【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】	2020年7月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン
【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】	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】

ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
申込手数料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「（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。
※「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。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。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「(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。
「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

（7）【申込期間】

2020年 7月21日から2021年 1月20日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（9）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

＜申込みコース＞

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、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。

＜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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

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、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 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） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	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 （　　）

（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

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券
①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。
(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。
(5)資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。
①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]
(1)年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
(2)年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
(3)年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
(4)年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
(5)年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]
(1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
(2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

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

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

［為替ヘッジによる属性区分］
(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行な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。

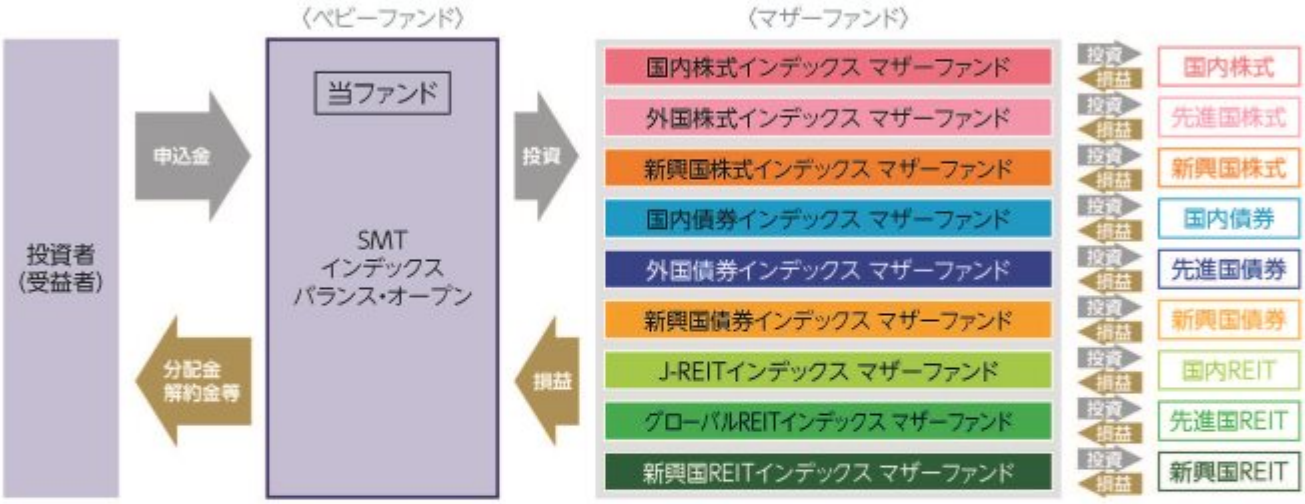
［特殊型］
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左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

特色1 世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及び不動産投資信託証券(REIT)に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●世界の株式、債券及びREITに分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
●各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)への連動を目指す運用を行います。
●原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ



? 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。

? DR(預託証券)とは

ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

? REITとは

REITは Real Estate Investment Trust の略称です。
REITは、投資者から集めた資金で、不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

ポートフォリオ構築プロセス

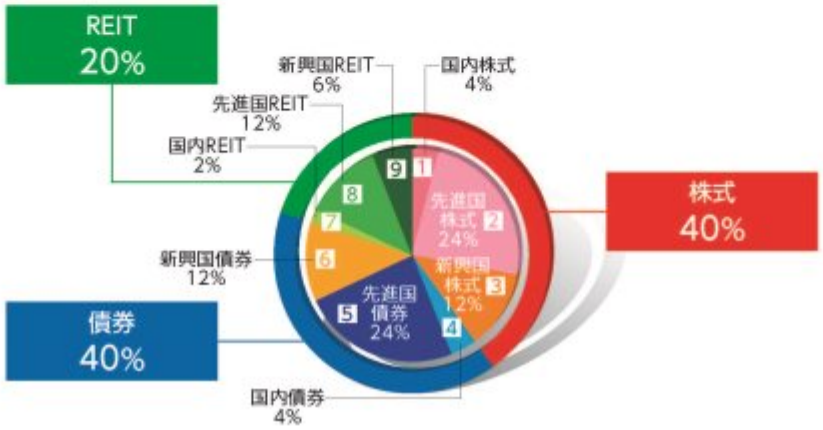
ファンドマネジャーは基本資産配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

ポートフォリオ構築	ファンドマネジャー	●基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分
リバランス実施	ファンドマネジャー	●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2 株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

基本資産配分比率
（2020年5月末現在）



●市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で資産配分比率を調整します。

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数) ※1
2 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(円ベース) ※2
3 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース) ※3
4 国内債券	NOMURA-BPI総合※4
5 先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) ※5
6 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース) ※6
7 国内REIT	東証REIT指数(配当込み) ※7
8 先進国REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) ※8
9 新興国REIT	S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース) ※9

＊資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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

※1 「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。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。

※2 「MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)」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。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(円換算ベース)」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。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。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。

※5 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」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。

※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るために、JPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

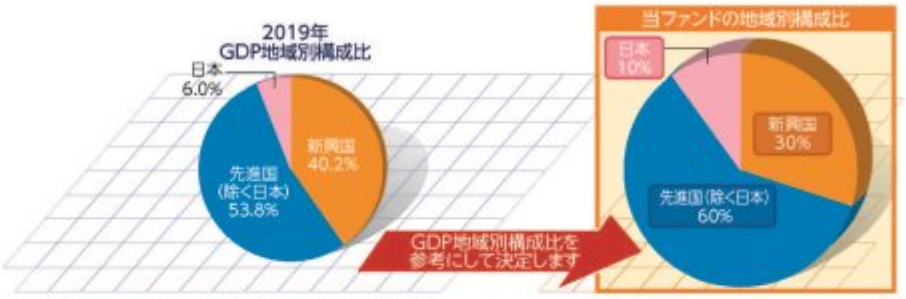
※7 「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※8 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

※9 「S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)」とは、SPDJIが公表する指数で、新興国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P新興国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるS&Pの登録商標で、Dow Jones®はDow Jonesの登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

特色3 世界経済全体の発展を享受します。

●地域別の基本組入比率は、地域別(国内、先進国及び新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定するものとします。また、基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
●地域別の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



(出所)IMF「世界経済見通し2019年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
※当ファンドの地域別構成比は、2020年5月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

分配方針

●年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
※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、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、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
●投資信託証券(REITを除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

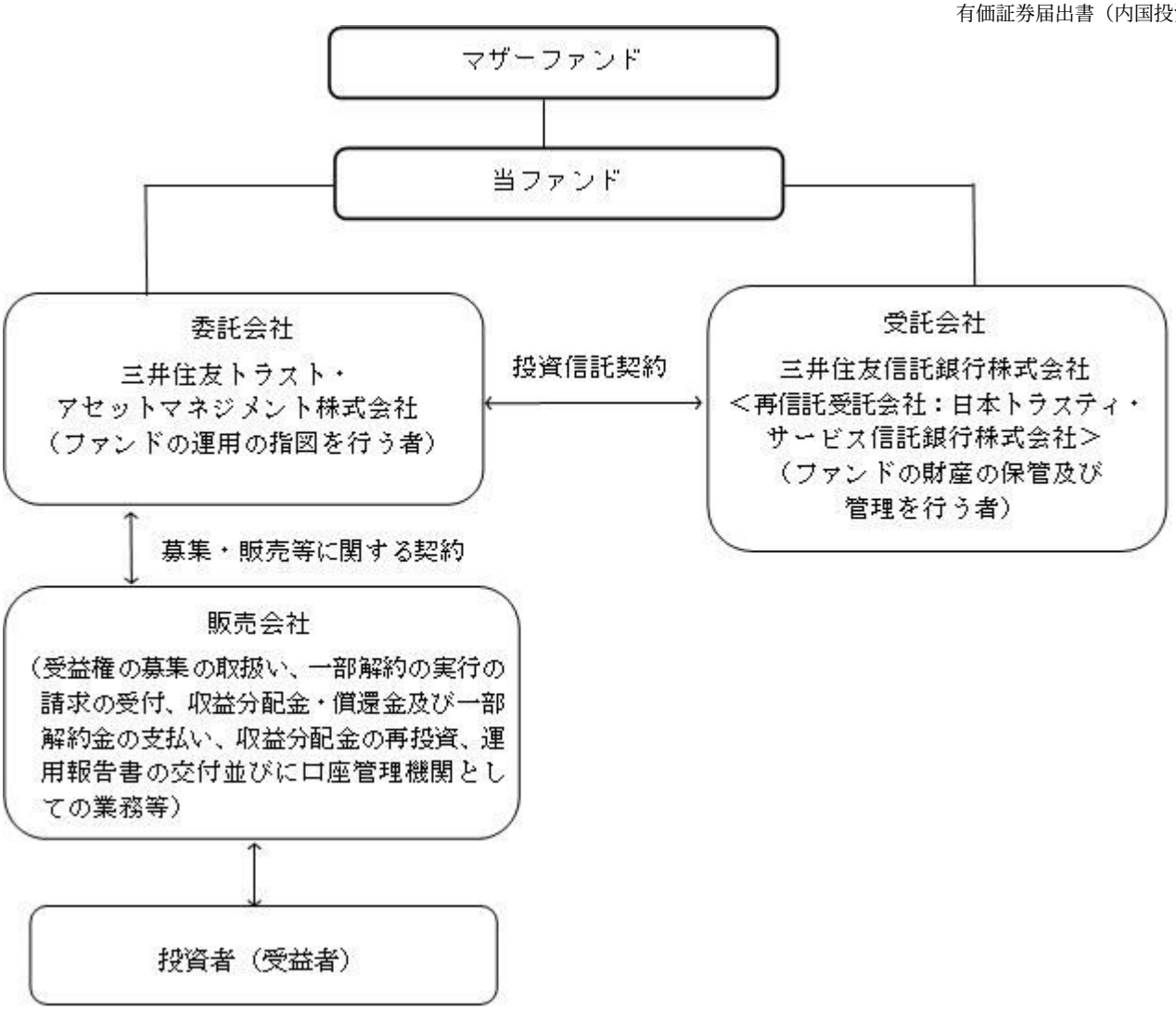
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2014年11月28日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でＪＴＣホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

②委託会社の概況（2020年 5月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株　主　名	**住　　所**	**持株数**	**持株比率**

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

②投資対象

「国内株式インデックス　マザーファンド」、「国内債券インデックス　マザーファンド」、「外国株式インデックス　マザーファンド」、「外国債券インデックス　マザーファンド」、「新興国株式インデックス　マザーファンド」、「新興国債券インデックス　マザーファンド」、「J-REITインデックス　マザーファンド」、「グローバルREITインデックス　マザーファンド」及び「新興国REITインデックス　マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。

③投資態度

イ．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。

ロ．株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。

ハ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

ニ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。

ホ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．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22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。）

3.金銭債権

4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

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「国内株式インデックス　マザーファンド」、「国内債券インデックス　マザーファンド」、「外国株式インデックス　マザーファンド」、「外国債券インデックス　マザーファンド」、「新興国株式インデックス　マザーファンド」、「新興国債券インデックス　マザーファンド」、「J-REITインデックス　マザーファンド」、「グローバルREITインデックス　マザーファンド」及び「新興国REITインデックス　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書
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規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
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.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10.コマーシャル・ペーパー
11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13.投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18.外国法人が発行する譲渡性預金証書
19.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22.外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券

のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

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

ロ．上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所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

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

３．運用制限

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

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2．運用方法

(1)投資対象

取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

(2)投資態度

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会社が適当

と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、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、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④一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投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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．運用制限

①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。
②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、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、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

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

は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

3．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（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の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資は行いません。

⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることと

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

⑥デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（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の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

⑤一般社団法人投資信託協会の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投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の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。

「新興国REITインデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場しているREITに投資し、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、新興国のREITに投資し、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②株式への投資は行いません。

③同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

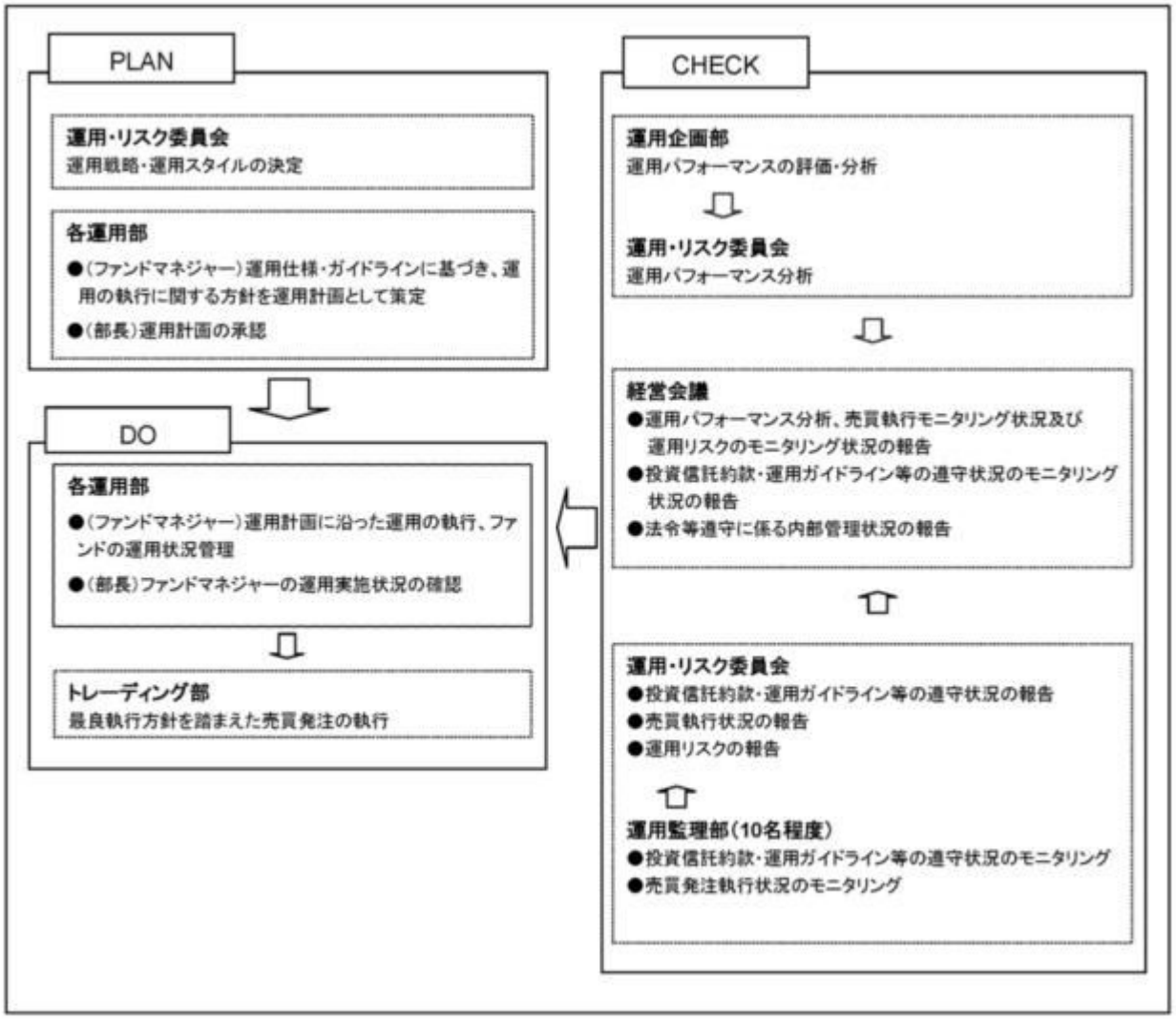
④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑥デリバティブ取引等（金融商品取引法第2 条第20 項に規定するものをいい、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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（３）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

・年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式等への投資割合

株式、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、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（REITを除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第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。

ホ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡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、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1.投資信託財産に属する株券及び新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券

6.投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等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委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

（ロ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等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を指図することができます。

（ハ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等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委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、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」といいます。）を行うことを指図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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。

（ロ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物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、為替先渡取引及び直物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、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付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、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

（ロ）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って必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公

社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り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）の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

（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投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）投資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投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．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。

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、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、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

（ハ）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。

（ニ）上記（ロ）においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資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（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヨ．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投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

タ．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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

＜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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済

情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

②リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

③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。

④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。

⑤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。

⑥カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑦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。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

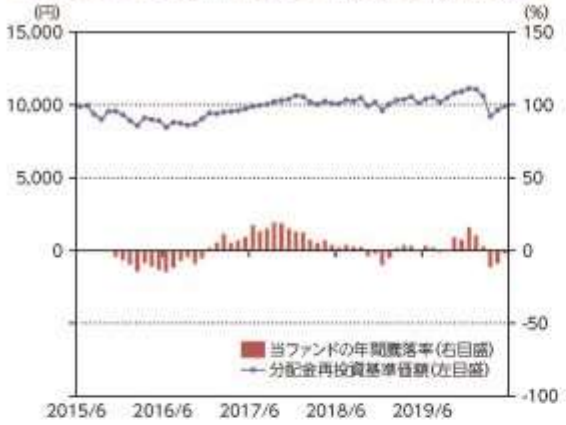
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

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。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

＊当ファンドについては2015年11月～2020年5月の4年7ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2015年6月～2020年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(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。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発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。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対

価として、販売会社に支払われます。

※1：「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（以下同じ。）。

②「分配金再投資コース」（※2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

③上記①及び②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、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【換金（解約）手数料】

＜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0.1%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。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　0.55%（税抜　0.5%）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.22%　（税抜　0.2%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.275%　（税抜　0.25%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.055%　（税抜　0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

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

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

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

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

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

※上記は、2020年 5月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2020年5月29日現在の状況について記載してあります。

【ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン】

（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	2,352,344,450	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	21,947,229	0.92
合計(純資産総額)		2,374,291,679	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	240,558,752	2.4327	585,207,276	2.5857	622,012,765	26.20
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス　マザーファンド	176,493,195	2.8792	508,159,208	2.9017	512,130,303	21.57
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	195,062,507	1.5188	296,260,936	1.5555	303,419,729	12.78
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	113,487,267	2.4223	274,900,207	2.4822	281,698,094	11.86
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス　マザーファンド	162,535,581	1.5335	249,248,314	1.6317	265,209,307	11.17
日本	親投資信託受益証券	新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	288,842,923	0.4440	128,246,258	0.4646	134,196,422	5.65
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス　マザーファンド	67,960,476	1.3527	91,930,136	1.4762	100,323,254	4.23
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス　マザーファンド	56,783,488	1.4123	80,195,321	1.4136	80,269,138	3.38
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	31,033,227	1.5914	49,386,278	1.7106	53,085,438	2.24

(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	99.08
合計	99.08

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2015年 4月20日)	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末 (2015年10月20日)	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末 (2016年 4月20日)	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
第4期計算期間末 (2016年10月20日)	2,640,506,750	2,640,506,750	8,729	8,729
第5期計算期間末 (2017年 4月20日)	3,071,863,389	3,071,863,389	9,344	9,344
第6期計算期間末 (2017年10月20日)	3,210,063,471	3,210,063,471	10,386	10,386
第7期計算期間末 (2018年 4月20日)	3,051,290,712	3,051,290,712	10,234	10,234
第8期計算期間末 (2018年10月22日)	2,916,459,886	2,916,459,886	10,043	10,043
第9期計算期間末 (2019年 4月22日)	2,897,788,604	2,897,788,604	10,631	10,631
第10期計算期間末 (2019年10月21日)	2,862,769,922	2,862,769,922	10,703	10,703
第11期計算期間末 (2020年 4月20日)	2,311,876,858	2,311,876,858	9,578	9,578
2019年 5月末日	2,773,679,924	—	10,128	—
6月末日	2,841,714,220	—	10,401	—
7月末日	2,842,745,579	—	10,540	—
8月末日	2,764,698,690	—	10,206	—
9月末日	2,815,131,800	—	10,495	—
10月末日	2,860,844,316	—	10,815	—
11月末日	2,801,242,949	—	10,926	—
12月末日	2,791,462,192	—	11,140	—
2020年 1月末日	2,733,220,352	—	11,085	—
2月末日	2,601,659,514	—	10,604	—
3月末日	2,221,181,429	—	9,220	—
4月末日	2,319,707,604	—	9,655	—
5月末日	2,374,291,679	—	9,943	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	0
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	0

第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	0
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	0
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	0
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	0
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	0
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	0
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	0.1
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	△5.0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	△5.1
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	△3.3
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	7.0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	11.2
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	△1.5
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	△1.9
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	5.9
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0.7
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	△10.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	602,284,502	175,969,377	3,025,061,973
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	856,851,109	594,236,350	3,287,676,732
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	584,835,788	781,663,341	3,090,849,179
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	473,012,411	582,449,995	2,981,411,595
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	199,195,642	276,588,300	2,904,018,937
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	166,800,463	345,148,199	2,725,671,201
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	156,918,897	207,929,245	2,674,660,853

第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	163,015,795	423,953,521	2,413,723,127

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	304,033,610,080	97.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	9,414,455,407	3.00
合計(純資産総額)		313,448,065,487	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	5,440,910,000	1.74

(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	1,544,900	6,649.46	10,272,750,754	6,755.00	10,435,799,500	3.33

