,933)	-

(*)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。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金、並びに(5)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見

積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（３）投資
有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

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	20,229	18,356	1,872
小計	20,229	18,356	1,872
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	52,590	53,909	1,318
小計	52,590	53,909	1,318
合計	72,820	72,266	554

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること
などができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」に
は含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（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。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略し
ております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を
省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、
記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	1,564,703千円

（注）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。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	7,932,338円90銭
1株当たり中間純利益	659,395円97銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	1,978,187千円
普通株式に係る中間純利益	1,978,187千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

府令で定めるものを除きます。)。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成30年 5月21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（平成29年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成29年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成29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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

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平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第31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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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平成29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すべ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。

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

1. 上記は、当社が、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おりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年4月20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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

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の平成29年2月22日から平成30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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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の平成30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すべ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。

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

1. 上記は、当社が、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おりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年4月20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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

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の平成29年2月22日から平成30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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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の平成30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すべ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。

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

1. 上記は、当社が、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おりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年4月20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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

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の平成29年2月22日から平成30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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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の平成30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すべ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。

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

1. 上記は、当社が、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おりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月4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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤澤 孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知 明 印

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平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。