日本	株式	ソニー	電気機器	867,400	5,513.11	4,782,071,614	6,874.00	5,962,507,600	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	125,500	31,705.75	3,979,071,625	44,350.00	5,565,925,000	1.78
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,078,100	5,085.89	5,483,098,009	4,832.00	5,209,379,200	1.66
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,152,000	3,802.62	4,380,618,240	4,191.00	4,828,032,000	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,816,300	2,470.05	4,486,351,815	2,444.00	4,439,037,200	1.42
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	9,341,800	503.35	4,702,195,030	444.20	4,149,627,560	1.32
日本	株式	第一三共	医薬品	396,200	5,656.36	2,241,049,832	10,085.00	3,995,677,000	1.27
日本	株式	任天堂	その他製品	84,900	38,898.05	3,302,444,445	43,540.00	3,696,546,000	1.18
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	947,900	3,564.59	3,378,874,861	3,710.00	3,516,709,000	1.12
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,012,600	2,818.55	2,854,063,730	3,136.00	3,175,513,600	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,090,200	2,730.70	2,977,009,140	2,784.00	3,035,116,800	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	944,500	3,725.75	3,518,970,875	3,119.00	2,945,895,500	0.94
日本	株式	信越化学工業	化学	232,800	9,592.86	2,233,217,808	12,620.00	2,937,936,000	0.94
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	971,600	2,630.93	2,556,211,588	2,951.50	2,867,677,400	0.91
日本	株式	花王	化学	331,500	8,540.00	2,831,010,000	8,647.00	2,866,480,500	0.91
日本	株式	ダイキン工業	機械	176,400	13,758.70	2,427,034,680	15,850.00	2,795,940,000	0.89
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	276,500	8,114.00	2,243,521,000	10,110.00	2,795,415,000	0.89
日本	株式	ファナック	電気機器	131,600	18,268.61	2,404,149,076	19,215.00	2,528,694,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,556,600	153.19	2,842,685,554	134.50	2,495,862,700	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	406,800	4,775.03	1,942,482,204	6,015.00	2,446,902,000	0.78
日本	株式	三菱商事	卸売業	957,000	2,793.39	2,673,274,230	2,515.00	2,406,855,000	0.77
日本	株式	ＳＭＣ	機械	43,400	38,414.11	1,667,172,374	54,370.00	2,359,658,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	665,300	3,777.13	2,512,924,589	3,455.00	2,298,611,500	0.73
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,200,500	1,550.34	1,861,183,170	1,914.50	2,298,357,250	0.73
日本	株式	中外製薬	医薬品	144,400	7,700.00	1,111,880,000	15,890.00	2,294,516,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	482,800	5,517.56	2,663,877,968	4,668.00	2,253,710,400	0.72
日本	株式	日本電産	電気機器	333,300	6,814.38	2,271,232,854	6,622.00	2,207,112,600	0.70
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	953,800	2,042.17	1,947,821,746	2,310.00	2,203,278,000	0.70

日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	140,700	13,590.79	1,912,224,153	15,615.00	2,197,030,500	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.21
		建設業	2.54
		食料品	3.87
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.02
		医薬品	6.93
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.53
		機械	4.96
		電気機器	14.10
		輸送用機器	7.07
		精密機器	2.54
		その他製品	2.31
		電気・ガス業	1.55
		陸運業	4.21
		海運業	0.13
		空運業	0.36
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	9.26
		卸売業	4.51
		小売業	4.79

		銀行業	4.93
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	2.00
		その他金融業	1.11
		不動産業	2.04
		サービス業	5.22
		小計	97.00
合計			97.00

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	349	円	5,090,025,750	5,440,910,000	1.74

(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。

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	454,188,617,800	84.08
地方債証券	日本	28,860,716,530	5.34
特殊債券	日本	37,009,791,304	6.85
社債券	日本	20,057,528,090	3.71
	フランス	1,887,916,000	0.35
	オーストラリア	398,256,000	0.07
	アメリカ	204,640,000	0.04
	イギリス	99,821,000	0.02
	小計	22,648,161,090	4.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	△2,547,983,581	△0.47

合計(純資産総額)	540,159,303,143	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	9,420,000,000	101.37	9,549,054,000	100.91	9,505,816,200	0.100	2023/12/20	1.76
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	101.97	7,444,538,800	100.99	7,372,854,000	0.100	2024/6/20	1.36
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	6,940,000,000	102.47	7,111,793,200	101.42	7,039,172,600	0.100	2026/9/20	1.30
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,900,000,000	101.57	7,008,870,600	100.86	6,959,547,000	0.100	2023/9/20	1.29
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	102.83	6,498,856,000	0.400	2025/9/20	1.20
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	6,380,000,000	102.30	6,527,242,000	101.31	6,463,833,200	0.100	2026/3/20	1.20
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	6,050,000,000	101.33	6,131,015,300	101.07	6,115,098,000	0.100	2024/12/20	1.13
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	6,050,000,000	101.27	6,127,353,300	100.67	6,091,079,500	0.100	2022/12/20	1.13
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	6,020,000,000	101.36	6,101,914,500	101.03	6,082,547,800	0.100	2024/9/20	1.13
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	5,790,000,000	102.64	5,943,420,000	101.53	5,878,702,800	0.100	2028/3/20	1.09
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	5,230,000,000	103.97	5,437,631,000	102.72	5,372,308,300	0.400	2025/6/20	0.99
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,200,000,000	102.04	5,306,291,800	101.47	5,276,596,000	0.100	2027/3/20	0.98
日本	国債証券	第１３１回利付国債（５年）	4,990,000,000	100.81	5,030,419,000	100.46	5,013,403,100	0.100	2022/3/20	0.93
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	4,940,000,000	103.04	5,090,176,000	101.22	5,000,515,000	0.100	2029/6/20	0.93
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,840,000,000	102.98	4,984,232,000	101.50	4,912,987,200	0.100	2027/9/20	0.91
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	100.89	4,812,641,300	100.54	4,795,996,500	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	101.81	4,652,899,800	1.000	2021/12/20	0.86
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,470,000,000	102.03	4,560,741,000	101.37	4,531,462,500	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	4,380,000,000	101.50	4,445,702,600	100.95	4,421,829,000	0.100	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	100.98	4,422,924,000	100.61	4,406,805,600	0.100	2022/9/20	0.82
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,190,000,000	102.48	4,294,243,000	101.46	4,251,257,800	0.100	2028/9/20	0.79
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	3,630,000,000	118.35	4,296,170,400	116.85	4,241,655,000	1.400	2034/9/20	0.79
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	4,140,000,000	101.20	4,189,680,000	100.82	4,174,279,200	0.100	2023/6/20	0.77

日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	101.13	4,126,104,000	100.75	4,110,967,200	0.100	2023/3/20	0.76
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	3,780,000,000	102.09	3,859,367,000	101.28	3,828,421,800	0.100	2029/3/20	0.71
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	3,680,000,000	101.17	3,723,095,000	100.98	3,716,064,000	0.100	2030/3/20	0.69
日本	国債証券	第４０３回利付国債（２年）	3,690,000,000	100.80	3,719,520,000	100.30	3,701,402,100	0.100	2021/8/1	0.69
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	3,590,000,000	102.46	3,678,361,000	101.49	3,643,814,100	0.100	2028/6/20	0.67
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	3,040,000,000	120.47	3,662,515,000	118.09	3,589,966,400	1.500	2034/6/20	0.66
日本	国債証券	第３２８回利付国債（１０年）	3,400,000,000	102.92	3,499,313,600	102.15	3,473,134,000	0.600	2023/3/20	0.64

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.08
地方債証券	5.34
特殊債券	6.85
社債券	4.19
合計	100.47

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	254,505,201,751	63.67
	イギリス	18,507,271,674	4.63
	スイス	14,386,421,318	3.60
	カナダ	13,094,934,735	3.28
	フランス	12,896,893,882	3.23
	ドイツ	11,364,426,752	2.84
	オーストラリア	7,628,043,418	1.91

	オランダ	6,940,539,900	1.74
	アイルランド	6,906,875,288	1.73
	スウェーデン	3,450,794,636	0.86
	スペイン	3,231,493,576	0.81
	香港	3,059,266,855	0.77
	デンマーク	2,960,638,571	0.74
	イタリア	2,252,059,469	0.56
	フィンランド	1,607,581,240	0.40
	シンガポール	1,354,256,213	0.34
	バミューダ	1,226,063,235	0.31
	ベルギー	1,112,714,780	0.28
	ジャージー	858,084,757	0.21
	イスラエル	841,269,775	0.21
	ケイマン	740,025,368	0.19
	ノルウェー	728,511,672	0.18
	ニュージーランド	396,371,714	0.10
	ルクセンブルク	298,353,686	0.07
	キュラソー	267,229,835	0.07
	オーストリア	230,538,439	0.06
	ポルトガル	228,087,020	0.06
	リベリア	85,007,272	0.02
	パナマ	79,011,665	0.02
	マン島	63,970,577	0.02
	パプアニューギニア	29,069,333	0.01
	英ヴァージン諸島	20,325,793	0.01
	小計	371,351,334,199	92.90
投資信託受益証券	オーストラリア	184,952,012	0.05
	香港	82,262,137	0.02
	小計	267,214,149	0.07
投資証券	アメリカ	8,151,318,634	2.04
	オーストラリア	525,807,975	0.13
	フランス	235,307,663	0.06
	イギリス	208,690,938	0.05
	シンガポール	175,055,387	0.04
	香港	157,327,410	0.04
	カナダ	80,798,481	0.02
	小計	9,534,306,488	2.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	18,572,211,962	4.65
合計(純資産総額)		399,725,066,798	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	11,662,722,080	2.92
	買建	カナダ	617,886,006	0.15
	買建	ドイツ	2,716,486,651	0.68
	買建	イギリス	1,022,834,732	0.26
	買建	オーストラリア	584,955,840	0.15

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	391,540,500	0.10
	売建	—	1,827,840,000	△0.46

(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	424,286	19,900.10	8,443,337,009	34,221.42	14,519,670,467	3.63
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	692,070	13,879.74	9,605,756,436	19,505.94	13,499,477,280	3.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	40,314	198,001.10	7,982,216,684	258,190.28	10,408,683,069	2.60
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	229,762	19,631.15	4,510,494,367	24,243.71	5,570,284,170	1.39
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	29,486	122,379.94	3,608,495,025	152,340.97	4,491,926,045	1.12
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,573	123,043.11	3,515,710,882	152,503.34	4,357,478,140	1.09
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	251,260	14,630.78	3,676,130,836	15,803.68	3,970,833,667	0.99

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	163,330	17,668.86	2,885,855,384	20,888.77	3,411,764,078	0.85
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	283,950	11,073.88	3,144,428,344	11,468.71	3,256,542,135	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	300,112	11,545.68	3,465,000,097	10,737.94	3,222,586,390	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	237,820	11,352.52	2,699,857,555	12,479.93	2,967,977,381	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	90,353	25,929.66	2,342,822,933	32,685.89	2,953,268,590	0.74
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	85,613	27,409.48	2,346,608,269	32,506.31	2,782,963,489	0.70
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	104,694	20,681.69	2,165,249,788	26,359.90	2,759,723,810	0.69
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	414,846	4,802.91	1,992,471,510	6,634.60	2,752,337,686	0.69
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	67,131	30,377.45	2,039,268,911	38,056.19	2,554,750,762	0.64
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	125,861	21,370.08	2,689,659,691	19,903.80	2,505,112,549	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	394,419	6,272.31	2,473,920,076	5,991.57	2,363,189,679	0.59
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	696,675	3,439.23	2,396,027,524	3,339.88	2,326,812,153	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	821,173	2,948.16	2,420,956,621	2,673.19	2,195,156,215	0.55
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	527,795	4,378.79	2,311,104,952	4,105.49	2,166,859,945	0.54
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	171,900	13,993.07	2,405,409,563	12,554.12	2,158,054,517	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	242,811	8,588.73	2,085,439,997	8,499.17	2,063,692,258	0.52
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	55,452	16,495.50	914,708,736	36,504.28	2,024,235,579	0.51
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	404,599	5,675.51	2,296,305,694	4,902.83	1,983,680,256	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	388,189	5,269.35	2,045,506,135	5,063.58	1,965,629,046	0.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	403,535	7,514.25	3,032,265,196	4,843.15	1,954,381,019	0.49
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	205,324	9,770.67	2,006,154,145	9,298.53	1,909,212,934	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	132,991	13,709.97	1,823,303,328	14,225.14	1,891,816,086	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	46,170	30,165.36	1,392,734,791	40,843.11	1,885,726,846	0.47

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	3.57
		素材	4.02
		資本財	5.94
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	1.04
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.48
		メディア・娯楽	6.35
		小売	5.52
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.52
		家庭用品・パーソナル用品	2.08
		ヘルスケア機器・サービス	5.18
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.74
		銀行	5.50
		各種金融	4.10
		保険	3.02
		不動産	0.46
		ソフトウェア・サービス	11.03
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.11
		電気通信サービス	2.10
		公益事業	3.43
		半導体・半導体製造装置	3.54
		小計	92.90
投資信託受益証券	—	—	0.07
投資証券	—	—	2.39
合計			95.35

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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（%）
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	714	アメリカドル	97,490,640.5	10,483,168,573	108,460,170	11,662,722,080	2.92

株価指数先物取引	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	43	カナダドル	7,225,405.5	563,653,883	7,920,600	617,886,006	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	58	スイスフラン	5,461,276	609,041,499	5,762,880	642,676,377	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	563	ユーロ	15,649,303.5	1,864,301,525	17,407,960	2,073,810,274	0.52
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	56	オーストラリアドル	7,251,842	517,418,927	8,198,400	584,955,840	0.15
	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	124	イギリスポンド	7,064,690	936,283,365	7,717,760	1,022,834,732	0.26

(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	2,640,000.00	284,882,400	283,852,800	0.07
	ユーロ	買建	370,000.00	44,027,410	44,078,100	0.01
	イギリスポンド	買建	480,000.00	63,534,240	63,609,600	0.02
	アメリカドル	売建	17,000,000.00	1,827,840,000	1,827,840,000	△0.46

(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。

外国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	123,793,130,163	44.83
	フランス	26,723,420,939	9.68
	イタリア	24,157,538,281	8.75
	ドイツ	19,733,645,443	7.15
	イギリス	17,809,166,953	6.45
	スペイン	15,914,219,064	5.76
	ベルギー	6,716,910,728	2.43
	オーストラリア	5,550,816,381	2.01
	カナダ	5,259,580,632	1.90
	オランダ	5,146,805,020	1.86
	オーストリア	4,070,753,564	1.47

	メキシコ	2,156,705,226	0.78
	アイルランド	2,036,942,207	0.74
	ポーランド	1,650,199,823	0.60
	フィンランド	1,536,409,804	0.56
	デンマーク	1,368,613,306	0.50
	マレーシア	1,336,319,048	0.48
	シンガポール	1,225,821,018	0.44
	イスラエル	1,039,070,414	0.38
	スウェーデン	778,291,358	0.28
	ノルウェー	679,335,982	0.25
	小計	268,683,695,354	97.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	7,485,354,323	2.71
合計(純資産総額)		276,169,049,677	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	2,570,598,758	0.93
	買建	ドイツ	3,130,786,434	1.13

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

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

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	―	5,894,295,300	2.13

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)

アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	15,010,000	11,226.13	1,685,042,413	12,376.87	1,857,768,347	2.375	2029/5/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	10,541.89	1,544,387,769	11,692.20	1,712,908,375	1.625	2029/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,903.37	1,362,921,754	11,690.52	1,461,315,898	2.375	2024/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	10,790,000	9,912.11	1,069,517,252	12,640.65	1,363,926,739	2.250	2046/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	12,150,000	10,599.68	1,287,861,820	11,130.61	1,352,369,739	1.625	2022/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.75% 09/15/21	12,000,000	10,957.62	1,314,915,550	11,110.45	1,333,254,392	2.750	2021/9/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	10,050,000	10,333.63	1,038,530,116	13,221.98	1,328,809,960	2.500	2046/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	9,300,000	11,123.97	1,034,530,001	14,055.34	1,307,147,286	2.875	2045/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	10,200,000	10,774.52	1,099,001,978	12,797.75	1,305,370,516	2.250	2049/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	10,988.49	1,181,262,751	12,119.80	1,302,879,270	2.375	2027/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	11,321.83	1,131,051,187	12,574.28	1,256,171,509	2.625	2029/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	10,902.53	1,199,278,730	11,087.56	1,219,631,721	2.750	2021/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	10,616.06	1,084,962,079	11,785.03	1,204,430,674	2.000	2026/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,834.48	1,099,700,493	11,675.82	1,185,096,317	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/48	7,300,000	12,227.23	892,588,249	15,655.69	1,142,865,803	3.375	2048/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.125% 09/30/21	10,300,000	10,762.66	1,108,554,075	11,032.32	1,136,329,572	2.125	2021/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	11,305.70	1,008,468,815	12,717.10	1,134,365,557	2.875	2028/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	8,500,000	10,341.16	878,998,609	13,206.02	1,122,512,391	2.500	2046/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,954.08	1,095,408,110	11,222.60	1,122,260,373	2.000	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,804.61	1,080,461,440	11,065.92	1,106,592,907	1.500	2022/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/15/21	10,000,000	10,931.11	1,093,111,022	11,026.86	1,102,686,547	2.625	2021/6/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,541.72	1,054,172,032	10,916.18	1,091,618,516	1.250	2021/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	11,541.19	969,460,372	12,980.88	1,090,394,524	3.125	2028/11/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	12,932.49	1,097,969,066	12,720.28	1,079,952,149	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	10,795.84	966,228,041	11,993.79	1,073,444,691	2.250	2027/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,542.98	1,033,212,086	10,862.63	1,064,537,756	1.125	2021/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,654.71	1,017,524,891	11,090.71	1,059,162,938	1.750	2022/5/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,663.53	1,018,367,277	11,062.77	1,056,495,372	1.750	2022/3/31	0.38
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000	20,582.39	994,129,832	21,479.61	1,037,465,430	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	10,780.72	921,751,785	12,061.84	1,031,287,467	2.250	2027/8/15	0.37

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.29
合計	97.29

(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	72	アメリカドル	9,028,796.1	970,866,444	9,028,687.68	970,854,786	0.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	46	アメリカドル	6,379,512.28	685,988,956	6,378,187.5	685,846,502	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	48	アメリカドル	8,512,723.25	915,373,131	8,499,000	913,897,470	0.33
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	36	ユーロ	4,035,919	480,799,030	4,032,720	480,417,933	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	45	ユーロ	6,079,500	724,250,835	6,075,000	723,714,750	0.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	94	ユーロ	16,184,546	1,928,064,965	16,172,700	1,926,653,751	0.70

(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	25,840,000.00	2,772,547,151	2,777,800,000	1.01
	カナダドル	買建	3,290,000.00	252,780,172	256,554,200	0.09
	ユーロ	買建	20,470,000.00	2,400,971,147	2,438,591,100	0.88
	イギリスポンド	買建	3,180,000.00	418,933,676	421,350,000	0.15

(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。

新興国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	ケイマン	13,065,941,272	20.83
	中国	7,957,051,901	12.68
	台湾	7,407,938,749	11.81
	韓国	7,199,274,094	11.48
	インド	4,847,009,893	7.73
	ブラジル	2,944,920,105	4.69
	南アフリカ	2,304,508,055	3.67
	ロシア	2,162,420,312	3.45
	サウジアラビア	1,692,188,631	2.70

	香港	1,682,204,883	2.68
	タイ	1,445,629,711	2.30
	メキシコ	1,117,000,082	1.78
	マレーシア	1,110,596,005	1.77
	インドネシア	937,368,520	1.49
	カタール	565,103,755	0.90
	バミューダ	514,096,452	0.82
	フィリピン	482,935,309	0.77
	ポーランド	462,417,176	0.74
	チリ	371,131,702	0.59
	アラブ首長国連邦	357,288,602	0.57
	トルコ	272,476,193	0.43
	アメリカ	226,645,124	0.36
	ハンガリー	154,148,616	0.25
	ギリシャ	136,540,123	0.22
	コロンビア	129,585,737	0.21
	ルクセンブルク	77,681,997	0.12
	エジプト	71,954,033	0.11
	チェコ	71,518,943	0.11
	ジャージー	58,333,013	0.09
	アルゼンチン	42,706,270	0.07
	シンガポール	20,803,266	0.03
	マン島	17,794,032	0.03
	パキスタン	14,987,850	0.02
	ペルー	14,654,887	0.02
	スペイン	5,640,885	0.01
	小計	59,942,496,178	95.55
投資信託受益証券	ブラジル	118,362,835	0.19
	メキシコ	26,595,103	0.04
	小計	144,957,938	0.23
投資証券	南アフリカ	43,266,711	0.07
	メキシコ	26,016,994	0.04
	小計	69,283,705	0.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,579,684,186	4.11
合計(純資産総額)		62,736,422,007	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	2,633,615,082	4.20

(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	—	178,374,000	0.28

(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(%)
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	185,886	20,516.23	3,813,680,774	21,451.15	3,987,470,272	6.36
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	612,600	4,639.60	2,842,221,902	5,661.73	3,468,378,248	5.53
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,632,389	1,093.96	2,879,739,389	1,052.51	2,770,642,070	4.42
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	510,272	4,544.77	2,319,072,040	4,379.76	2,234,868,895	3.56
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,216,620	89.68	916,326,263	85.71	875,733,930	1.40
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	47,573	13,541.59	644,214,071	17,987.63	855,725,579	1.36
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	306,633	2,028.80	622,098,836	2,105.31	645,559,821	1.03
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	605,500	1,294.30	783,704,230	1,061.05	642,468,803	1.02
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	654,500	890.88	583,081,906	750.36	491,115,202	0.78
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,988,515	80.68	563,864,404	69.76	487,561,436	0.78
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	78,907	3,645.11	287,624,884	5,486.18	432,898,053	0.69
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	58,170	7,223.49	420,190,707	7,290.91	424,112,235	0.68
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	177,443	3,147.82	558,559,811	2,321.89	412,003,305	0.66
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	46,044	10,066.34	463,494,905	8,226.04	378,760,016	0.60
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	365,523	1,012.17	369,972,921	1,011.58	369,756,487	0.59
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	289,100	1,587.15	458,847,829	1,255.95	363,095,261	0.58

台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,333,248	320.56	427,394,269	269.57	359,408,996	0.57
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	592,047	864.06	511,568,778	593.13	351,164,081	0.56
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,635,200	45.68	394,499,475	39.52	341,345,138	0.54
ブラジル	株式	VALE SA	素材	340,278	970.07	330,094,446	995.28	338,674,712	0.54
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	29,357	13,343.60	391,728,305	11,432.58	335,626,533	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	87,965	3,738.93	328,895,572	3,780.15	332,520,895	0.53
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	14,853	14,357.10	213,246,063	20,899.45	310,419,531	0.49
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	7,551	32,475.95	245,225,947	39,382.86	297,379,995	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	96,664	3,014.17	291,362,019	2,866.14	277,053,427	0.44
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	160,804	1,461.26	234,976,851	1,646.79	264,812,027	0.42
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,625,440	73.47	266,374,047	72.98	264,610,714	0.42
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	487,496	567.90	276,853,673	519.79	253,396,521	0.40
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	87,189	3,118.66	271,913,625	2,874.22	250,601,109	0.40
ロシア	株式	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	素材	73,003	3,107.82	226,880,408	3,419.45	249,630,400	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	6.21
		素材	6.88
		資本財	2.86
		商業・専門サービス	0.32
		運輸	1.54
		自動車・自動車部品	1.81
		耐久消費財・アパレル	1.17
		消費者サービス	1.41
		メディア・娯楽	8.44
		小売	10.43
		食品・生活必需品小売り	1.52
		食品・飲料・タバコ	3.62
		家庭用品・パーソナル用品	1.20
		ヘルスケア機器・サービス	1.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.53

		銀行	14.24
		各種金融	1.96
		保険	3.27
		不動産	2.45
		ソフトウェア・サービス	1.84
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.74
		電気通信サービス	4.15
		公益事業	2.32
		半導体・半導体製造装置	6.47
		小計	95.55
投資信託受益証券	—	—	0.23
投資証券	—	—	0.11
合計			95.89

(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	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	534	アメリカドル	23,864,798	2,566,181,729	24,491,910	2,633,615,082	4.20

(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	950,000.00	102,514,500	102,144,000	0.16
	香港ドル	買建	5,500,000.00	76,285,000	76,230,000	0.12

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

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

新興国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	メキシコ	5,765,429,523	10.07
	インドネシア	5,527,298,716	9.66
	ブラジル	5,358,905,282	9.36
	タイ	5,159,640,937	9.01
	ポーランド	4,960,528,160	8.67
	ロシア	4,944,168,519	8.64
	南アフリカ	4,099,023,456	7.16
	マレーシア	3,752,209,964	6.56
	コロンビア	3,243,208,269	5.67
	チェコ	2,570,674,251	4.49
	ハンガリー	2,059,181,127	3.60
	ペルー	2,050,927,715	3.58
	トルコ	1,642,029,617	2.87
	チリ	1,423,884,953	2.49
	フィリピン	108,930,423	0.19
	ウルグアイ	77,493,371	0.14
	ドミニカ共和国	74,407,159	0.13
	小計	52,817,941,442	92.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,417,804,573	7.72
合計(純資産総額)		57,235,746,015	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（%）
為替予約取引	買建	—	8,851,745	0.02
	売建	—	8,761,133	△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	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(%)

コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	89,700,000,000	3.65	3,275,264,776	3.61	3,243,208,269	9.850	2027/6/28	5.67
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	47,100,000	2,229.15	1,049,932,437	2,253.75	1,061,519,132	10.000	2023/1/1	1.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	48,550,000	1,617.28	785,193,668	1,715.41	832,835,164	0.000	2023/7/1	1.46
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000	2,298.49	810,220,810	2,305.24	812,598,601	10.000	2025/1/1	1.42
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	108,700,000	682.97	742,397,801	704.43	765,718,627	10.500	2026/12/21	1.34
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	144,200,000	411.68	593,648,328	423.08	610,090,632	3.400	2036/6/17	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	106,000,000	546.58	579,375,497	561.69	595,400,876	8.500	2029/5/31	1.04
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	112,900,000	506.45	571,784,510	526.14	594,014,183	8.000	2023/12/7	1.04
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000	0.78	572,614,324	0.78	567,226,051	8.375	2024/3/15	0.99
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,743.83	546,023,065	2,832.23	563,613,891	2.500	2023/1/25	0.98
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000	2,367.64	567,050,964	2,325.78	557,025,952	10.000	2027/1/1	0.97
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	1,784.89	509,588,905	1,888.75	539,240,055	0.000	2022/1/1	0.94
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	487.19	527,149,891	496.79	537,531,692	6.500	2022/6/9	0.94
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000	1,734.71	477,914,120	1,837.66	506,277,646	0.000	2022/7/1	0.88
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	16,250,000	2,897.28	470,808,842	3,002.67	487,934,599	4.000	2023/10/25	0.85
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000	502.99	463,511,736	528.51	487,027,402	7.500	2027/6/3	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000	2,747.91	449,284,189	2,959.94	483,951,261	2.500	2027/7/25	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000	2,749.16	452,237,973	2,941.30	483,844,240	2.500	2026/7/25	0.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	24,650,000	1,847.87	455,500,645	1,930.50	475,868,508	0.000	2021/7/1	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	111,800,000	415.42	464,441,745	424.27	474,338,891	3.300	2038/6/17	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	405.90	463,948,500	414.05	473,268,808	3.650	2031/6/20	0.83
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	552.20	454,188,843	572.59	470,960,375	10.000	2024/12/5	0.82
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	79,050,000	570.10	450,670,374	579.44	458,050,071	8.000	2030/1/31	0.80
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	538.64	481,007,949	504.72	450,720,104	8.750	2048/2/28	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000	433.11	439,176,785	440.17	446,338,170	4.875	2029/6/22	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000	2,753.10	411,588,733	2,882.79	430,977,165	2.500	2024/4/25	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000	490.02	403,777,099	498.95	411,139,415	7.250	2021/12/9	0.72
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000	0.80	407,648,776	0.79	400,079,483	8.375	2026/9/15	0.70
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	13,050,000	2,850.50	371,991,072	3,064.54	399,922,606	2.750	2029/10/25	0.70
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000	2,855.69	378,380,177	3,015.22	399,517,205	3.250	2025/7/25	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）

国債証券	92.28
合計	92.28

(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

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	82,326.50	8,819,154	8,851,745	0.02
	ロシアルーブル	売建	5,802,075.00	8,819,154	8,761,133	△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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	111,159,415,570	96.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,987,784,059	3.46
合計(純資産総額)		115,147,199,629	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、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（%）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,956,526,000	3.44

(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	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	12,245	779,271.73	9,542,182,418	676,000	8,277,620,000	7.19
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,644	699,701.62	8,847,027,394	588,000	7,434,672,000	6.46
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,027	291,066.65	5,538,125,265	304,000	5,784,208,000	5.02
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	40,820	184,307.78	7,523,443,919	132,500	5,408,650,000	4.70
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	18,041	291,715.07	5,262,831,728	266,400	4,806,122,400	4.17
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	31,493	132,716.1	4,179,628,174	143,700	4,525,544,100	3.93
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,993	340,823.59	4,087,497,376	335,500	4,023,651,500	3.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	25,194	220,893.75	5,565,197,207	155,800	3,925,225,200	3.41
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	23,898	224,141.67	5,356,537,783	142,200	3,398,295,600	2.95
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	28,391	197,177.51	5,598,066,881	114,200	3,242,252,200	2.82
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	16,284	162,918.84	2,652,970,461	176,700	2,877,382,800	2.50
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,202	661,584.39	2,779,977,636	653,000	2,743,906,000	2.38
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,310	470,172.9	3,907,136,874	329,000	2,733,990,000	2.37
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	36,971	90,496.04	3,345,729,133	67,100	2,480,754,100	2.15
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,262	269,303.71	2,224,987,262	286,500	2,367,063,000	2.06
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,912	778,879.17	3,046,975,337	598,000	2,339,376,000	2.03
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,336	525,352.18	3,328,631,460	366,500	2,322,144,000	2.02
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	14,548	167,261.27	2,433,317,083	145,500	2,116,734,000	1.84
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,756	158,251.23	1,860,401,527	160,700	1,889,189,200	1.64
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,918	799,908.75	2,334,133,752	629,000	1,835,422,000	1.59
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,733	78,631.51	3,202,897,378	44,850	1,826,875,050	1.59
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,505	339,189.96	1,867,240,775	326,000	1,794,630,000	1.56
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,598	452,157.87	1,626,864,036	469,000	1,687,462,000	1.47
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,491	449,893.87	2,020,473,384	350,000	1,571,850,000	1.37
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	11,696	172,775.97	2,020,787,824	133,300	1,559,076,800	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,646	139,754.27	1,907,086,799	114,000	1,555,644,000	1.35
日本	投資証券	日本リート投資法人	4,107	445,899.19	1,831,307,997	378,500	1,554,499,500	1.35
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	15,479	97,221.35	1,504,889,330	98,900	1,530,873,100	1.33
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	55,464	57,742.66	3,202,639,350	27,280	1,513,057,920	1.31
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,249	202,798.08	1,672,881,408	181,300	1,495,543,700	1.30

(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（%）
投資証券	96.54
合計	96.54

(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（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	2,326	円	4,100,792,260	3,956,526,000	3.44

(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。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	67,200,033,744	75.27
	オーストラリア	5,767,734,422	6.46
	イギリス	4,476,989,414	5.01
	シンガポール	3,763,828,361	4.22
	フランス	2,050,302,989	2.30
	カナダ	1,658,049,269	1.86
	香港	1,509,656,987	1.69
	ベルギー	1,082,644,053	1.21
	スペイン	479,133,540	0.54
	ニュージーランド	388,125,795	0.43
	ドイツ	252,422,234	0.28
	ガーンジー	210,730,785	0.24
	オランダ	160,282,655	0.18
	アイルランド	122,530,682	0.14
	イスラエル	61,022,259	0.07
	マン島	14,733,095	0.02
	イタリア	13,082,559	0.01
	韓国	11,630,863	0.01
	小計	89,222,933,706	99.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	57,972,868	0.06
合計(純資産総額)		89,280,906,574	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（%）
為替予約取引	買建	―	424,796,000	0.48

(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	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	581,052	9,226.93	5,361,329,495	10,005.66	5,813,812,531	6.51
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	69,410	59,887.53	4,156,793,752	74,555.92	5,174,926,789	5.80
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	206,375	13,288.54	2,742,424,450	15,704.75	3,241,069,123	3.63
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	118,010	22,365.24	2,639,322,764	21,633.96	2,553,023,702	2.86
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	109,481	21,332.55	2,335,509,941	17,100.49	1,872,179,392	2.10
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	275,480	8,507.26	2,343,582,610	6,545.35	1,803,113,321	2.02
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	320,234	8,108.74	2,596,694,293	5,520.59	1,767,880,682	1.98
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	268,881	7,591.48	2,041,206,118	5,989.42	1,610,441,508	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	96,180	16,354.78	1,573,003,480	16,682.20	1,604,494,400	1.80
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	240,798	14,482.49	3,487,354,631	6,424.91	1,547,107,284	1.73
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	51,875	31,842.04	1,651,805,885	26,759.91	1,388,170,632	1.55
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,258,689	996.56	1,254,370,166	1,099.50	1,383,932,961	1.55
香港	投資証券	LINK REIT	1,656,600	1,124.26	1,862,462,052	790.59	1,309,691,394	1.47
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	420,980	3,046.87	1,282,673,685	2,817.28	1,186,021,060	1.33
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	293,024	5,776.09	1,692,535,390	3,952.80	1,158,266,088	1.30
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	89,224	13,790.68	1,230,460,226	12,651.97	1,128,860,246	1.26
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	72,523	15,891.62	1,152,508,492	14,896.13	1,080,312,101	1.21
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	287,667	3,666.30	1,054,675,324	3,745.26	1,077,390,556	1.21
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	113,400	13,865.28	1,572,322,940	9,436.83	1,070,136,840	1.20
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	387,474	3,412.19	1,322,135,685	2,751.69	1,066,209,377	1.19
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	101,400	11,149.19	1,130,528,146	10,454.06	1,060,042,353	1.19
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	868,400	1,099.80	955,071,891	1,123.85	975,955,161	1.09
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	142,581	6,994.10	997,226,519	6,720.62	958,233,433	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	230,610	4,835.79	1,115,181,568	4,134.52	953,463,617	1.07
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	135,570	8,532.04	1,156,688,880	6,696.96	907,908,006	1.02
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	408,717	2,079.98	850,125,541	1,951.66	797,680,503	0.89
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	76,819	11,297.91	867,894,635	9,951.90	764,495,121	0.86

アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	363,546	2,455.91	892,838,790	2,083.93	757,604,925	0.85
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	569,131	1,712.35	974,554,895	1,293.58	736,219,837	0.82
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	4,209,693	249.70	1,051,174,286	169.81	714,860,597	0.80

(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（%）
投資証券	99.94
合計	99.94

(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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,400,000.00	366,000,450	365,568,000	0.41
	カナダドル	買建	150,000.00	11,700,030	11,700,000	0.01
	イギリスポンド	買建	150,000.00	19,867,050	19,878,000	0.02
	香港ドル	買建	900,000.00	12,483,540	12,474,000	0.01
	シンガポールドル	買建	200,000.00	15,175,060	15,176,000	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。

新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	南アフリカ	88,426,871	28.23
	メキシコ	82,573,512	26.36
	タイ	64,472,300	20.58
	マレーシア	41,374,951	13.21
	サウジアラビア	14,360,395	4.58
	トルコ	7,512,061	2.40

小計		298,720,090	95.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	14,546,726	4.64
合計(純資産総額)		313,266,816	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（%）
為替予約取引	買建	—	236,250	0.08
	売建	—	627,900	△0.20

(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	投資比率(%)
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	394,600	128.84	50,841,000	84.36	33,288,930	10.63
南アフリカ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	391,650	123.70	48,450,562	77.67	30,422,432	9.71
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	213,400	115.33	24,612,874	99.71	21,278,114	6.79
タイ	投資証券	TESCO LOTUS RETAIL GROWTH FR	231,900	77.31	17,929,859	69.29	16,068,351	5.13
メキシコ	投資証券	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	104,500	137.52	14,371,641	131.84	13,777,447	4.40
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	60,200	189.24	11,392,689	195.82	11,788,749	3.76
マレーシア	投資証券	KLCCP STAPLED GROUP	59,700	195.46	11,669,348	191.82	11,452,084	3.66
メキシコ	投資証券	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	114,400	124.23	14,212,254	97.96	11,206,807	3.58
南アフリカ	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	157,427	106.70	16,798,873	70.77	11,142,431	3.56
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	100,300	118.79	11,914,840	108.75	10,908,106	3.48
マレーシア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	234,100	45.65	10,687,501	42.02	9,837,818	3.14
タイ	投資証券	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	169,100	58.00	9,807,898	55.77	9,430,707	3.01
南アフリカ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	723,571	39.03	28,244,333	12.68	9,181,826	2.93
南アフリカ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	38,339	381.12	14,612,114	238.69	9,151,519	2.92
タイ	投資証券	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	146,300	56.70	8,295,765	58.13	8,505,297	2.72
マレーシア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	196,400	44.79	8,797,301	38.81	7,622,363	2.43
南アフリカ	投資証券	EQUITES PROPERTY FUND LTD	71,972	124.74	8,978,483	99.17	7,137,895	2.28

トルコ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	248,842	18.59	4,626,067	22.70	5,650,903	1.80
タイ	投資証券	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	89,000	80.30	7,147,081	59.82	5,324,514	1.70
マレーシア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	106,800	44.87	4,792,320	49.44	5,280,192	1.69
マレーシア	投資証券	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	109,100	42.30	4,615,363	43.01	4,692,696	1.50
南アフリカ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	113,057	102.74	11,616,467	37.57	4,248,230	1.36
南アフリカ	投資証券	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	52,845	86.03	4,546,721	79.46	4,199,275	1.34
南アフリカ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	34,426	305.08	10,502,941	110.75	3,812,914	1.22
サウジアラビア	投資証券	JADWA REIT SAUDI FUND	11,541	286.61	3,307,869	321.10	3,705,861	1.18
サウジアラビア	投資証券	AL RAJHI REIT	14,397	251.84	3,625,862	238.24	3,430,052	1.09
サウジアラビア	投資証券	RIYAD REIT FUND	13,466	224.30	3,020,483	226.20	3,046,094	0.97
サウジアラビア	投資証券	DERAYAH REIT	11,001	267.85	2,946,620	271.79	2,989,979	0.95
南アフリカ	投資証券	ATTACQ LTD	100,966	70.06	7,073,845	29.50	2,979,143	0.95
マレーシア	投資証券	CAPITALAND MALAYSIA MALL TRU	125,900	24.74	3,114,989	19.77	2,489,798	0.79

(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（%）
投資証券	95.36
合計	95.36

(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

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	トルコリラ	買建	15,000.00	238,725	236,250	0.08
	メキシコペソ	売建	130,000.00	627,640	627,900	△0.20

(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：2014年11月28日
作成基準日：2020年 5 月29日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	9,943円
純資産総額	23.74億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年 4 月	0円
2018年10月	0円
2019年 4 月	0円
2019年10月	0円
2020年 4 月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	26.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.9%
外国債券インデックスマザーファンド	21.6%	T 2.375% 05/15/29	アメリカ	国債	-	2.375%	2029/05/15	0.1%
		T 1.625% 08/15/29	アメリカ	国債	-	1.625%	2029/08/15	0.1%
グローバルREITインデックスマザーファンド	12.8%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
新興国株式インデックスマザーファンド	11.9%	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	0.8%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.7%
新興国債券インデックスマザーファンド	11.2%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.7%
		BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	国債	-	10.000%	2023/01/01	0.2%
新興国REITインデックスマザーファンド	5.7%	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	メキシコ	投資証券	-	-	-	0.6%
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	南アフリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
国内株式インデックスマザーファンド	4.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	3.4%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.1%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.0%
J-REITインデックスマザーファンド	2.2%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.2%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	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)

※2014年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2020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＞

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＞

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（※）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

※「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＞

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜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＞

前記　第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

＜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
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後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＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜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0.1%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。
解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6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。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

＜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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、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、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

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。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.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。）

c.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。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2014年11月28日設定）

ただし、下記「(5)その他　＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞」の事項に該当する場合は、こ

の投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

原則として、毎年4月21日から10月20日まで及び10月21日から翌年4月20日までとします。
ただし、第1計算期間は2014年11月28日から2015年4月20日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

⑤受益者が収益分配金について支払開始日から5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。

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

(1)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11期計算期間(2019年10月22日から2020年4月20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【財務諸表】

【ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （2019年10月21日現在）	第11期 （2020年 4月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,871,731	38,944,930
親投資信託受益証券	2,832,238,323	2,282,557,338
未収入金	20,100,000	-
流動資産合計	2,886,210,054	2,321,502,268
資産合計	2,886,210,054	2,321,502,268
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,784,301	2,314,848
未払受託者報酬	758,008	723,822
未払委託者報酬	6,822,056	6,514,365
未払利息	26	55
その他未払費用	75,741	72,320
流動負債合計	23,440,132	9,625,410
負債合計	23,440,132	9,625,410
純資産の部		
元本等		
元本	2,674,660,853	2,413,723,127
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	188,109,069	△101,846,269
（分配準備積立金）	307,935,097	288,636,661
元本等合計	2,862,769,922	2,311,876,858
純資産合計	2,862,769,922	2,311,876,858
負債純資産合計	2,886,210,054	2,321,502,268

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自　2019年 4月23日 至　2019年10月21日	第11期 自　2019年10月22日 至　2020年 4月20日
営業収益		
受取利息	12	65
有価証券売買等損益	27,897,644	△264,370,985
営業収益合計	27,897,656	△264,370,920
営業費用		
支払利息	10,401	8,251
受託者報酬	758,008	723,822
委託者報酬	6,822,056	6,514,365
その他費用	75,779	72,322
営業費用合計	7,666,244	7,318,760
営業利益又は営業損失（△）	20,231,412	△271,689,680
経常利益又は経常損失（△）	20,231,412	△271,689,680
当期純利益又は当期純損失（△）	20,231,412	△271,689,680
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△3,256,405	△5,477,739
期首剰余金又は期首欠損金（△）	172,117,403	188,109,069
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,222,629	5,833,578
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,222,629	5,833,578
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,718,780	29,576,975
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,718,780	29,576,975
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	188,109,069	△101,846,269

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年4月21日から10月20日まで、及び10月21日から翌年4月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2019年10月22日から2020年 4月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第10期 (2019年10月21日現在)		第11期 (2020年 4月20日現在)	
１. 計算期間の末日における受益権の総数		2,674,660,853口		2,413,723,127口
２. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	－円	元本の欠損	101,846,269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	1.0703円	1口当たり純資産額	0.9578円
	(1万口当たり純資産額)	(10,703円)	(1万口当たり純資産額)	(9,578円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第10期 自 2019年 4月23日 至 2019年10月21日	第11期 自 2019年10月22日 至 2020年 4月20日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	36,654,836円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	172,572,578円
分配準備積立金額	D	271,280,261円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	480,507,675円
当ファンドの期末残存口数	F	2,674,660,853口

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	28,086,198円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	173,662,637円
分配準備積立金額	D	260,550,463円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	462,299,298円
当ファンドの期末残存口数	F	2,413,723,127口

第10期 自 2019年 4月23日 至 2019年10月21日			第11期 自 2019年10月22日 至 2020年 4月20日		
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,796円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,915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11期 自 2019年10月22日 至 2020年 4月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	第11期 (2020年 4月20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

	第11期 (2020年 4月20日現在)
	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10期 自 2019年 4月23日 至 2019年10月21日	第11期 自 2019年10月22日 至 2020年 4月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,725,671,201円	2,674,660,853円
期中追加設定元本額	156,918,897円	163,015,795円
期中一部解約元本額	207,929,245円	423,953,521円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第10期 (2019年10月21日現在)	第11期 (2020年 4月20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	31,131,975	△257,970,399
合計	31,131,975	△257,970,399

（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	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	31,194,852	49,646,606	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	196,068,821	297,906,966	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	114,124,252	276,454,588	
	国内株式インデックス　マザーファンド	68,292,635	92,372,618	
	外国株式インデックス　マザーファンド	247,460,791	602,022,612	
	国内債券インデックス　マザーファンド	57,065,616	80,593,769	
	外国債券インデックス　マザーファンド	174,974,454	503,996,417	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	163,321,977	250,470,583	
	新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	290,554,085	129,093,179	
合計		1,343,057,483	2,282,557,338	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,563,341,015
株式	279,894,221,160
派生商品評価勘定	102,468,950
未収配当金	3,659,253,259
差入委託証拠金	350,574,600
流動資産合計	286,569,858,984
資産合計	286,569,858,984
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,868,000
前受金	44,626,800
未払金	290,700
未払解約金	259,691,982
未払利息	3,644
流動負債合計	362,481,126
負債合計	362,481,126
純資産の部	
元本等	
元本	211,602,699,834
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	74,604,678,024
元本等合計	286,207,377,858
純資産合計	286,207,377,858
負債純資産合計	286,569,858,984

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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。 先物取引

	2020年 4月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 4月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	211,602,699,834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 1.3526円 (1万口当たり純資産額) (13,526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

	2020年 4月20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。

	2020年 4月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 4月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	211,468,660,977円
期中追加設定元本額	25,519,171,806円
期中一部解約元本額	25,385,132,949円
期末元本額	211,602,699,834円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	590,708,720円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,021,239,532円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,199,044円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,658,446,485円
世界経済インデックスファンド	2,170,851,629円
日本株式インデックス・オープン	4,326,792,273円
ＤＣマイセレクション２５	7,563,721,888円
ＤＣマイセレクション５０	19,949,483,865円
ＤＣマイセレクション７５	17,566,250,858円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,768,244,212円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,161,246,734円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,332,054,006円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,158,271,518円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	6,863,486,528円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	337,342,540円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	766,616,666円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	500,438,221円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,835,836,022円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,066,035,949円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	16,353,756円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	36,718,016円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	40,561,470円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	273,869,250円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,765,336円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	76,481,505円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	259,334,749円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	56,568,957円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	313,431,021円

区分	2020年 4月20日現在
バランスA（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,813,775,132円
バランスB（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	696,376,705円
バランスC（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,147,454,786円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	611,464,467円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	40,134,722円
バランスD（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	793,385,769円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	36,710,849円
バランスE（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	470,942,073円
バランスF（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	591,996,001円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	57,142,713円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	857,037,369円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	4,925,074,305円
日本株式ファンド・シリーズ２	2,083,812,554円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	5,521,747,548円
分散投資コア戦略ファンドS	15,342,693,791円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	310,053,486円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	340,275,098円
コア投資戦略ファンド（切替型）	561,696,405円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	205,894,235円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,150,137円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	68,292,635円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	13,521,725,889円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	20,581,169円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	71,582,200円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	12,571,374円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,483,247円
グローバル経済コア	268,862,529円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	17,057,293円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	46,252,708円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	2,951,713円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	239,188,128円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,642,992円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	97,262円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	133,697円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	55,040円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	28,855円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	52,010,733,740円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	565,859,386円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	25,437,687円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	18,358,483円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△19,127,960,061
合計	△19,127,960,061

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,724,318,200	－	5,768,945,000	44,626,800
合計		5,724,318,200	－	5,768,945,000	44,626,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,600	2,541.00	16,770,600	
日本水産	188,900	468.00	88,405,200	
マルハニチロ	27,300	2,260.00	61,698,000	
カネコ種苗	5,700	1,469.00	8,373,300	
サカタのタネ	22,500	3,475.00	78,187,500	
ホクト	14,400	1,959.00	28,209,600	
ホクリヨウ	2,900	622.00	1,803,800	
住石ホールディングス	38,100	117.00	4,457,700	

日鉄鉱業	4,300	4,110.00	17,673,000	
三井松島ホールディングス	7,300	840.00	6,132,000	
国際石油開発帝石	757,800	635.00	481,203,000	
石油資源開発	24,700	1,816.00	44,855,200	
K＆Oエナジーグループ	9,200	1,529.00	14,066,800	
ヒノキヤグループ	4,700	1,397.00	6,565,900	
ショーボンドホールディングス	29,400	4,260.00	125,244,000	
ミライト・ホールディングス	56,100	1,308.00	73,378,800	
タマホーム	10,200	1,194.00	12,178,800	
サンヨーホームズ	1,600	579.00	926,400	
日本アクア	7,500	612.00	4,590,000	
ファーストコーポレーション	5,800	444.00	2,575,200	
ベステラ	3,200	945.00	3,024,000	
ＴＡＴＥＲＵ	38,900	123.00	4,784,700	
キャンディル	1,700	415.00	705,500	
スペースバリューホールディングス	23,000	316.00	7,268,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	930.00	3,348,000	
第一カッター興業	2,300	1,600.00	3,680,000	
明豊ファシリティワークス	4,600	505.00	2,323,000	
安藤・間	112,500	641.00	72,112,500	
東急建設	55,300	526.00	29,087,800	
コムシスホールディングス	67,000	2,782.00	186,394,000	
ビーアールホールディングス	20,600	469.00	9,661,400	
高松コンストラクショングループ	11,800	2,145.00	25,311,000	
東建コーポレーション	5,800	7,880.00	45,704,000	
ソネック	1,900	690.00	1,311,000	
ヤマウラ	8,200	711.00	5,830,200	
大成建設	145,400	3,090.00	449,286,000	
大林組	436,200	890.00	388,218,000	
清水建設	442,700	800.00	354,160,000	
飛島建設	12,500	991.00	12,387,500	
長谷工コーポレーション	168,900	1,129.00	190,688,100	
松井建設	17,200	596.00	10,251,200	
錢高組	1,900	3,545.00	6,735,500	
鹿島建設	342,400	1,044.00	357,465,600	
不動テトラ	11,400	1,256.00	14,318,400	
大末建設	5,000	686.00	3,430,000	
鉄建建設	9,500	2,153.00	20,453,500	
西松建設	33,600	1,897.00	63,739,200	
三井住友建設	105,400	410.00	43,214,000	
大豊建設	9,800	2,186.00	21,422,800	
前田建設工業	109,200	794.00	86,704,800	

佐田建設	9,400	344.00	3,233,600	
ナカノフドー建設	11,900	317.00	3,772,300	
奥村組	23,700	2,188.00	51,855,600	
東鉄工業	18,700	2,710.00	50,677,000	
イチケン	3,100	1,181.00	3,661,100	
富士ピー・エス	6,400	485.00	3,104,000	
淺沼組	4,900	3,320.00	16,268,000	
戸田建設	181,100	606.00	109,746,600	
熊谷組	20,200	2,223.00	44,904,600	
北野建設	2,700	2,452.00	6,620,400	
植木組	1,900	2,392.00	4,544,800	
矢作建設工業	19,300	731.00	14,108,300	
ピーエス三菱	14,400	511.00	7,358,400	
日本ハウスホールディングス	29,800	284.00	8,463,200	
大東建託	52,300	10,375.00	542,612,500	
新日本建設	18,500	757.00	14,004,500	
ＮＩＰＰＯ	36,100	2,275.00	82,127,500	
東亜道路工業	2,700	2,820.00	7,614,000	
前田道路	38,500	1,975.00	76,037,500	
日本道路	4,200	6,020.00	25,284,000	
東亜建設工業	13,600	1,325.00	18,020,000	
日本国土開発	31,800	507.00	16,122,600	
若築建設	7,800	1,141.00	8,899,800	
東洋建設	48,900	415.00	20,293,500	
五洋建設	172,900	515.00	89,043,500	
世紀東急工業	20,900	760.00	15,884,000	
福田組	5,000	4,080.00	20,400,000	
住友林業	110,500	1,255.00	138,677,500	
日本基礎技術	14,700	388.00	5,703,600	
巴コーポレーション	19,400	327.00	6,343,800	
大和ハウス工業	431,600	2,629.50	1,134,892,200	
ライト工業	25,000	1,244.00	31,100,000	
積水ハウス	477,200	1,761.50	840,587,800	
日特建設	11,400	704.00	8,025,600	
北陸電気工事	7,500	881.00	6,607,500	
ユアテック	25,000	621.00	15,525,000	
四電工	2,400	2,209.00	5,301,600	
中電工	17,600	2,055.00	36,168,000	
関電工	62,100	835.00	51,853,500	
きんでん	103,600	1,635.00	169,386,000	
東京エネシス	14,500	689.00	9,990,500	
トーエネック	4,400	3,150.00	13,860,000	

住友電設	12,300	2,109.00	25,940,700	
日本電設工業	23,900	2,101.00	50,213,900	
協和エクシオ	66,100	2,513.00	166,109,300	
新日本空調	11,500	1,985.00	22,827,500	
九電工	30,600	2,685.00	82,161,000	
三機工業	31,400	1,175.00	36,895,000	
日揮ホールディングス	134,300	986.00	132,419,800	
中外炉工業	4,700	1,500.00	7,050,000	
ヤマト	14,000	646.00	9,044,000	
太平電業	10,500	2,165.00	22,732,500	
高砂熱学工業	37,900	1,613.00	61,132,700	
三晃金属工業	1,900	1,966.00	3,735,400	
朝日工業社	2,900	2,832.00	8,212,800	
明星工業	28,200	676.00	19,063,200	
大氣社	21,200	2,900.00	61,480,000	
ダイダン	10,400	2,559.00	26,613,600	
日比谷総合設備	14,000	1,763.00	24,682,000	
フィル・カンパニー	1,900	2,625.00	4,987,500	
ＯＳＪＢホールディングス	68,800	226.00	15,548,800	
東洋エンジニアリング	18,300	334.00	6,112,200	
レイズネクスト	23,400	1,179.00	27,588,600	
日本製粉	40,800	1,654.00	67,483,200	
日清製粉グループ本社	157,700	1,648.00	259,889,600	
日東富士製粉	1,000	5,800.00	5,800,000	
昭和産業	12,800	3,270.00	41,856,000	
鳥越製粉	12,400	872.00	10,812,800	
中部飼料	17,100	1,564.00	26,744,400	
フィード・ワン	93,800	157.00	14,726,600	
東洋精糖	2,400	1,200.00	2,880,000	
日本甜菜製糖	7,300	1,654.00	12,074,200	
三井製糖	12,200	2,168.00	26,449,600	
塩水港精糖	15,100	201.00	3,035,100	
日新製糖	6,600	1,879.00	12,401,400	
森永製菓	32,800	4,670.00	153,176,000	
中村屋	3,600	3,845.00	13,842,000	
江崎グリコ	41,400	4,785.00	198,099,000	
名糖産業	6,700	1,301.00	8,716,700	
井村屋グループ	5,900	1,929.00	11,381,100	
不二家	7,800	2,094.00	16,333,200	
山崎製パン	104,600	2,235.00	233,781,000	
第一屋製パン	2,400	894.00	2,145,600	
モロゾフ	2,400	5,220.00	12,528,000	

亀田製菓	8,000	5,130.00	41,040,000	
寿スピリッツ	13,400	4,660.00	62,444,000	
カルビー	63,600	3,290.00	209,244,000	
森永乳業	25,800	4,300.00	110,940,000	
六甲バター	9,300	1,415.00	13,159,500	
ヤクルト本社	96,000	7,000.00	672,000,000	
明治ホールディングス	92,300	7,650.00	706,095,000	
雪印メグミルク	33,600	2,433.00	81,748,800	
プリマハム	21,800	2,365.00	51,557,000	
日本ハム	53,400	3,460.00	184,764,000	
林兼産業	4,600	553.00	2,543,800	
丸大食品	14,900	1,908.00	28,429,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	11,100	2,286.00	25,374,600	
柿安本店	4,800	2,167.00	10,401,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	89,900	624.00	56,097,600	
サッポロホールディングス	47,600	1,975.00	94,010,000	
アサヒグループホールディングス	292,400	3,549.00	1,037,727,600	
キリンホールディングス	592,000	2,071.00	1,226,032,000	
宝ホールディングス	103,500	752.00	77,832,000	
オエノンホールディングス	36,800	413.00	15,198,400	
養命酒製造	4,300	1,881.00	8,088,300	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	98,000	2,037.00	199,626,000	
サントリー食品インターナショナル	93,400	3,970.00	370,798,000	
ダイドーグループホールディングス	7,200	3,925.00	28,260,000	
伊藤園	42,400	6,200.00	262,880,000	
キーコーヒー	13,700	2,204.00	30,194,800	
ユニカフェ	3,600	887.00	3,193,200	
ジャパンフーズ	2,000	1,103.00	2,206,000	
日清オイリオグループ	18,000	3,450.00	62,100,000	
不二製油グループ本社	34,000	2,661.00	90,474,000	
かどや製油	1,500	3,475.00	5,212,500	
Ｊ－オイルミルズ	7,200	4,100.00	29,520,000	
キッコーマン	100,500	4,890.00	491,445,000	
味の素	308,300	1,913.50	589,932,050	
キユーピー	77,700	2,130.00	165,501,000	
ハウス食品グループ本社	52,200	3,315.00	173,043,000	
カゴメ	53,000	2,669.00	141,457,000	
焼津水産化学工業	6,800	909.00	6,181,200	
アリアケジャパン	12,800	6,620.00	84,736,000	
ピエトロ	1,800	1,600.00	2,880,000	
エバラ食品工業	3,400	2,123.00	7,218,200	
やまみ	900	1,862.00	1,675,800	

ニチレイ	66,500	2,739.00	182,143,500	
東洋水産	71,800	5,420.00	389,156,000	
イートアンド	4,800	1,691.00	8,116,800	
大冷	1,800	1,835.00	3,303,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,700	869.00	6,691,300	
日清食品ホールディングス	59,300	9,100.00	539,630,000	
永谷園ホールディングス	6,800	2,174.00	14,783,200	
一正蒲鉾	5,400	967.00	5,221,800	
フジッコ	15,100	1,970.00	29,747,000	
ロック・フィールド	15,000	1,354.00	20,310,000	
日本たばこ産業	806,100	1,975.00	1,592,047,500	
ケンコーマヨネーズ	7,800	2,004.00	15,631,200	
わらべや日洋ホールディングス	9,100	1,553.00	14,132,300	
なとり	7,800	1,704.00	13,291,200	
イフジ産業	2,400	750.00	1,800,000	
ピックルスコーポレーション	3,000	2,332.00	6,996,000	
北の達人コーポレーション	48,700	468.00	22,791,600	
ユーグレナ	59,500	678.00	40,341,000	
ミヨシ油脂	5,300	1,042.00	5,522,600	
理研ビタミン	13,200	1,992.00	26,294,400	
片倉工業	20,200	1,025.00	20,705,000	
グンゼ	10,100	3,670.00	37,067,000	
東洋紡	54,200	1,193.00	64,660,600	
ユニチカ	41,400	303.00	12,544,200	
富士紡ホールディングス	6,800	2,516.00	17,108,800	
倉敷紡績	13,700	2,590.00	35,483,000	
シキボウ	7,100	1,115.00	7,916,500	
日本毛織	45,300	908.00	41,132,400	
トーア紡コーポレーション	5,400	459.00	2,478,600	
帝国繊維	15,500	2,115.00	32,782,500	
帝人	111,400	1,744.00	194,281,600	
東レ	987,300	480.10	474,002,730	
サカイオーベックス	3,900	2,044.00	7,971,600	
住江織物	3,000	1,727.00	5,181,000	
日本フエルト	8,800	428.00	3,766,400	
イチカワ	2,300	1,249.00	2,872,700	
日東製網	1,600	1,690.00	2,704,000	
アツギ	11,600	631.00	7,319,600	
ダイニック	5,100	727.00	3,707,700	
セーレン	33,900	1,243.00	42,137,700	
ソトー	5,700	938.00	5,346,600	
東海染工	2,100	1,110.00	2,331,000	

小松マテーレ	22,700	725.00	16,457,500	
ワコールホールディングス	35,700	2,207.00	78,789,900	
ホギメディカル	15,600	3,480.00	54,288,000	
クラウディアホールディングス	4,000	368.00	1,472,000	
ＴＳＩホールディングス	46,300	375.00	17,362,500	
マツオカコーポレーション	4,000	1,892.00	7,568,000	
ワールド	19,500	1,265.00	24,667,500	
三陽商会	7,400	857.00	6,341,800	
ナイガイ	5,500	419.00	2,304,500	
オンワードホールディングス	82,400	370.00	30,488,000	
ルックホールディングス	5,000	793.00	3,965,000	
ゴールドウイン	24,700	5,720.00	141,284,000	
デサント	26,800	1,321.00	35,402,800	
キング	7,000	461.00	3,227,000	
ヤマトインターナショナル	9,000	340.00	3,060,000	
特種東海製紙	8,700	4,000.00	34,800,000	
王子ホールディングス	569,500	541.00	308,099,500	
日本製紙	60,200	1,516.00	91,263,200	
三菱製紙	15,500	340.00	5,270,000	
北越コーポレーション	90,400	400.00	36,160,000	
中越パルプ工業	5,800	1,358.00	7,876,400	
巴川製紙所	4,000	826.00	3,304,000	
大王製紙	59,700	1,451.00	86,624,700	
阿波製紙	3,500	488.00	1,708,000	
レンゴー	128,800	812.00	104,585,600	
トーモク	8,400	1,524.00	12,801,600	
ザ・パック	10,300	3,335.00	34,350,500	
クラレ	214,500	1,056.00	226,512,000	
旭化成	902,900	726.70	656,137,430	
共和レザー	7,400	634.00	4,691,600	
昭和電工	97,000	2,338.00	226,786,000	
住友化学	1,000,800	315.00	315,252,000	
住友精化	6,000	2,915.00	17,490,000	
日産化学	75,700	3,870.00	292,959,000	
ラサ工業	4,800	1,245.00	5,976,000	
クレハ	11,700	4,260.00	49,842,000	
多木化学	4,000	4,495.00	17,980,000	
テイカ	10,000	1,557.00	15,570,000	
石原産業	24,400	571.00	13,932,400	
片倉コープアグリ	3,500	1,163.00	4,070,500	
日本曹達	20,200	2,749.00	55,529,800	
東ソー	210,600	1,261.00	265,566,600	

トクヤマ	39,300	2,255.00	88,621,500	
セントラル硝子	27,800	1,810.00	50,318,000	
東亞合成	85,500	964.00	82,422,000	
大阪ソーダ	13,900	2,427.00	33,735,300	
関東電化工業	32,300	869.00	28,068,700	
デンカ	49,700	2,599.00	129,170,300	
信越化学工業	233,900	11,840.00	2,769,376,000	
日本カーバイド工業	4,600	973.00	4,475,800	
堺化学工業	8,800	1,712.00	15,065,600	
第一稀元素化学工業	14,800	712.00	10,537,600	
エア・ウォーター	126,700	1,494.00	189,289,800	
大陽日酸	130,900	1,676.00	219,388,400	
日本化学工業	4,200	2,183.00	9,168,600	
東邦アセチレン	2,000	1,232.00	2,464,000	
日本パーカライジング	68,700	1,122.00	77,081,400	
高圧ガス工業	21,600	681.00	14,709,600	
チタン工業	1,700	1,651.00	2,806,700	
四国化成工業	21,000	1,026.00	21,546,000	
戸田工業	3,200	1,279.00	4,092,800	
ステラ　ケミファ	7,400	2,356.00	17,434,400	
保土谷化学工業	5,100	3,305.00	16,855,500	
日本触媒	21,100	5,010.00	105,711,000	
大日精化工業	12,100	2,228.00	26,958,800	
カネカ	35,200	2,880.00	101,376,000	
三菱瓦斯化学	126,700	1,269.00	160,782,300	
三井化学	123,700	1,900.00	235,030,000	
ＪＳＲ	126,900	1,923.00	244,028,700	
東京応化工業	23,400	4,255.00	99,567,000	
大阪有機化学工業	12,600	1,571.00	19,794,600	
三菱ケミカルホールディングス	910,600	603.20	549,273,920	
ＫＨネオケム	24,000	1,659.00	39,816,000	
ダイセル	186,300	804.00	149,785,200	
住友ベークライト	21,400	2,547.00	54,505,800	
積水化学工業	292,900	1,352.00	396,000,800	
日本ゼオン	122,900	837.00	102,867,300	
アイカ工業	40,900	2,997.00	122,577,300	
宇部興産	68,800	1,656.00	113,932,800	
積水樹脂	24,500	1,987.00	48,681,500	
タキロンシーアイ	29,500	561.00	16,549,500	
旭有機材	7,700	1,298.00	9,994,600	
日立化成	64,200	4,610.00	295,962,000	
ニチバン	7,200	1,453.00	10,461,600	

リケンテクノス	34,300	470.00	16,121,000	
大倉工業	6,400	1,533.00	9,811,200	
積水化成品工業	18,300	587.00	10,742,100	
群栄化学工業	3,100	2,457.00	7,616,700	
タイガースポリマー	7,200	451.00	3,247,200	
ミライアル	4,800	1,026.00	4,924,800	
ダイキアクシス	4,800	781.00	3,748,800	
ダイキョーニシカワ	28,700	504.00	14,464,800	
竹本容器	4,900	777.00	3,807,300	
森六ホールディングス	7,300	1,403.00	10,241,900	
日本化薬	84,300	965.00	81,349,500	
カーリットホールディングス	14,500	474.00	6,873,000	
日本精化	11,000	1,560.00	17,160,000	
扶桑化学工業	13,800	3,155.00	43,539,000	
トリケミカル研究所	3,000	10,090.00	30,270,000	
ＡＤＥＫＡ	62,700	1,293.00	81,071,100	
日油	51,300	3,660.00	187,758,000	
新日本理化	22,500	182.00	4,095,000	
ハリマ化成グループ	11,300	951.00	10,746,300	
花王	333,000	8,760.00	2,917,080,000	
第一工業製薬	5,100	4,345.00	22,159,500	
石原ケミカル	3,700	1,773.00	6,560,100	
日華化学	4,600	825.00	3,795,000	
ニイタカ	2,100	2,414.00	5,069,400	
三洋化成工業	8,100	3,970.00	32,157,000	
有機合成薬品工業	10,400	310.00	3,224,000	
大日本塗料	15,400	823.00	12,674,200	
日本ペイントホールディングス	112,400	6,090.00	684,516,000	
関西ペイント	153,000	2,063.00	315,639,000	
神東塗料	10,700	156.00	1,669,200	
中国塗料	38,800	825.00	32,010,000	
日本特殊塗料	10,200	795.00	8,109,000	
藤倉化成	18,400	480.00	8,832,000	
太陽ホールディングス	10,000	4,115.00	41,150,000	
ＤＩＣ	57,500	2,394.00	137,655,000	
サカタインクス	29,700	882.00	26,195,400	
東洋インキＳＣホールディングス	28,800	2,012.00	57,945,600	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	10,500	731.00	7,675,500	
富士フイルムホールディングス	266,700	5,362.00	1,430,045,400	
資生堂	276,400	6,868.00	1,898,315,200	
ライオン	180,800	2,325.00	420,360,000	
高砂香料工業	8,700	2,047.00	17,808,900	

マンダム	31,300	2,073.00	64,884,900	
ミルボン	18,600	5,210.00	96,906,000	
ファンケル	56,300	2,551.00	143,621,300	
コーセー	26,200	14,190.00	371,778,000	
コタ	8,000	1,201.00	9,608,000	
シーボン	1,800	2,114.00	3,805,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	59,400	2,142.00	127,234,800	
ノエビアホールディングス	13,300	5,320.00	70,756,000	
アジュバンコスメジャパン	3,100	920.00	2,852,000	
エステー	8,900	1,538.00	13,688,200	
アグロ　カネショウ	4,300	1,515.00	6,514,500	
コニシ	22,900	1,414.00	32,380,600	
長谷川香料	18,400	2,107.00	38,768,800	
星光ＰＭＣ	8,000	621.00	4,968,000	
小林製薬	39,000	10,610.00	413,790,000	
荒川化学工業	12,500	1,219.00	15,237,500	
メック	9,500	1,526.00	14,497,000	
日本高純度化学	3,800	2,457.00	9,336,600	
タカラバイオ	36,400	2,288.00	83,283,200	
ＪＣＵ	16,800	2,317.00	38,925,600	
新田ゼラチン	8,700	664.00	5,776,800	
ＯＡＴアグリオ	2,400	1,140.00	2,736,000	
デクセリアルズ	35,900	675.00	24,232,500	
アース製薬	10,500	6,060.00	63,630,000	
北興化学工業	14,200	568.00	8,065,600	
大成ラミック	4,600	2,618.00	12,042,800	
クミアイ化学工業	57,500	847.00	48,702,500	
日本農薬	24,800	435.00	10,788,000	
アキレス	9,600	1,638.00	15,724,800	
有沢製作所	22,000	790.00	17,380,000	
日東電工	96,000	4,960.00	476,160,000	
レック	14,800	1,196.00	17,700,800	
三光合成	15,900	258.00	4,102,200	
きもと	23,700	137.00	3,246,900	
藤森工業	12,500	3,005.00	37,562,500	
前澤化成工業	8,800	1,014.00	8,923,200	
未来工業	7,500	1,940.00	14,550,000	
ウェーブロックホールディングス	4,800	881.00	4,228,800	
ＪＳＰ	8,100	1,350.00	10,935,000	
エフピコ	15,300	7,950.00	121,635,000	
天馬	9,300	1,510.00	14,043,000	
信越ポリマー	25,000	850.00	21,250,000	

東リ	34,600	254.00	8,788,400	
ニフコ	51,100	1,893.00	96,732,300	
バルカー	11,300	1,785.00	20,170,500	
ユニ・チャーム	268,100	4,074.00	1,092,239,400	
ショーエイコーポレーション	1,600	689.00	1,102,400	
協和キリン	139,900	2,379.00	332,822,100	
武田薬品工業	1,157,200	3,656.00	4,230,723,200	
アステラス製薬	1,206,000	1,756.00	2,117,736,000	
大日本住友製薬	103,100	1,436.00	148,051,600	
塩野義製薬	177,800	5,500.00	977,900,000	
わかもと製薬	16,500	232.00	3,828,000	
あすか製薬	15,800	1,106.00	17,474,800	
日本新薬	36,400	8,150.00	296,660,000	
ビオフェルミン製薬	2,400	2,310.00	5,544,000	
中外製薬	145,000	13,260.00	1,922,700,000	
科研製薬	23,800	5,540.00	131,852,000	
エーザイ	166,500	7,916.00	1,318,014,000	
ロート製薬	71,400	3,165.00	225,981,000	
小野薬品工業	319,400	2,524.50	806,325,300	
久光製薬	36,800	4,930.00	181,424,000	
持田製薬	19,300	4,070.00	78,551,000	
参天製薬	259,100	1,908.00	494,362,800	
扶桑薬品工業	4,900	2,280.00	11,172,000	
日本ケミファ	1,800	2,369.00	4,264,200	
ツムラ	43,100	2,881.00	124,171,100	
日医工	39,400	1,335.00	52,599,000	
キッセイ薬品工業	24,600	2,533.00	62,311,800	
生化学工業	27,000	1,045.00	28,215,000	
栄研化学	24,400	2,057.00	50,190,800	
日水製薬	5,800	1,326.00	7,690,800	
鳥居薬品	8,700	2,975.00	25,882,500	
ＪＣＲファーマ	9,800	10,560.00	103,488,000	
東和薬品	17,800	2,190.00	38,982,000	
富士製薬工業	9,400	1,139.00	10,706,600	
沢井製薬	28,600	5,850.00	167,310,000	
ゼリア新薬工業	25,200	2,055.00	51,786,000	
第一三共	398,000	7,373.00	2,934,454,000	
キョーリン製薬ホールディングス	30,700	2,284.00	70,118,800	
大幸薬品	17,000	1,847.00	31,399,000	
ダイト	8,300	3,460.00	28,718,000	
大塚ホールディングス	265,000	4,236.00	1,122,540,000	
大正製薬ホールディングス	29,400	6,610.00	194,334,000	

ペプチドリーム	70,700	3,830.00	270,781,000	
日本コークス工業	117,500	61.00	7,167,500	
ニチレキ	16,400	1,291.00	21,172,400	
ユシロ化学工業	7,800	1,125.00	8,775,000	
ビーピー・カストロール	5,000	1,109.00	5,545,000	
富士石油	37,100	182.00	6,752,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,000	873.00	4,365,000	
出光興産	156,500	2,399.00	375,443,500	
ＪＸＴＧホールディングス	2,092,400	365.50	764,772,200	
コスモエネルギーホールディングス	40,300	1,503.00	60,570,900	
横浜ゴム	80,500	1,336.00	107,548,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	79,900	1,184.00	94,601,600	
ブリヂストン	400,700	3,250.00	1,302,275,000	
住友ゴム工業	124,900	1,000.00	124,900,000	
藤倉コンポジット	12,100	352.00	4,259,200	
オカモト	8,500	4,445.00	37,782,500	
フコク	6,100	577.00	3,519,700	
ニッタ	15,700	1,889.00	29,657,300	
住友理工	27,000	554.00	14,958,000	
三ツ星ベルト	18,300	1,345.00	24,613,500	
バンドー化学	24,500	609.00	14,920,500	
日東紡績	20,700	5,080.00	105,156,000	
ＡＧＣ	137,500	2,522.00	346,775,000	
日本板硝子	66,500	316.00	21,014,000	
石塚硝子	2,600	2,124.00	5,522,400	
日本山村硝子	5,800	833.00	4,831,400	
日本電気硝子	55,900	1,414.00	79,042,600	
オハラ	5,500	903.00	4,966,500	
住友大阪セメント	26,300	3,400.00	89,420,000	
太平洋セメント	87,900	2,117.00	186,084,300	
日本ヒューム	14,000	555.00	7,770,000	
日本コンクリート工業	30,100	239.00	7,193,900	
三谷セキサン	6,500	4,380.00	28,470,000	
アジアパイルホールディングス	19,800	403.00	7,979,400	
東海カーボン	145,700	910.00	132,587,000	
日本カーボン	7,200	3,300.00	23,760,000	
東洋炭素	8,200	1,413.00	11,586,600	
ノリタケカンパニーリミテド	7,700	3,340.00	25,718,000	
ＴＯＴＯ	99,400	3,460.00	343,924,000	
日本碍子	169,800	1,308.00	222,098,400	
日本特殊陶業	108,300	1,523.00	164,940,900	
ＭＡＲＵＷＡ	5,300	6,530.00	34,609,000	

品川リフラクトリーズ	3,700	2,068.00	7,651,600	
黒崎播磨	2,800	3,660.00	10,248,000	
ヨータイ	11,100	611.00	6,782,100	
イソライト工業	7,200	398.00	2,865,600	
東京窯業	17,800	277.00	4,930,600	
ニッカトー	6,300	544.00	3,427,200	
フジミインコーポレーテッド	12,400	2,863.00	35,501,200	
クニミネ工業	5,600	956.00	5,353,600	
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,098.00	2,635,200	
ニチアス	38,100	1,978.00	75,361,800	
ニチハ	19,400	1,942.00	37,674,800	
日本製鉄	615,600	850.30	523,444,680	
神戸製鋼所	251,900	348.00	87,661,200	
中山製鋼所	19,200	377.00	7,238,400	
合同製鐵	7,400	1,881.00	13,919,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	371,600	707.00	262,721,200	
東京製鐵	67,100	665.00	44,621,500	
共英製鋼	15,600	1,322.00	20,623,200	
大和工業	29,300	2,029.00	59,449,700	
東京鐵鋼	5,700	1,060.00	6,042,000	
大阪製鐵	7,400	1,140.00	8,436,000	
淀川製鋼所	18,600	1,669.00	31,043,400	
丸一鋼管	44,700	2,442.00	109,157,400	
モリ工業	4,100	2,270.00	9,307,000	
大同特殊鋼	22,500	3,305.00	74,362,500	
日本高周波鋼業	5,300	371.00	1,966,300	
日本冶金工業	11,400	1,531.00	17,453,400	
山陽特殊製鋼	9,500	891.00	8,464,500	
愛知製鋼	7,800	2,776.00	21,652,800	
日立金属	148,200	1,092.00	161,834,400	
日本金属	3,200	622.00	1,990,400	
大平洋金属	9,300	1,677.00	15,596,100	
新日本電工	89,000	150.00	13,350,000	
栗本鐵工所	6,800	1,679.00	11,417,200	
虹技	2,100	1,013.00	2,127,300	
三菱製鋼	10,300	812.00	8,363,600	
日亜鋼業	20,400	255.00	5,202,000	
日本精線	2,300	3,050.00	7,015,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,000	538.00	3,228,000	
シンニッタン	21,600	258.00	5,572,800	
新家工業	3,200	1,009.00	3,228,800	
大紀アルミニウム工業所	22,800	552.00	12,585,600	

日本軽金属ホールディングス	348,600	164.00	57,170,400	
三井金属鉱業	37,200	1,902.00	70,754,400	
東邦亜鉛	7,100	1,217.00	8,640,700	
三菱マテリアル	90,900	2,045.00	185,890,500	
住友金属鉱山	175,900	2,448.50	430,691,150	
ＤＯＷＡホールディングス	34,800	2,881.00	100,258,800	
古河機械金属	24,500	1,044.00	25,578,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	893.00	12,859,200	
東邦チタニウム	24,800	596.00	14,780,800	
ＵＡＣＪ	20,900	1,603.00	33,502,700	
ＣＫサンエツ	2,900	2,870.00	8,323,000	
古河電気工業	42,800	1,935.00	82,818,000	
住友電気工業	514,400	1,065.50	548,093,200	
フジクラ	166,400	285.00	47,424,000	
昭和電線ホールディングス	16,000	1,003.00	16,048,000	
東京特殊電線	2,100	2,283.00	4,794,300	
タツタ電線	27,500	489.00	13,447,500	
カナレ電気	2,300	1,587.00	3,650,100	
平河ヒューテック	5,200	989.00	5,142,800	
リョービ	17,000	1,204.00	20,468,000	
アーレスティ	18,300	357.00	6,533,100	
アサヒホールディングス	24,100	2,290.00	55,189,000	
稲葉製作所	7,700	1,259.00	9,694,300	
宮地エンジニアリンググループ	4,200	1,508.00	6,333,600	
トーカロ	38,200	1,021.00	39,002,200	
アルファＣｏ	4,800	945.00	4,536,000	
ＳＵＭＣＯ	164,600	1,519.00	250,027,400	
川田テクノロジーズ	2,800	5,060.00	14,168,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,900	2,600.00	10,140,000	
信和	5,900	706.00	4,165,400	
東洋製罐グループホールディングス	87,600	1,054.00	92,330,400	
ホッカンホールディングス	7,600	1,526.00	11,597,600	
コロナ	7,600	938.00	7,128,800	
横河ブリッジホールディングス	25,600	1,836.00	47,001,600	
駒井ハルテック	2,600	1,523.00	3,959,800	
高田機工	1,300	2,212.00	2,875,600	
三和ホールディングス	129,700	780.00	101,166,000	
文化シヤッター	40,500	766.00	31,023,000	
三協立山	17,700	879.00	15,558,300	
アルインコ	10,000	973.00	9,730,000	
東洋シヤッター	3,300	668.00	2,204,400	
ＬＩＸＩＬグループ	203,000	1,245.00	252,735,000	

日本フイルコン	10,500	485.00	5,092,500	
ノーリツ	28,500	1,100.00	31,350,000	
長府製作所	14,000	2,107.00	29,498,000	
リンナイ	26,700	8,100.00	216,270,000	
ダイニチ工業	7,400	636.00	4,706,400	
日東精工	19,000	478.00	9,082,000	
三洋工業	1,800	1,759.00	3,166,200	
岡部	27,900	719.00	20,060,100	
ジーテクト	17,100	1,052.00	17,989,200	
東プレ	25,700	1,177.00	30,248,900	
高周波熱錬	26,500	585.00	15,502,500	
東京製綱	9,800	545.00	5,341,000	
サンコール	7,700	397.00	3,056,900	
モリテック　スチール	10,700	274.00	2,931,800	
パイオラックス	20,300	1,596.00	32,398,800	
エイチワン	13,500	492.00	6,642,000	
日本発條	147,600	688.00	101,548,800	
中央発條	1,700	2,629.00	4,469,300	
アドバネクス	2,000	1,299.00	2,598,000	
立川ブラインド工業	6,100	1,043.00	6,362,300	
三益半導体工業	10,700	2,114.00	22,619,800	
日本ドライケミカル	3,500	1,379.00	4,826,500	
日本製鋼所	41,800	1,261.00	52,709,800	
三浦工業	59,500	4,125.00	245,437,500	
タクマ	46,700	1,205.00	56,273,500	
ツガミ	28,600	881.00	25,196,600	
オークマ	16,100	3,480.00	56,028,000	
芝浦機械	15,600	2,083.00	32,494,800	
アマダ	175,000	885.00	154,875,000	
アイダエンジニアリング	36,100	713.00	25,739,300	
滝澤鉄工所	4,300	1,056.00	4,540,800	
ＦＵＪＩ	59,200	1,657.00	98,094,400	
牧野フライス製作所	16,200	2,846.00	46,105,200	
オーエスジー	63,700	1,283.00	81,727,100	
ダイジェット工業	1,600	1,214.00	1,942,400	
旭ダイヤモンド工業	36,300	462.00	16,770,600	
ＤＭＧ森精機	87,100	952.00	82,919,200	
ソディック	32,400	718.00	23,263,200	
ディスコ	18,600	24,630.00	458,118,000	
日東工器	7,600	1,759.00	13,368,400	
日進工具	4,100	2,509.00	10,286,900	
パンチ工業	12,700	330.00	4,191,000	

冨士ダイス	6,200	592.00	3,670,400	
豊和工業	7,800	672.00	5,241,600	
ＯＫＫ	5,900	450.00	2,655,000	
東洋機械金属	10,000	410.00	4,100,000	
津田駒工業	2,800	835.00	2,338,000	
エンシュウ	3,400	958.00	3,257,200	
島精機製作所	21,700	1,544.00	33,504,800	
オプトラン	15,400	2,963.00	45,630,200	
ＮＣホールディングス	4,300	534.00	2,296,200	
イワキポンプ	6,600	903.00	5,959,800	
フリュー	13,500	850.00	11,475,000	
ヤマシンフィルタ	30,000	910.00	27,300,000	
日阪製作所	17,100	718.00	12,277,800	
やまびこ	26,800	778.00	20,850,400	
平田機工	6,500	4,845.00	31,492,500	
ペガサスミシン製造	14,100	348.00	4,906,800	
マルマエ	5,700	921.00	5,249,700	
タツモ	6,500	1,137.00	7,390,500	
ナブテスコ	81,100	2,865.00	232,351,500	
三井海洋開発	14,700	1,398.00	20,550,600	
レオン自動機	13,500	1,191.00	16,078,500	
ＳＭＣ	43,600	48,810.00	2,128,116,000	
ホソカワミクロン	4,900	5,030.00	24,647,000	
ユニオンツール	5,200	2,635.00	13,702,000	
オイレス工業	17,800	1,348.00	23,994,400	
日精エー・エス・ビー機械	4,700	3,025.00	14,217,500	
サトーホールディングス	19,600	2,071.00	40,591,600	
技研製作所	12,100	4,055.00	49,065,500	
日本エアーテック	4,400	1,211.00	5,328,400	
カワタ	4,200	666.00	2,797,200	
日精樹脂工業	11,700	963.00	11,267,100	
オカダアイヨン	4,400	812.00	3,572,800	
ワイエイシイホールディングス	5,900	408.00	2,407,200	
小松製作所	630,000	1,962.00	1,236,060,000	
住友重機械工業	79,700	2,168.00	172,789,600	
日立建機	55,800	2,514.00	140,281,200	
日工	19,200	575.00	11,040,000	
巴工業	6,000	1,953.00	11,718,000	
井関農機	14,000	1,142.00	15,988,000	
ＴＯＷＡ	14,100	882.00	12,436,200	
丸山製作所	3,100	1,150.00	3,565,000	
北川鉄工所	6,300	1,540.00	9,702,000	

ローツェ	6,100	4,560.00	27,816,000	
タカキタ	5,000	517.00	2,585,000	
クボタ	738,000	1,263.50	932,463,000	
荏原実業	3,500	2,128.00	7,448,000	
三菱化工機	4,800	1,634.00	7,843,200	
月島機械	25,700	1,193.00	30,660,100	
帝国電機製作所	11,500	1,330.00	15,295,000	
新東工業	33,100	736.00	24,361,600	
澁谷工業	12,200	2,541.00	31,000,200	
アイチ　コーポレーション	24,200	661.00	15,996,200	
小森コーポレーション	35,400	723.00	25,594,200	
鶴見製作所	10,900	1,933.00	21,069,700	
住友精密工業	2,100	2,299.00	4,827,900	
日本ギア工業	4,500	236.00	1,062,000	
酒井重工業	2,700	2,075.00	5,602,500	
荏原製作所	57,600	2,223.00	128,044,800	
石井鐵工所	1,800	2,240.00	4,032,000	
酉島製作所	14,200	755.00	10,721,000	
北越工業	14,400	1,007.00	14,500,800	
ダイキン工業	177,200	13,290.00	2,354,988,000	
オルガノ	5,000	5,360.00	26,800,000	
トーヨーカネツ	6,100	1,898.00	11,577,800	
栗田工業	75,300	2,718.00	204,665,400	
椿本チエイン	19,900	2,412.00	47,998,800	
大同工業	6,800	618.00	4,202,400	
木村化工機	11,800	445.00	5,251,000	
アネスト岩田	21,700	882.00	19,139,400	
ダイフク	71,100	7,170.00	509,787,000	
サムコ	3,900	1,817.00	7,086,300	
加藤製作所	7,700	1,224.00	9,424,800	
油研工業	2,400	1,291.00	3,098,400	
タダノ	67,200	775.00	52,080,000	
フジテック	50,600	1,548.00	78,328,800	
ＣＫＤ	38,700	1,764.00	68,266,800	
キトー	10,600	1,002.00	10,621,200	
平和	38,800	1,780.00	69,064,000	
理想科学工業	12,300	1,461.00	17,970,300	
ＳＡＮＫＹＯ	31,000	3,030.00	93,930,000	
日本金銭機械	15,500	535.00	8,292,500	
マースグループホールディングス	8,900	1,652.00	14,702,800	
フクシマガリレイ	8,600	3,195.00	27,477,000	
オーイズミ	6,000	373.00	2,238,000	

ダイコク電機	6,400	1,142.00	7,308,800	
竹内製作所	23,300	1,413.00	32,922,900	
アマノ	36,400	2,400.00	87,360,000	
ＪＵＫＩ	19,400	585.00	11,349,000	
蛇の目ミシン工業	12,800	422.00	5,401,600	
マックス	21,300	1,532.00	32,631,600	
グローリー	35,800	2,349.00	84,094,200	
新晃工業	13,000	1,401.00	18,213,000	
大和冷機工業	20,200	903.00	18,240,600	
セガサミーホールディングス	138,000	1,302.00	179,676,000	
日本ピストンリング	5,100	1,147.00	5,849,700	
リケン	6,500	2,807.00	18,245,500	
ＴＰＲ	18,800	1,195.00	22,466,000	
ツバキ・ナカシマ	28,500	678.00	19,323,000	
ホシザキ	40,700	7,800.00	317,460,000	
大豊工業	11,500	525.00	6,037,500	
日本精工	262,000	686.00	179,732,000	
ＮＴＮ	322,300	190.00	61,237,000	
ジェイテクト	133,500	738.00	98,523,000	
不二越	12,900	2,849.00	36,752,100	
日本トムソン	41,500	356.00	14,774,000	
ＴＨＫ	81,000	2,420.00	196,020,000	
ユーシン精機	10,900	620.00	6,758,000	
前澤給装工業	5,100	1,995.00	10,174,500	
イーグル工業	17,300	660.00	11,418,000	
前澤工業	9,500	322.00	3,059,000	
日本ピラー工業	14,100	1,239.00	17,469,900	
キッツ	56,500	629.00	35,538,500	
マキタ	181,400	3,365.00	610,411,000	
日立造船	110,600	329.00	36,387,400	
三菱重工業	233,100	2,649.50	617,598,450	
ＩＨＩ	100,300	1,293.00	129,687,900	
スター精密	21,500	1,065.00	22,897,500	
日清紡ホールディングス	92,900	695.00	64,565,500	
イビデン	85,300	2,353.00	200,710,900	
コニカミノルタ	305,000	403.00	122,915,000	
ブラザー工業	170,100	1,701.00	289,340,100	
ミネベアミツミ	258,400	1,644.00	424,809,600	
日立製作所	668,400	3,067.00	2,049,982,800	
三菱電機	1,390,900	1,295.00	1,801,215,500	
富士電機	83,900	2,447.00	205,303,300	
東洋電機製造	5,100	1,255.00	6,400,500	

安川電機	149,700	3,255.00	487,273,500	
シンフォニアテクノロジー	18,100	904.00	16,362,400	
明電舎	25,600	1,546.00	39,577,600	
オリジン	3,800	1,428.00	5,426,400	
山洋電気	6,800	4,505.00	30,634,000	
デンヨー	11,900	1,855.00	22,074,500	
東芝テック	17,500	3,590.00	62,825,000	
芝浦メカトロニクス	2,600	2,563.00	6,663,800	
マブチモーター	38,600	3,200.00	123,520,000	
日本電産	334,800	5,704.00	1,909,699,200	
トレックス・セミコンダクター	8,400	1,057.00	8,878,800	
東光高岳	8,200	883.00	7,240,600	
ダイヘン	15,300	2,871.00	43,926,300	
ヤーマン	23,300	719.00	16,752,700	
ＪＶＣケンウッド	115,600	177.00	20,461,200	
ミマキエンジニアリング	13,500	392.00	5,292,000	
第一精工	5,900	2,181.00	12,867,900	
日新電機	32,700	972.00	31,784,400	
大崎電気工業	27,900	491.00	13,698,900	
オムロン	124,700	5,850.00	729,495,000	
日東工業	20,500	1,769.00	36,264,500	
ＩＤＥＣ	20,200	1,473.00	29,754,600	
正興電機製作所	3,700	990.00	3,663,000	
不二電機工業	2,100	1,215.00	2,551,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	46,700	1,419.00	66,267,300	
サクサホールディングス	3,300	1,679.00	5,540,700	
メルコホールディングス	5,000	2,661.00	13,305,000	
テクノメディカ	3,400	1,773.00	6,028,200	
日本電気	168,700	4,250.00	716,975,000	
富士通	134,100	10,565.00	1,416,766,500	
沖電気工業	56,600	976.00	55,241,600	
岩崎通信機	6,100	814.00	4,965,400	
電気興業	6,700	2,433.00	16,301,100	
サンケン電気	15,200	2,174.00	33,044,800	
ナカヨ	2,800	1,395.00	3,906,000	
アイホン	7,900	1,467.00	11,589,300	
ルネサスエレクトロニクス	665,800	476.00	316,920,800	
セイコーエプソン	172,700	1,053.00	181,853,100	
ワコム	94,800	379.00	35,929,200	
アルバック	25,600	2,897.00	74,163,200	
アクセル	6,400	728.00	4,659,200	
ＥＩＺＯ	10,800	3,270.00	35,316,000	

日本信号	35,500	970.00	34,435,000	
京三製作所	32,800	459.00	15,055,200	
能美防災	18,600	2,000.00	37,200,000	
ホーチキ	10,400	1,293.00	13,447,200	
星和電機	7,600	573.00	4,354,800	
エレコム	15,500	4,460.00	69,130,000	
パナソニック	1,589,300	780.60	1,240,607,580	
シャープ	161,000	1,185.00	190,785,000	
アンリツ	89,600	2,185.00	195,776,000	
富士通ゼネラル	37,800	1,716.00	64,864,800	
ソニー	880,100	6,878.00	6,053,327,800	
ＴＤＫ	67,200	8,830.00	593,376,000	
帝国通信工業	6,500	1,160.00	7,540,000	
タムラ製作所	46,800	392.00	18,345,600	
アルプスアルパイン	123,500	1,053.00	130,045,500	
池上通信機	4,400	820.00	3,608,000	
鈴木	7,400	741.00	5,483,400	
日本トリム	2,000	2,950.00	5,900,000	
ローランド　ディー．ジー．	8,000	1,293.00	10,344,000	
フォスター電機	14,700	1,142.00	16,787,400	
ＳＭＫ	3,600	2,436.00	8,769,600	
ヨコオ	9,200	2,461.00	22,641,200	
ホシデン	38,500	883.00	33,995,500	
ヒロセ電機	21,600	10,760.00	232,416,000	
日本航空電子工業	32,000	1,389.00	44,448,000	
ＴＯＡ	15,100	702.00	10,600,200	
マクセルホールディングス	30,400	1,002.00	30,460,800	
古野電気	18,400	813.00	14,959,200	
ユニデンホールディングス	3,900	1,807.00	7,047,300	
スミダコーポレーション	11,300	696.00	7,864,800	
アイコム	7,700	2,579.00	19,858,300	
リオン	6,000	2,386.00	14,316,000	
本多通信工業	13,000	403.00	5,239,000	
横河電機	127,700	1,393.00	177,886,100	
新電元工業	5,000	2,511.00	12,555,000	
アズビル	87,800	2,818.00	247,420,400	
東亜ディーケーケー	7,300	899.00	6,562,700	
日本光電工業	57,600	3,880.00	223,488,000	
チノー	4,900	1,243.00	6,090,700	
共和電業	14,800	380.00	5,624,000	
日本電子材料	5,600	907.00	5,079,200	
堀場製作所	27,600	5,380.00	148,488,000	

アドバンテスト	103,400	5,030.00	520,102,000	
小野測器	6,700	501.00	3,356,700	
エスペック	12,600	1,658.00	20,890,800	
キーエンス	126,000	36,940.00	4,654,440,000	
日置電機	7,400	3,015.00	22,311,000	
シスメックス	99,400	7,309.00	726,514,600	
日本マイクロニクス	24,700	820.00	20,254,000	
メガチップス	13,200	1,591.00	21,001,200	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,400	2,710.00	20,054,000	
澤藤電機	1,900	1,766.00	3,355,400	
原田工業	7,100	801.00	5,687,100	
コーセル	19,000	920.00	17,480,000	
イリソ電子工業	11,800	2,925.00	34,515,000	
オプテックスグループ	23,200	1,106.00	25,659,200	
千代田インテグレ	6,700	1,697.00	11,369,900	
アイ・オー・データ機器	5,000	995.00	4,975,000	
レーザーテック	61,100	6,200.00	378,820,000	
スタンレー電気	98,000	2,393.00	234,514,000	
岩崎電気	5,700	1,280.00	7,296,000	
ウシオ電機	77,200	1,026.00	79,207,200	
岡谷電機産業	12,200	344.00	4,196,800	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	14,100	335.00	4,723,500	
エノモト	4,600	929.00	4,273,400	
日本セラミック	14,300	1,891.00	27,041,300	
遠藤照明	7,800	547.00	4,266,600	
古河電池	10,700	559.00	5,981,300	
双信電機	8,000	324.00	2,592,000	
山一電機	10,400	1,407.00	14,632,800	
図研	9,200	2,250.00	20,700,000	
日本電子	27,600	2,965.00	81,834,000	
カシオ計算機	123,100	1,719.00	211,608,900	
ファナック	132,200	14,820.00	1,959,204,000	
日本シイエムケイ	33,700	407.00	13,715,900	
エンプラス	7,300	2,290.00	16,717,000	
大真空	5,300	1,827.00	9,683,100	
ローム	61,800	6,630.00	409,734,000	
浜松ホトニクス	99,800	4,635.00	462,573,000	
三井ハイテック	15,700	1,147.00	18,007,900	
新光電気工業	47,100	1,186.00	55,860,600	
京セラ	195,700	5,908.00	1,156,195,600	
太陽誘電	62,000	2,922.00	181,164,000	
村田製作所	408,600	5,781.00	2,362,116,600	

双葉電子工業	22,400	991.00	22,198,400	
北陸電気工業	6,100	930.00	5,673,000	
ニチコン	47,800	661.00	31,595,800	
日本ケミコン	10,600	1,114.00	11,808,400	
ＫＯＡ	21,400	900.00	19,260,000	
市光工業	21,700	445.00	9,656,500	
小糸製作所	83,400	3,950.00	329,430,000	
ミツバ	26,500	436.00	11,554,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	24,200	4,615.00	111,683,000	
キヤノン電子	14,800	1,547.00	22,895,600	
キヤノン	748,800	2,243.00	1,679,558,400	
リコー	354,000	741.00	262,314,000	
象印マホービン	41,000	1,529.00	62,689,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,000	1,401.00	2,802,000	
東京エレクトロン	88,300	23,245.00	2,052,533,500	
トヨタ紡織	40,600	1,261.00	51,196,600	
芦森工業	2,900	840.00	2,436,000	
ユニプレス	27,000	915.00	24,705,000	
豊田自動織機	112,600	5,290.00	595,654,000	
モリタホールディングス	24,400	1,636.00	39,918,400	
三櫻工業	17,700	710.00	12,567,000	
デンソー	306,200	3,744.00	1,146,412,800	
東海理化電機製作所	36,700	1,319.00	48,407,300	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	50,200	553.00	27,760,600	
川崎重工業	108,200	1,492.00	161,434,400	
名村造船所	44,800	188.00	8,422,400	
日本車輌製造	5,100	2,691.00	13,724,100	
三菱ロジスネクスト	18,400	944.00	17,369,600	
近畿車輛	2,100	1,092.00	2,293,200	
日産自動車	1,640,400	366.20	600,714,480	
いすゞ自動車	403,000	748.30	301,564,900	
トヨタ自動車	1,551,900	6,635.00	10,296,856,500	
日野自動車	173,700	598.00	103,872,600	
三菱自動車工業	514,800	298.00	153,410,400	
エフテック	9,800	440.00	4,312,000	
レシップホールディングス	5,400	430.00	2,322,000	
ＧＭＢ	2,600	628.00	1,632,800	
ファルテック	2,500	606.00	1,515,000	
武蔵精密工業	31,000	844.00	26,164,000	
日産車体	27,200	799.00	21,732,800	
新明和工業	37,500	1,103.00	41,362,500	
極東開発工業	25,800	1,237.00	31,914,600	

日信工業	28,300	2,170.00	61,411,000	
トピー工業	11,500	1,200.00	13,800,000	
ティラド	5,100	1,257.00	6,410,700	
曙ブレーキ工業	76,300	175.00	13,352,500	
タチエス	22,900	959.00	21,961,100	
ＮＯＫ	74,800	1,104.00	82,579,200	
フタバ産業	38,800	483.00	18,740,400	
ＫＹＢ	15,600	2,059.00	32,120,400	
大同メタル工業	26,800	518.00	13,882,400	
プレス工業	69,200	250.00	17,300,000	
ミクニ	17,900	238.00	4,260,200	
太平洋工業	29,200	828.00	24,177,600	
ケーヒン	32,000	2,504.00	80,128,000	
河西工業	18,900	483.00	9,128,700	
アイシン精機	114,500	2,931.00	335,599,500	
マツダ	409,200	562.00	229,970,400	
今仙電機製作所	13,000	711.00	9,243,000	
本田技研工業	1,095,100	2,451.50	2,684,637,650	
スズキ	275,700	3,205.00	883,618,500	
ＳＵＢＡＲＵ	431,800	2,075.00	895,985,000	
安永	6,800	978.00	6,650,400	
ヤマハ発動機	181,400	1,271.00	230,559,400	
ショーワ	32,900	2,214.00	72,840,600	
ＴＢＫ	16,600	452.00	7,503,200	
エクセディ	18,900	1,627.00	30,750,300	
豊田合成	44,900	1,824.00	81,897,600	
愛三工業	21,900	554.00	12,132,600	
盟和産業	2,200	900.00	1,980,000	
日本プラスト	11,000	425.00	4,675,000	
ヨロズ	13,000	1,056.00	13,728,000	
エフ・シー・シー	22,800	1,504.00	34,291,200	
シマノ	52,100	16,120.00	839,852,000	
テイ・エス　テック	32,300	2,790.00	90,117,000	
ジャムコ	7,100	650.00	4,615,000	
テルモ	393,600	3,568.00	1,404,364,800	
クリエートメディック	4,600	1,025.00	4,715,000	
日機装	41,700	820.00	34,194,000	
日本エム・ディ・エム	8,000	1,560.00	12,480,000	
島津製作所	166,200	2,809.00	466,855,800	
ＪＭＳ	11,800	856.00	10,100,800	
長野計器	10,100	763.00	7,706,300	
ブイ・テクノロジー	6,500	3,520.00	22,880,000	

東京計器	8,900	735.00	6,541,500	
愛知時計電機	1,800	4,370.00	7,866,000	
インターアクション	7,500	2,167.00	16,252,500	
オーバル	12,600	211.00	2,658,600	
東京精密	25,200	3,225.00	81,270,000	
マニー	55,400	2,312.00	128,084,800	
ニコン	225,100	956.00	215,195,600	
トプコン	70,100	824.00	57,762,400	
オリンパス	769,600	1,697.00	1,306,011,200	
理研計器	12,300	2,031.00	24,981,300	
タムロン	11,200	1,757.00	19,678,400	
ＨＯＹＡ	277,800	9,793.00	2,720,495,400	
シード	6,000	780.00	4,680,000	
ノーリツ鋼機	9,400	1,087.00	10,217,800	
エー・アンド・デイ	12,700	735.00	9,334,500	
朝日インテック	118,100	2,849.00	336,466,900	
シチズン時計	163,000	356.00	58,028,000	
リズム時計工業	4,400	620.00	2,728,000	
大研医器	9,700	660.00	6,402,000	
メニコン	19,700	5,130.00	101,061,000	
シンシア	1,600	370.00	592,000	
松風	6,300	1,562.00	9,840,600	
セイコーホールディングス	19,700	1,655.00	32,603,500	
ニプロ	96,300	1,191.00	114,693,300	
中本パックス	3,500	1,489.00	5,211,500	
スノーピーク	7,200	787.00	5,666,400	
パラマウントベッドホールディングス	14,700	4,325.00	63,577,500	
トランザクション	8,900	987.00	8,784,300	
粧美堂	4,100	345.00	1,414,500	
ニホンフラッシュ	13,000	1,173.00	15,249,000	
前田工繊	15,300	1,969.00	30,125,700	
永大産業	18,200	264.00	4,804,800	
アートネイチャー	14,900	659.00	9,819,100	
バンダイナムコホールディングス	143,800	5,409.00	777,814,200	
アイフィスジャパン	3,500	668.00	2,338,000	
共立印刷	23,200	151.00	3,503,200	
ＳＨＯＥＩ	13,400	2,038.00	27,309,200	
フランスベッドホールディングス	19,700	855.00	16,843,500	
パイロットコーポレーション	22,700	3,490.00	79,223,000	
萩原工業	7,700	1,272.00	9,794,400	
トッパン・フォームズ	29,800	958.00	28,548,400	
フジシールインターナショナル	31,200	1,800.00	56,160,000	

タカラトミー	62,400	842.00	52,540,800	
廣済堂	9,700	844.00	8,186,800	
エステールホールディングス	3,700	581.00	2,149,700	
アーク	53,100	89.00	4,725,900	
タカノ	5,400	713.00	3,850,200	
プロネクサス	11,900	1,003.00	11,935,700	
ホクシン	8,600	115.00	989,000	
ウッドワン	4,700	1,006.00	4,728,200	
大建工業	9,400	1,604.00	15,077,600	
凸版印刷	196,300	1,570.00	308,191,000	
大日本印刷	182,000	2,262.00	411,684,000	
共同印刷	4,300	2,757.00	11,855,100	
ＮＩＳＳＨＡ	28,500	726.00	20,691,000	
光村印刷	1,200	1,565.00	1,878,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	6,700	1,787.00	11,972,900	
アシックス	114,800	999.00	114,685,200	
ツツミ	4,300	1,595.00	6,858,500	
小松ウオール工業	4,200	1,736.00	7,291,200	
ヤマハ	82,700	4,260.00	352,302,000	
河合楽器製作所	4,300	2,545.00	10,943,500	
クリナップ	12,900	531.00	6,849,900	
ピジョン	84,100	4,035.00	339,343,500	
オリバー	2,900	2,744.00	7,957,600	
兼松サステック	900	1,457.00	1,311,300	
キングジム	11,600	838.00	9,720,800	
リンテック	33,100	2,298.00	76,063,800	
イトーキ	29,600	297.00	8,791,200	
任天堂	85,300	45,930.00	3,917,829,000	
三菱鉛筆	22,900	1,323.00	30,296,700	
タカラスタンダード	28,700	1,537.00	44,111,900	
コクヨ	66,700	1,362.00	90,845,400	
ナカバヤシ	13,700	530.00	7,261,000	
グローブライド	6,200	1,719.00	10,657,800	
オカムラ	48,500	784.00	38,024,000	
美津濃	12,600	1,756.00	22,125,600	
東京電力ホールディングス	1,110,300	372.00	413,031,600	
中部電力	425,500	1,529.50	650,802,250	
関西電力	527,000	1,170.50	616,853,500	
中国電力	200,600	1,501.00	301,100,600	
北陸電力	127,200	713.00	90,693,600	
東北電力	347,500	1,050.00	364,875,000	
四国電力	125,200	833.00	104,291,600	

九州電力	286,700	899.00	257,743,300	
北海道電力	130,200	431.00	56,116,200	
沖縄電力	25,800	1,894.00	48,865,200	
電源開発	110,700	2,162.00	239,333,400	
エフオン	7,500	474.00	3,555,000	
イーレックス	19,800	1,442.00	28,551,600	
レノバ	23,200	1,045.00	24,244,000	
東京瓦斯	267,500	2,613.50	699,111,250	
大阪瓦斯	269,900	2,122.00	572,727,800	
東邦瓦斯	68,400	5,480.00	374,832,000	
北海道瓦斯	7,500	1,484.00	11,130,000	
広島ガス	28,600	341.00	9,752,600	
西部瓦斯	15,700	2,620.00	41,134,000	
静岡ガス	39,500	953.00	37,643,500	
メタウォーター	6,700	4,025.00	26,967,500	
ＳＢＳホールディングス	12,000	1,757.00	21,084,000	
東武鉄道	146,700	3,580.00	525,186,000	
相鉄ホールディングス	44,500	2,737.00	121,796,500	
東急	350,800	1,645.00	577,066,000	
京浜急行電鉄	178,600	1,800.00	321,480,000	
小田急電鉄	206,900	2,387.00	493,870,300	
京王電鉄	72,200	6,100.00	440,420,000	
京成電鉄	96,800	3,170.00	306,856,000	
富士急行	19,000	2,861.00	54,359,000	
新京成電鉄	3,600	2,025.00	7,290,000	
東日本旅客鉄道	244,800	8,134.00	1,991,203,200	
西日本旅客鉄道	123,900	6,665.00	825,793,500	
東海旅客鉄道	115,600	17,185.00	1,986,586,000	
西武ホールディングス	186,600	1,251.00	233,436,600	
鴻池運輸	22,100	1,144.00	25,282,400	
西日本鉄道	38,600	2,511.00	96,924,600	
ハマキョウレックス	10,700	2,820.00	30,174,000	
サカイ引越センター	7,300	5,500.00	40,150,000	
近鉄グループホールディングス	131,700	5,090.00	670,353,000	
阪急阪神ホールディングス	175,700	3,655.00	642,183,500	
南海電気鉄道	62,400	2,323.00	144,955,200	
京阪ホールディングス	58,700	4,820.00	282,934,000	
神戸電鉄	3,100	3,680.00	11,408,000	
名古屋鉄道	108,300	3,055.00	330,856,500	
山陽電気鉄道	9,400	1,998.00	18,781,200	
日本通運	46,600	5,040.00	234,864,000	
ヤマトホールディングス	230,900	1,901.00	438,940,900	

山九	36,600	3,930.00	143,838,000	
丸運	7,500	223.00	1,672,500	
丸全昭和運輸	10,700	2,327.00	24,898,900	
センコーグループホールディングス	72,600	842.00	61,129,200	
トナミホールディングス	3,200	4,795.00	15,344,000	
ニッコンホールディングス	47,100	2,028.00	95,518,800	
日本石油輸送	1,400	2,781.00	3,893,400	
福山通運	16,900	3,660.00	61,854,000	
セイノーホールディングス	98,700	1,200.00	118,440,000	
エスライン	4,000	868.00	3,472,000	
神奈川中央交通	3,300	3,960.00	13,068,000	
日立物流	24,100	2,444.00	58,900,400	
丸和運輸機関	13,900	2,896.00	40,254,400	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	13,300	1,255.00	16,691,500	
九州旅客鉄道	115,500	3,000.00	346,500,000	
ＳＧホールディングス	138,300	2,880.00	398,304,000	
日本郵船	110,800	1,332.00	147,585,600	
商船三井	83,800	1,756.00	147,152,800	
川崎汽船	40,600	974.00	39,544,400	
ＮＳユナイテッド海運	7,900	1,349.00	10,657,100	
飯野海運	65,300	302.00	19,720,600	
共栄タンカー	3,400	896.00	3,046,400	
乾汽船	7,600	1,192.00	9,059,200	
日本航空	237,100	1,940.00	459,974,000	
ＡＮＡホールディングス	240,800	2,483.00	597,906,400	
パスコ	2,600	1,480.00	3,848,000	
トランコム	3,700	7,090.00	26,233,000	
日新	11,400	1,822.00	20,770,800	
三菱倉庫	41,800	2,233.00	93,339,400	
三井倉庫ホールディングス	15,000	1,408.00	21,120,000	
住友倉庫	48,500	1,212.00	58,782,000	
澁澤倉庫	7,200	2,049.00	14,752,800	
東陽倉庫	23,800	326.00	7,758,800	
日本トランスシティ	29,000	483.00	14,007,000	
ケイヒン	2,500	1,163.00	2,907,500	
中央倉庫	8,000	1,047.00	8,376,000	
川西倉庫	2,400	973.00	2,335,200	
安田倉庫	10,800	854.00	9,223,200	
ファイズホールディングス	2,800	1,232.00	3,449,600	
東洋埠頭	4,000	1,249.00	4,996,000	
宇徳	11,300	449.00	5,073,700	
上組	73,500	1,837.00	135,019,500	

サンリツ	3,100	547.00	1,695,700	
キムラユニティー	3,500	975.00	3,412,500	
キユーソー流通システム	3,300	1,640.00	5,412,000	
近鉄エクスプレス	28,000	1,488.00	41,664,000	
東海運	7,500	248.00	1,860,000	
エーアイテイー	9,300	709.00	6,593,700	
内外トランスライン	4,600	1,113.00	5,119,800	
日本コンセプト	4,200	1,456.00	6,115,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	13,000	4,725.00	61,425,000	
クロスキャット	3,800	1,017.00	3,864,600	
システナ	48,900	1,466.00	71,687,400	
デジタルアーツ	6,800	6,310.00	42,908,000	
日鉄ソリューションズ	20,500	2,775.00	56,887,500	
キューブシステム	7,700	660.00	5,082,000	
エイジア	2,700	1,290.00	3,483,000	
コア	6,000	1,220.00	7,320,000	
ラクーンホールディングス	6,500	714.00	4,641,000	
ソリトンシステムズ	6,200	1,346.00	8,345,200	
ソフトクリエイトホールディングス	6,100	1,711.00	10,437,100	
ＴＩＳ	136,600	2,052.00	280,303,200	
ネオス	5,500	695.00	3,822,500	
電算システム	5,300	2,450.00	12,985,000	
グリー	84,300	416.00	35,068,800	
コーエーテクモホールディングス	28,000	2,842.00	79,576,000	
三菱総合研究所	5,900	3,410.00	20,119,000	
電算	1,600	1,993.00	3,188,800	
ＡＧＳ	8,100	750.00	6,075,000	
ファインデックス	11,800	851.00	10,041,800	
ブレインパッド	3,500	5,310.00	18,585,000	
ＫＬａｂ	26,400	704.00	18,585,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,800	846.00	14,212,800	
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	1,685.00	3,538,500	
ネクソン	380,700	1,841.00	700,868,700	
アイスタイル	39,300	282.00	11,082,600	
エムアップホールディングス	4,000	2,654.00	10,616,000	
エイチーム	9,800	717.00	7,026,600	
エニグモ	10,000	892.00	8,920,000	
テクノスジャパン	11,300	390.00	4,407,000	
コロプラ	45,100	880.00	39,688,000	
ブロードリーフ	68,200	497.00	33,895,400	
クロス・マーケティンググループ	7,000	279.00	1,953,000	
デジタルハーツホールディングス	7,500	816.00	6,120,000	

システム情報	7,200	839.00	6,040,800	
メディアドゥホールディングス	4,400	3,810.00	16,764,000	
じげん	34,600	309.00	10,691,400	
エンカレッジ・テクノロジ	2,600	691.00	1,796,600	
サイバーリンクス	2,300	1,106.00	2,543,800	
フィックスターズ	14,700	1,081.00	15,890,700	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,900	851.00	5,871,900	
オプティム	7,300	2,556.00	18,658,800	
セレス	4,800	795.00	3,816,000	
ＳＨＩＦＴ	3,600	9,430.00	33,948,000	
ティーガイア	12,200	2,128.00	25,961,600	
セック	2,100	2,980.00	6,258,000	
日本アジアグループ	14,400	239.00	3,441,600	
テクマトリックス	9,700	2,647.00	25,675,900	
プロシップ	4,200	1,129.00	4,741,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	33,100	1,638.00	54,217,800	
GMOペイメントゲートウェイ	22,500	9,300.00	209,250,000	
ザッパラス	6,800	329.00	2,237,200	
システムリサーチ	3,800	1,549.00	5,886,200	
インターネットイニシアティブ	20,300	3,920.00	79,576,000	
さくらインターネット	15,100	621.00	9,377,100	
ヴィンクス	4,100	889.00	3,644,900	
GMOクラウド	2,600	2,685.00	6,981,000	
ＳＲＡホールディングス	7,400	2,168.00	16,043,200	
システムインテグレータ	4,700	740.00	3,478,000	
朝日ネット	10,000	860.00	8,600,000	
ｅＢＡＳＥ	16,600	960.00	15,936,000	
アバント	10,000	928.00	9,280,000	
アドソル日進	4,900	2,401.00	11,764,900	
フリービット	7,400	770.00	5,698,000	
コムチュア	15,400	2,358.00	36,313,200	
サイバーコム	2,600	1,750.00	4,550,000	
アステリア	9,000	640.00	5,760,000	
アイル	5,100	1,555.00	7,930,500	
マークラインズ	7,000	1,760.00	12,320,000	
メディカル・データ・ビジョン	10,700	775.00	8,292,500	
ショーケース	3,800	499.00	1,896,200	
モバイルファクトリー	3,300	1,152.00	3,801,600	
テラスカイ	5,000	2,425.00	12,125,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,500	1,373.00	7,551,500	
ＰＣＩホールディングス	5,800	870.00	5,046,000	
パイプドＨＤ	2,000	1,112.00	2,224,000	

アイビーシー	2,800	942.00	2,637,600	
ネオジャパン	2,800	1,360.00	3,808,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,300	2,171.00	2,822,300	
ランドコンピュータ	2,300	1,027.00	2,362,100	
ダブルスタンダード	1,800	4,220.00	7,596,000	
オープンドア	7,100	935.00	6,638,500	
マイネット	4,400	716.00	3,150,400	
アカツキ	4,900	4,100.00	20,090,000	
ベネフィットジャパン	1,200	1,453.00	1,743,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,200	1,339.00	4,284,800	
ＬＩＮＥ	31,300	5,240.00	164,012,000	
カナミックネットワーク	8,800	703.00	6,186,400	
ノムラシステムコーポレーション	3,700	343.00	1,269,100	
チェンジ	2,800	3,710.00	10,388,000	
シンクロ・フード	7,100	225.00	1,597,500	
オークネット	8,600	1,063.00	9,141,800	
セグエグループ	2,500	991.00	2,477,500	
エイトレッド	1,900	1,474.00	2,800,600	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	14,400	472.00	6,796,800	
マクロミル	28,300	688.00	19,470,400	
ビーグリー	2,900	1,336.00	3,874,400	
オロ	3,700	3,290.00	12,173,000	
ユーザーローカル	1,100	2,961.00	3,257,100	
テモナ	2,300	704.00	1,619,200	
ニーズウェル	2,100	641.00	1,346,100	
サインポスト	2,300	1,240.00	2,852,000	
ソルクシーズ	6,300	601.00	3,786,300	
フェイス	5,200	630.00	3,276,000	
プロトコーポレーション	12,500	868.00	10,850,000	
ハイマックス	1,700	1,901.00	3,231,700	
野村総合研究所	193,600	2,595.00	502,392,000	
サイバネットシステム	10,100	630.00	6,363,000	
ＣＥホールディングス	8,400	466.00	3,914,400	
日本システム技術	2,400	1,191.00	2,858,400	
インテージホールディングス	17,400	753.00	13,102,200	
東邦システムサイエンス	3,900	902.00	3,517,800	
ソースネクスト	65,500	325.00	21,287,500	
インフォコム	15,000	2,927.00	43,905,000	
ＨＥＲＯＺ	1,500	3,995.00	5,992,500	
ラクスル	7,400	2,322.00	17,182,800	
ＦＩＧ	15,800	241.00	3,807,800	
システムサポート	1,200	2,767.00	3,320,400	

イーソル	5,100	1,169.00	5,961,900	
アルテリア・ネットワークス	15,200	2,158.00	32,801,600	
東海ソフト	1,200	1,226.00	1,471,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,400	959.00	3,260,600	
フォーカスシステムズ	8,800	729.00	6,415,200	
クレスコ	8,500	1,390.00	11,815,000	
フジ・メディア・ホールディングス	131,700	1,049.00	138,153,300	
オービック	47,300	15,190.00	718,487,000	
ジャストシステム	22,200	6,500.00	144,300,000	
ＴＤＣソフト	12,300	844.00	10,381,200	
Ｚホールディングス	1,874,900	393.00	736,835,700	
トレンドマイクロ	60,700	5,030.00	305,321,000	
ＩＤホールディングス	5,400	1,396.00	7,538,400	
日本オラクル	27,700	10,360.00	286,972,000	
アルファシステムズ	4,300	2,893.00	12,439,900	
フューチャー	16,700	1,563.00	26,102,100	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,100	1,062.00	9,664,200	
ＳＢテクノロジー	5,000	2,675.00	13,375,000	
トーセ	4,000	760.00	3,040,000	
オービックビジネスコンサルタント	14,000	4,205.00	58,870,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	62,300	3,345.00	208,393,500	
アイティフォー	16,900	637.00	10,765,300	
東計電算	2,100	4,220.00	8,862,000	
エックスネット	2,400	892.00	2,140,800	
大塚商会	73,900	4,915.00	363,218,500	
サイボウズ	16,100	2,230.00	35,903,000	
ソフトブレーン	8,600	443.00	3,809,800	
電通国際情報サービス	8,500	4,350.00	36,975,000	
ＡＣＣＥＳＳ	13,100	911.00	11,934,100	
デジタルガレージ	24,600	3,770.00	92,742,000	
ＥＭシステムズ	19,500	829.00	16,165,500	
ウェザーニューズ	4,700	3,495.00	16,426,500	
ＣＩＪ	9,600	790.00	7,584,000	
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,430.00	4,131,000	
日本エンタープライズ	15,000	239.00	3,585,000	
WOWOW	6,600	2,406.00	15,879,600	
スカラ	9,600	514.00	4,934,400	
インテリジェント　ウェイブ	6,500	584.00	3,796,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	12,300	366.00	4,501,800	
ネットワンシステムズ	52,100	2,751.00	143,327,100	
システムソフト	36,000	75.00	2,700,000	
アルゴグラフィックス	11,700	3,410.00	39,897,000	

マーベラス	21,300	537.00	11,438,100	
エイベックス	23,700	803.00	19,031,100	
日本ユニシス	42,700	3,045.00	130,021,500	
兼松エレクトロニクス	7,500	3,440.00	25,800,000	
東京放送ホールディングス	83,100	1,599.00	132,876,900	
日本テレビホールディングス	114,100	1,173.00	133,839,300	
朝日放送グループホールディングス	13,900	681.00	9,465,900	
テレビ朝日ホールディングス	37,700	1,566.00	59,038,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	90,400	393.00	35,527,200	
テレビ東京ホールディングス	11,300	2,245.00	25,368,500	
日本ＢＳ放送	4,900	1,004.00	4,919,600	
ビジョン	13,100	824.00	10,794,400	
スマートバリュー	3,800	868.00	3,298,400	
ワイヤレスゲート	6,900	492.00	3,394,800	
コネクシオ	7,900	1,374.00	10,854,600	
クロップス	3,000	508.00	1,524,000	
日本電信電話	1,824,500	2,510.00	4,579,495,000	
ＫＤＤＩ	1,017,200	3,144.00	3,198,076,800	
ソフトバンク	1,240,500	1,381.50	1,713,750,750	
光通信	14,100	20,770.00	292,857,000	
ＮＴＴドコモ	1,008,300	3,220.00	3,246,726,000	
エムティーアイ	13,700	570.00	7,809,000	
GMOインターネット	53,900	2,355.00	126,934,500	
ファイバーゲート	3,500	1,287.00	4,504,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,700	481.00	2,260,700	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	36,900	1,566.00	57,785,400	
学研ホールディングス	18,500	1,805.00	33,392,500	
ゼンリン	27,500	1,071.00	29,452,500	
昭文社ホールディングス	7,000	390.00	2,730,000	
インプレスホールディングス	11,300	146.00	1,649,800	
アイネット	7,200	1,508.00	10,857,600	
松竹	9,100	11,490.00	104,559,000	
東宝	80,600	3,475.00	280,085,000	
東映	5,100	13,560.00	69,156,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	363,600	1,071.00	389,415,600	
ピー・シー・エー	1,800	3,295.00	5,931,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,746.00	6,590,400	
ＤＴＳ	30,600	1,960.00	59,976,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58,300	4,815.00	280,714,500	
シーイーシー	14,800	1,588.00	23,502,400	
カプコン	64,400	3,400.00	218,960,000	
アイ・エス・ビー	2,800	1,684.00	4,715,200	

ジャステック	8,900	1,069.00	9,514,100	
ＳＣＳＫ	31,500	5,410.00	170,415,000	
日本システムウエア	4,600	1,949.00	8,965,400	
アイネス	13,600	1,374.00	18,686,400	
ＴＫＣ	11,600	4,855.00	56,318,000	
富士ソフト	17,500	3,785.00	66,237,500	
ＮＳＤ	44,000	1,574.00	69,256,000	
コナミホールディングス	49,700	3,270.00	162,519,000	
福井コンピュータホールディングス	5,500	2,605.00	14,327,500	
ＪＢＣＣホールディングス	9,400	1,879.00	17,662,600	
ミロク情報サービス	12,100	2,600.00	31,460,000	
ソフトバンクグループ	1,083,000	4,790.00	5,187,570,000	
ホウスイ	1,100	751.00	826,100	
高千穂交易	5,300	909.00	4,817,700	
伊藤忠食品	3,400	4,370.00	14,858,000	
エレマテック	12,800	797.00	10,201,600	
ＪＡＬＵＸ	3,900	1,560.00	6,084,000	
あらた	10,900	4,300.00	46,870,000	
トーメンデバイス	2,100	3,460.00	7,266,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,000	2,326.00	11,630,000	
フィールズ	10,500	328.00	3,444,000	
双日	756,600	250.00	189,150,000	
アルフレッサ　ホールディングス	152,200	2,122.00	322,968,400	
横浜冷凍	38,400	871.00	33,446,400	
ラサ商事	7,300	831.00	6,066,300	
アルコニックス	14,600	1,072.00	15,651,200	
神戸物産	47,300	5,410.00	255,893,000	
あい　ホールディングス	19,600	1,354.00	26,538,400	
ディーブイエックス	4,900	867.00	4,248,300	
ダイワボウホールディングス	11,700	6,560.00	76,752,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	32,700	1,394.00	45,583,800	
ラクト・ジャパン	5,100	3,205.00	16,345,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,800	1,090.00	28,122,000	
八洲電機	10,600	807.00	8,554,200	
メディアスホールディングス	7,800	913.00	7,121,400	
レスターホールディングス	14,300	1,682.00	24,052,600	
ジューテックホールディングス	3,100	975.00	3,022,500	
大光	5,900	654.00	3,858,600	
ＯＣＨＩホールディングス	4,000	1,400.00	5,600,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	72,400	933.00	67,549,200	
黒谷	3,200	406.00	1,299,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,400	701.00	1,682,400	

三洋貿易	13,800	849.00	11,716,200	
ビューティガレージ	2,200	1,580.00	3,476,000	
ウイン・パートナーズ	9,900	906.00	8,969,400	
ミタチ産業	4,100	562.00	2,304,200	
シップヘルスケアホールディングス	22,000	4,775.00	105,050,000	
明治電機工業	4,300	1,247.00	5,362,100	
デリカフーズホールディングス	4,900	642.00	3,145,800	
スターティアホールディングス	3,100	606.00	1,878,600	
コメダホールディングス	29,900	1,619.00	48,408,100	
ピーバンドットコム	1,100	930.00	1,023,000	
アセンテック	1,100	3,265.00	3,591,500	
富士興産	4,200	414.00	1,738,800	
協栄産業	1,500	1,070.00	1,605,000	
小野建	12,300	1,132.00	13,923,600	
南陽	3,000	1,249.00	3,747,000	
佐鳥電機	9,300	838.00	7,793,400	
エコートレーディング	3,200	487.00	1,558,400	
伯東	8,400	931.00	7,820,400	
コンドーテック	10,600	886.00	9,391,600	
中山福	7,900	477.00	3,768,300	
ナガイレーベン	19,800	2,712.00	53,697,600	
三菱食品	15,100	2,666.00	40,256,600	
松田産業	10,000	1,328.00	13,280,000	
第一興商	20,400	3,060.00	62,424,000	
メディパルホールディングス	147,800	2,055.00	303,729,000	
ＳＰＫ	5,900	1,240.00	7,316,000	
萩原電気ホールディングス	5,100	1,993.00	10,164,300	
アズワン	8,900	9,250.00	82,325,000	
スズデン	4,800	1,041.00	4,996,800	
尾家産業	4,000	1,432.00	5,728,000	
シモジマ	8,400	1,201.00	10,088,400	
ドウシシャ	12,900	1,272.00	16,408,800	
小津産業	3,000	1,843.00	5,529,000	
高速	8,200	1,295.00	10,619,000	
たけびし	4,800	1,274.00	6,115,200	
リックス	3,100	1,426.00	4,420,600	
丸文	12,200	501.00	6,112,200	
ハピネット	11,400	1,071.00	12,209,400	
橋本総業ホールディングス	2,800	1,728.00	4,838,400	
日本ライフライン	40,600	1,224.00	49,694,400	
タカショー	6,700	473.00	3,169,100	
マルカ	4,800	1,649.00	7,915,200	

ＩＤＯＭ	37,000	449.00	16,613,000	
進和	8,100	1,725.00	13,972,500	
エスケイジャパン	3,000	275.00	825,000	
ダイトロン	5,800	1,470.00	8,526,000	
シークス	17,400	826.00	14,372,400	
田中商事	4,200	666.00	2,797,200	
オーハシテクニカ	7,700	1,360.00	10,472,000	
白銅	4,900	1,198.00	5,870,200	
伊藤忠商事	958,200	2,127.50	2,038,570,500	
丸紅	1,425,900	495.40	706,390,860	
高島	2,200	1,525.00	3,355,000	
長瀬産業	77,000	1,245.00	95,865,000	
蝶理	8,800	1,528.00	13,446,400	
豊田通商	152,900	2,390.00	365,431,000	
三共生興	20,800	457.00	9,505,600	
兼松	51,100	1,055.00	53,910,500	
ツカモトコーポレーション	2,500	1,089.00	2,722,500	
三井物産	1,204,100	1,470.00	1,770,027,000	
日本紙パルプ商事	7,800	3,520.00	27,456,000	
カメイ	17,900	982.00	17,577,800	
東都水産	1,700	2,683.00	4,561,100	
ＯＵＧホールディングス	2,200	2,654.00	5,838,800	
スターゼン	5,100	4,175.00	21,292,500	
山善	53,500	875.00	46,812,500	
椿本興業	2,500	3,315.00	8,287,500	
住友商事	864,300	1,177.50	1,017,713,250	
内田洋行	5,900	4,620.00	27,258,000	
三菱商事	961,300	2,185.00	2,100,440,500	
第一実業	6,700	3,495.00	23,416,500	
キヤノンマーケティングジャパン	39,200	2,086.00	81,771,200	
西華産業	7,800	1,086.00	8,470,800	
佐藤商事	11,300	769.00	8,689,700	
菱洋エレクトロ	13,900	2,465.00	34,263,500	
東京産業	12,400	488.00	6,051,200	
ユアサ商事	13,000	2,929.00	38,077,000	
神鋼商事	3,500	1,688.00	5,908,000	
トルク	8,300	299.00	2,481,700	
阪和興業	25,600	1,612.00	41,267,200	
正栄食品工業	8,900	3,820.00	33,998,000	
カナデン	11,100	1,251.00	13,886,100	
菱電商事	9,900	1,295.00	12,820,500	
フルサト工業	7,600	1,323.00	10,054,800	

岩谷産業	30,400	3,695.00	112,328,000	
ナイス	5,800	804.00	4,663,200	
昭光通商	4,400	570.00	2,508,000	
ニチモウ	2,100	1,672.00	3,511,200	
極東貿易	3,900	1,230.00	4,797,000	
イワキ	18,000	420.00	7,560,000	
三愛石油	33,700	1,087.00	36,631,900	
稲畑産業	30,200	1,163.00	35,122,600	
ＧＳＩクレオス	3,400	1,005.00	3,417,000	
明和産業	12,700	473.00	6,007,100	
クワザワ	4,900	463.00	2,268,700	
ワキタ	29,200	976.00	28,499,200	
東邦ホールディングス	44,000	2,223.00	97,812,000	
サンゲツ	37,300	1,574.00	58,710,200	
ミツウロコグループホールディングス	20,200	1,070.00	21,614,000	
シナネンホールディングス	5,600	2,760.00	15,456,000	
伊藤忠エネクス	30,300	813.00	24,633,900	
サンリオ	38,500	1,559.00	60,021,500	
サンワテクノス	9,700	797.00	7,730,900	
リョーサン	15,100	2,309.00	34,865,900	
新光商事	21,500	863.00	18,554,500	
トーホー	6,200	1,689.00	10,471,800	
三信電気	7,400	1,449.00	10,722,600	
東陽テクニカ	15,800	994.00	15,705,200	
モスフードサービス	18,000	2,707.00	48,726,000	
加賀電子	13,600	1,827.00	24,847,200	
ソーダニッカ	14,200	604.00	8,576,800	
立花エレテック	10,100	1,470.00	14,847,000	
フォーバル	6,000	1,068.00	6,408,000	
ＰＡＬＴＡＣ	22,000	5,500.00	121,000,000	
三谷産業	18,100	320.00	5,792,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,500	1,809.00	4,522,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,775.00	2,130,000	
国際紙パルプ商事	32,500	294.00	9,555,000	
ヤマタネ	6,900	1,204.00	8,307,600	
丸紅建材リース	1,400	1,362.00	1,906,800	
日鉄物産	9,800	3,265.00	31,997,000	
泉州電業	4,200	2,393.00	10,050,600	
トラスコ中山	28,500	2,249.00	64,096,500	
オートバックスセブン	50,800	1,272.00	64,617,600	
モリト	10,000	661.00	6,610,000	
加藤産業	21,400	3,495.00	74,793,000	

北恵	2,600	850.00	2,210,000	
イノテック	8,200	856.00	7,019,200	
イエローハット	25,900	1,446.00	37,451,400	
ＪＫホールディングス	12,400	730.00	9,052,000	
日伝	12,400	1,992.00	24,700,800	
北沢産業	10,400	276.00	2,870,400	
杉本商事	7,400	1,675.00	12,395,000	
因幡電機産業	39,000	2,183.00	85,137,000	
東テク	4,500	1,751.00	7,879,500	
ミスミグループ本社	171,700	2,498.00	428,906,600	
アルテック	11,000	193.00	2,123,000	
タキヒヨー	4,200	1,603.00	6,732,600	
蔵王産業	2,700	1,334.00	3,601,800	
スズケン	58,000	3,975.00	230,550,000	
ジェコス	9,500	806.00	7,657,000	
グローセル	13,800	397.00	5,478,600	
ローソン	34,700	6,080.00	210,976,000	
サンエー	11,400	4,560.00	51,984,000	
カワチ薬品	10,700	2,437.00	26,075,900	
エービーシー・マート	21,400	5,390.00	115,346,000	
ハードオフコーポレーション	5,700	660.00	3,762,000	
アスクル	14,400	3,515.00	50,616,000	
ゲオホールディングス	24,800	1,353.00	33,554,400	
アダストリア	19,100	1,378.00	26,319,800	
ジーフット	8,300	440.00	3,652,000	
くら寿司	7,200	4,360.00	31,392,000	
キャンドゥ	6,600	1,805.00	11,913,000	
パルグループホールディングス	14,100	1,303.00	18,372,300	
エディオン	63,100	911.00	57,484,100	
サーラコーポレーション	28,100	560.00	15,736,000	
ワッツ	6,300	601.00	3,786,300	
ハローズ	5,200	2,980.00	15,496,000	
フジオフードシステム	11,700	1,246.00	14,578,200	
あみやき亭	3,000	2,775.00	8,325,000	
ひらまつ	25,200	144.00	3,628,800	
大黒天物産	3,300	4,070.00	13,431,000	
ハニーズホールディングス	12,200	1,103.00	13,456,600	
ファーマライズホールディングス	3,600	648.00	2,332,800	
アルペン	10,600	1,566.00	16,599,600	
ハブ	4,200	562.00	2,360,400	
クオールホールディングス	20,300	1,194.00	24,238,200	
ジンズホールディングス	7,300	5,690.00	41,537,000	

ビックカメラ	81,500	910.00	74,165,000	
ＤＣＭホールディングス	76,100	1,041.00	79,220,100	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	97,500	3,190.00	311,025,000	
東京一番フーズ	3,900	417.00	1,626,300	
ＤＤホールディングス	5,400	783.00	4,228,200	
きちりホールディングス	4,000	622.00	2,488,000	
アークランドサービスホールディングス	10,100	1,630.00	16,463,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	163,800	785.00	128,583,000	
ドトール・日レスホールディングス	22,000	1,679.00	36,938,000	
マツモトキヨシホールディングス	56,700	3,795.00	215,176,500	
ブロンコビリー	7,200	2,021.00	14,551,200	
ＺＯＺＯ	94,300	1,753.00	165,307,900	
トレジャー・ファクトリー	4,300	681.00	2,928,300	
物語コーポレーション	3,700	6,090.00	22,533,000	
ココカラファイン	14,300	5,180.00	74,074,000	
三越伊勢丹ホールディングス	239,700	615.00	147,415,500	
Ｈａｍｅｅ	5,000	1,459.00	7,295,000	
ウエルシアホールディングス	40,800	8,410.00	343,128,000	
クリエイトＳＤホールディングス	23,100	3,105.00	71,725,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	16,000	379.00	6,064,000	
ティーライフ	2,000	884.00	1,768,000	
チムニー	4,300	1,568.00	6,742,400	
シュッピン	9,600	716.00	6,873,600	
ネクステージ	19,800	670.00	13,266,000	
ジョイフル本田	40,300	1,280.00	51,584,000	
鳥貴族	4,600	1,518.00	6,982,800	
キリン堂ホールディングス	5,500	2,105.00	11,577,500	
ホットランド	9,300	1,031.00	9,588,300	
すかいらーくホールディングス	153,600	1,566.00	240,537,600	
ＳＦＰホールディングス	6,000	1,303.00	7,818,000	
綿半ホールディングス	5,200	1,619.00	8,418,800	
ヨシックス	2,300	1,774.00	4,080,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	40,000	1,053.00	42,120,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	473.00	3,169,100	
ＢＥＥＮＯＳ	5,300	905.00	4,796,500	
あさひ	10,300	1,280.00	13,184,000	
日本調剤	8,400	1,685.00	14,154,000	
コスモス薬品	6,100	29,580.00	180,438,000	
トーエル	6,800	779.00	5,297,200	
オンリー	2,600	552.00	1,435,200	
セブン&アイ・ホールディングス	535,900	3,621.00	1,940,493,900	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	73,900	591.00	43,674,900	
ツルハホールディングス	29,800	14,740.00	439,252,000	
サンマルクホールディングス	10,900	1,771.00	19,303,900	
フェリシモ	3,200	965.00	3,088,000	
トリドールホールディングス	34,000	1,225.00	41,650,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13,100	289.00	3,785,900	
ウイルプラスホールディングス	2,000	515.00	1,030,000	
ＪＭホールディングス	7,000	2,304.00	16,128,000	
サツドラホールディングス	2,100	2,112.00	4,435,200	
アレンザホールディングス	7,100	821.00	5,829,100	
串カツ田中ホールディングス	2,300	1,318.00	3,031,400	
バロックジャパンリミテッド	9,800	600.00	5,880,000	
クスリのアオキホールディングス	12,300	8,860.00	108,978,000	
力の源ホールディングス	6,500	566.00	3,679,000	
スシローグローバルホールディングス	60,300	1,739.00	104,861,700	
ＬＩＸＩＬビバ	13,600	1,840.00	25,024,000	
メディカルシステムネットワーク	13,600	465.00	6,324,000	
はるやまホールディングス	6,700	715.00	4,790,500	
ノジマ	24,500	1,826.00	44,737,000	
カッパ・クリエイト	19,200	1,327.00	25,478,400	
ライトオン	10,200	483.00	4,926,600	
良品計画	182,000	1,204.00	219,128,000	
三城ホールディングス	15,200	266.00	4,043,200	
アドヴァン	21,100	1,059.00	22,344,900	
アルビス	5,300	2,143.00	11,357,900	
コナカ	16,700	326.00	5,444,200	
ハウス　オブ　ローゼ	1,800	1,510.00	2,718,000	
Ｇ－７ホールディングス	8,100	2,441.00	19,772,100	
イオン北海道	18,300	732.00	13,395,600	
コジマ	24,000	394.00	9,456,000	
ヒマラヤ	5,000	727.00	3,635,000	
コーナン商事	19,500	2,401.00	46,819,500	
エコス	5,100	1,925.00	9,817,500	
ワタミ	16,400	1,014.00	16,629,600	
マルシェ	3,900	556.00	2,168,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	301,100	2,098.00	631,707,800	
西松屋チェーン	30,300	827.00	25,058,100	
ゼンショーホールディングス	65,700	2,116.00	139,021,200	
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,441.00	12,680,800	
ハークスレイ	3,000	1,004.00	3,012,000	
サイゼリヤ	22,700	1,989.00	45,150,300	

ＶＴホールディングス	57,300	291.00	16,674,300	
魚力	3,900	1,463.00	5,705,700	
フジ・コーポレーション	3,700	1,727.00	6,389,900	
ユナイテッドアローズ	14,500	1,720.00	24,940,000	
ハイデイ日高	19,900	1,571.00	31,262,900	
京都きもの友禅	9,400	258.00	2,425,200	
コロワイド	45,500	1,543.00	70,206,500	
ピーシーデポコーポレーション	18,500	548.00	10,138,000	
壱番屋	9,700	4,215.00	40,885,500	
ＰＬＡＮＴ	3,900	506.00	1,973,400	
スギホールディングス	27,400	6,380.00	174,812,000	
薬王堂ホールディングス	6,000	2,659.00	15,954,000	
スクロール	21,700	301.00	6,531,700	
ヨンドシーホールディングス	14,000	1,714.00	23,996,000	
ファミリーマート	109,500	1,848.00	202,356,000	
木曽路	18,000	2,409.00	43,362,000	
ＳＲＳホールディングス	16,400	860.00	14,104,000	
タカキュー	12,000	126.00	1,512,000	
ケーヨー	28,400	524.00	14,881,600	
上新電機	16,200	1,946.00	31,525,200	
日本瓦斯	21,700	3,720.00	80,724,000	
ロイヤルホールディングス	24,000	1,723.00	41,352,000	
いなげや	17,100	1,599.00	27,342,900	
島忠	25,800	2,719.00	70,150,200	
チヨダ	14,600	995.00	14,527,000	
ライフコーポレーション	10,400	3,380.00	35,152,000	
リンガーハット	17,000	2,095.00	35,615,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,200	441.00	8,467,200	
テンアライド	12,600	349.00	4,397,400	
ＡＯＫＩホールディングス	27,700	677.00	18,752,900	
オークワ	21,600	1,473.00	31,816,800	
コメリ	21,200	2,003.00	42,463,600	
青山商事	28,500	869.00	24,766,500	
しまむら	16,000	6,660.00	106,560,000	
はせがわ	7,700	404.00	3,110,800	
高島屋	99,900	907.00	90,609,300	
松屋	27,800	617.00	17,152,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	65,100	793.00	51,624,300	
近鉄百貨店	5,300	2,465.00	13,064,500	
丸井グループ	125,600	1,628.00	204,476,800	
アクシアル　リテイリング	11,400	3,945.00	44,973,000	
イオン	527,200	2,178.50	1,148,505,200	

イズミ	27,900	2,882.00	80,407,800	
平和堂	27,900	1,797.00	50,136,300	
フジ	16,600	1,618.00	26,858,800	
ヤオコー	15,600	6,760.00	105,456,000	
ゼビオホールディングス	16,800	861.00	14,464,800	
ケーズホールディングス	132,300	1,154.00	152,674,200	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,300	612.00	4,467,600	
日産東京販売ホールディングス	21,000	206.00	4,326,000	
シルバーライフ	1,500	2,093.00	3,139,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,100	2,303.00	14,048,300	
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	564.00	1,466,400	
ブックオフグループホールディングス	8,000	806.00	6,448,000	
アインホールディングス	16,900	6,340.00	107,146,000	
元気寿司	3,500	2,361.00	8,263,500	
ヤマダ電機	417,700	504.00	210,520,800	
アークランドサカモト	21,600	962.00	20,779,200	
ニトリホールディングス	59,300	16,535.00	980,525,500	
グルメ杵屋	10,000	905.00	9,050,000	
愛眼	10,900	212.00	2,310,800	
ケーユーホールディングス	7,400	771.00	5,705,400	
吉野家ホールディングス	45,100	2,234.00	100,753,400	
松屋フーズホールディングス	6,600	3,895.00	25,707,000	
サガミホールディングス	18,500	1,229.00	22,736,500	
関西スーパーマーケット	11,600	1,057.00	12,261,200	
王将フードサービス	10,100	5,750.00	58,075,000	
プレナス	15,400	1,815.00	27,951,000	
ミニストップ	10,200	1,447.00	14,759,400	
アークス	28,100	2,090.00	58,729,000	
バローホールディングス	30,400	2,021.00	61,438,400	
ベルク	6,800	6,020.00	40,936,000	
大庄	7,500	1,204.00	9,030,000	
ファーストリテイリング	18,300	49,740.00	910,242,000	
サンドラッグ	51,600	3,655.00	188,598,000	
サックスバー　ホールディングス	11,900	584.00	6,949,600	
ヤマザワ	3,300	1,668.00	5,504,400	
やまや	2,900	2,097.00	6,081,300	
ベルーナ	29,800	476.00	14,184,800	
島根銀行	2,700	410.00	1,107,000	
じもとホールディングス	92,700	92.00	8,528,400	
めぶきフィナンシャルグループ	712,800	219.00	156,103,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,500	1,101.00	20,368,500	
九州フィナンシャルグループ	225,100	420.00	94,542,000	

ゆうちょ銀行	388,600	961.00	373,444,600	
富山第一銀行	32,700	266.00	8,698,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	806,800	305.00	246,074,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,500	606.00	56,661,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	80,500	328.00	26,404,000	
三十三フィナンシャルグループ	12,700	1,414.00	17,957,800	
第四北越フィナンシャルグループ	23,800	2,123.00	50,527,400	
新生銀行	100,700	1,269.00	127,788,300	
あおぞら銀行	81,700	1,933.00	157,926,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,384,200	418.70	3,929,164,540	
りそなホールディングス	1,505,400	318.50	479,469,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	259,300	3,040.00	788,272,000	
三井住友フィナンシャルグループ	948,800	2,714.00	2,575,043,200	
千葉銀行	457,800	474.00	216,997,200	
群馬銀行	269,600	342.00	92,203,200	
武蔵野銀行	20,400	1,302.00	26,560,800	
千葉興業銀行	37,600	235.00	8,836,000	
筑波銀行	57,000	163.00	9,291,000	
七十七銀行	46,300	1,355.00	62,736,500	
青森銀行	10,600	1,992.00	21,115,200	
秋田銀行	8,800	1,278.00	11,246,400	
山形銀行	15,400	1,317.00	20,281,800	
岩手銀行	9,000	2,530.00	22,770,000	
東邦銀行	122,700	244.00	29,938,800	
東北銀行	6,600	866.00	5,715,600	
みちのく銀行	8,800	1,032.00	9,081,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	115,600	1,327.00	153,401,200	
静岡銀行	339,700	612.00	207,896,400	
十六銀行	17,200	1,832.00	31,510,400	
スルガ銀行	140,300	354.00	49,666,200	
八十二銀行	331,100	369.00	122,175,900	
山梨中央銀行	15,900	749.00	11,909,100	
大垣共立銀行	27,100	2,115.00	57,316,500	
福井銀行	11,700	1,455.00	17,023,500	
北國銀行	14,100	3,435.00	48,433,500	
清水銀行	5,700	1,721.00	9,809,700	
富山銀行	2,600	2,029.00	5,275,400	
滋賀銀行	27,500	2,530.00	69,575,000	
南都銀行	22,800	2,102.00	47,925,600	
百五銀行	123,500	305.00	37,667,500	
京都銀行	49,100	3,525.00	173,077,500	
紀陽銀行	48,600	1,539.00	74,795,400	

ほくほくフィナンシャルグループ	91,300	842.00	76,874,600	
広島銀行	202,500	429.00	86,872,500	
山陰合同銀行	81,300	553.00	44,958,900	
中国銀行	118,100	979.00	115,619,900	
鳥取銀行	4,700	1,144.00	5,376,800	
伊予銀行	195,700	601.00	117,615,700	
百十四銀行	14,600	1,891.00	27,608,600	
四国銀行	20,800	783.00	16,286,400	
阿波銀行	22,400	2,514.00	56,313,600	
大分銀行	7,900	2,053.00	16,218,700	
宮崎銀行	9,100	2,230.00	20,293,000	
佐賀銀行	8,300	1,013.00	8,407,900	
沖縄銀行	12,600	3,155.00	39,753,000	
琉球銀行	31,600	954.00	30,146,400	
セブン銀行	458,300	293.00	134,281,900	
みずほフィナンシャルグループ	18,640,900	122.30	2,279,782,070	
高知銀行	5,000	699.00	3,495,000	
山口フィナンシャルグループ	171,200	550.00	94,160,000	
長野銀行	4,500	996.00	4,482,000	
名古屋銀行	11,100	2,175.00	24,142,500	
北洋銀行	206,800	189.00	39,085,200	
愛知銀行	5,000	3,015.00	15,075,000	
中京銀行	5,600	1,953.00	10,936,800	
大光銀行	4,700	1,476.00	6,937,200	
愛媛銀行	19,200	1,109.00	21,292,800	
トマト銀行	5,300	995.00	5,273,500	
京葉銀行	58,500	506.00	29,601,000	
栃木銀行	66,300	152.00	10,077,600	
北日本銀行	4,300	1,809.00	7,778,700	
東和銀行	24,100	609.00	14,676,900	
福島銀行	12,900	155.00	1,999,500	
大東銀行	7,100	567.00	4,025,700	
トモニホールディングス	106,100	393.00	41,697,300	
フィデアホールディングス	133,200	97.00	12,920,400	
池田泉州ホールディングス	157,800	160.00	25,248,000	
ＦＰＧ	42,600	574.00	24,452,400	
マーキュリアインベストメント	6,400	555.00	3,552,000	
ＳＢＩホールディングス	153,300	1,779.00	272,720,700	
ジャフコ	21,100	3,210.00	67,731,000	
大和証券グループ本社	1,101,100	409.20	450,570,120	
野村ホールディングス	2,414,100	420.00	1,013,922,000	
岡三証券グループ	117,300	319.00	37,418,700	

丸三証券	41,100	429.00	17,631,900	
東洋証券	50,200	124.00	6,224,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	158,100	232.00	36,679,200	
光世証券	3,500	528.00	1,848,000	
水戸証券	40,400	199.00	8,039,600	
いちよし証券	26,000	421.00	10,946,000	
松井証券	78,600	793.00	62,329,800	
だいこう証券ビジネス	6,900	523.00	3,608,700	
マネックスグループ	104,300	198.00	20,651,400	
極東証券	18,700	512.00	9,574,400	
岩井コスモホールディングス	13,100	924.00	12,104,400	
藍澤證券	24,800	730.00	18,104,000	
マネーパートナーズグループ	15,400	207.00	3,187,800	
スパークス・グループ	48,400	176.00	8,518,400	
かんぽ生命保険	48,600	1,301.00	63,228,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	257,900	3,375.00	870,412,500	
アニコム　ホールディングス	11,300	3,945.00	44,578,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	358,700	2,939.00	1,054,219,300	
ソニーフィナンシャルホールディングス	112,700	1,879.00	211,763,300	
第一生命ホールディングス	776,300	1,324.00	1,027,821,200	
東京海上ホールディングス	490,600	4,843.00	2,375,975,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	410,000	880.00	360,800,000	
アドバンスクリエイト	3,200	1,865.00	5,968,000	
全国保証	38,700	2,916.00	112,849,200	
ジェイリース	3,800	224.00	851,200	
イントラスト	4,800	656.00	3,148,800	
日本モーゲージサービス	2,800	1,538.00	4,306,400	
Ｃａｓａ	4,800	1,192.00	5,721,600	
アルヒ	21,800	1,223.00	26,661,400	
プレミアグループ	7,400	1,518.00	11,233,200	
クレディセゾン	96,100	1,107.00	106,382,700	
芙蓉総合リース	14,400	5,220.00	75,168,000	
みずほリース	21,200	2,105.00	44,626,000	
東京センチュリー	27,600	3,600.00	99,360,000	
日本証券金融	60,500	484.00	29,282,000	
アイフル	209,300	224.00	46,883,200	
リコーリース	10,800	2,813.00	30,380,400	
イオンフィナンシャルサービス	84,000	1,022.00	85,848,000	
アコム	275,700	420.00	115,794,000	
ジャックス	15,100	1,618.00	24,431,800	
オリエントコーポレーション	371,000	120.00	44,520,000	
日立キャピタル	32,300	2,075.00	67,022,500	

アプラスフィナンシャル	65,800	62.00	4,079,600	
オリックス	858,000	1,238.50	1,062,633,000	
三菱ＵＦＪリース	348,200	503.00	175,144,600	
九州リースサービス	6,700	419.00	2,807,300	
日本取引所グループ	393,700	2,081.00	819,289,700	
イー・ギャランティ	14,700	1,911.00	28,091,700	
アサックス	7,100	621.00	4,409,100	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,600	1,861.00	10,421,600	
いちご	181,500	240.00	43,560,000	
日本駐車場開発	163,900	132.00	21,634,800	
スター・マイカ・ホールディングス	8,400	1,312.00	11,020,800	
ＡＤワークスグループ	25,400	163.00	4,140,200	
ヒューリック	294,800	1,021.00	300,990,800	
三栄建築設計	7,000	1,226.00	8,582,000	
野村不動産ホールディングス	84,300	1,698.00	143,141,400	
三重交通グループホールディングス	31,500	476.00	14,994,000	
サムティ	20,800	1,337.00	27,809,600	
ディア・ライフ	22,400	407.00	9,116,800	
日本商業開発	10,100	1,310.00	13,231,000	
ハウスコム	3,200	1,296.00	4,147,200	
日本管理センター	10,800	1,015.00	10,962,000	
サンセイランディック	6,600	674.00	4,448,400	
フージャースホールディングス	27,300	601.00	16,407,300	
オープンハウス	40,600	2,260.00	91,756,000	
東急不動産ホールディングス	376,500	502.00	189,003,000	
飯田グループホールディングス	115,700	1,371.00	158,624,700	
イーグランド	4,900	619.00	3,033,100	
ムゲンエステート	13,500	446.00	6,021,000	
ハウスドゥ	6,700	754.00	5,051,800	
シーアールイー	5,000	1,141.00	5,705,000	
グッドコムアセット	4,400	1,577.00	6,938,800	
ジェイ・エス・ビー	1,900	4,200.00	7,980,000	
テンポイノベーション	6,000	609.00	3,654,000	
パーク２４	74,900	1,536.00	115,046,400	
パラカ	4,600	1,547.00	7,116,200	
三井不動産	677,500	1,855.00	1,256,762,500	
三菱地所	962,200	1,742.50	1,676,633,500	
平和不動産	25,800	2,700.00	69,660,000	
東京建物	146,100	1,118.00	163,339,800	
ダイビル	37,400	869.00	32,500,600	
京阪神ビルディング	23,600	1,339.00	31,600,400	
住友不動産	309,000	2,703.00	835,227,000	

テーオーシー	29,800	610.00	18,178,000	
東京楽天地	2,700	4,185.00	11,299,500	
スターツコーポレーション	19,500	2,044.00	39,858,000	
フジ住宅	19,400	472.00	9,156,800	
空港施設	18,100	423.00	7,656,300	
明和地所	11,500	417.00	4,795,500	
ゴールドクレスト	11,900	1,592.00	18,944,800	
エスリード	6,700	1,288.00	8,629,600	
日神グループホールディングス	25,000	390.00	9,750,000	
日本エスコン	24,800	616.00	15,276,800	
タカラレーベン	62,700	340.00	21,318,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	10,700	618.00	6,612,600	
イオンモール	70,100	1,267.00	88,816,700	
毎日コムネット	5,800	778.00	4,512,400	
ファースト住建	7,600	1,010.00	7,676,000	
カチタス	35,000	1,797.00	62,895,000	
トーセイ	20,700	1,005.00	20,803,500	
穴吹興産	4,300	1,438.00	6,183,400	
サンフロンティア不動産	21,200	796.00	16,875,200	
エフ・ジェー・ネクスト	14,200	821.00	11,658,200	
インテリックス	3,900	530.00	2,067,000	
ランドビジネス	5,800	309.00	1,792,200	
日本社宅サービス	5,100	969.00	4,941,900	
グランディハウス	16,100	322.00	5,184,200	
日本空港ビルデング	44,200	4,140.00	182,988,000	
日本工営	9,000	2,746.00	24,714,000	
ＬＩＦＵＬＬ	46,800	342.00	16,005,600	
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	1,111.00	9,999,000	
日本M&Aセンター	100,400	3,690.00	370,476,000	
メンバーズ	4,000	1,609.00	6,436,000	
中広	1,600	472.00	755,200	
ＵＴグループ	15,800	1,377.00	21,756,600	
アイティメディア	4,100	974.00	3,993,400	
タケエイ	12,900	757.00	9,765,300	
Ｅ・Ｊホールディングス	2,500	1,365.00	3,412,500	
ビーネックスグループ	16,900	600.00	10,140,000	
コシダカホールディングス	32,300	427.00	13,792,100	
アルトナー	3,400	602.00	2,046,800	
パソナグループ	14,500	1,061.00	15,384,500	
ＣＤＳ	3,400	1,226.00	4,168,400	
リンクアンドモチベーション	29,700	351.00	10,424,700	
ＧＣＡ	16,200	627.00	10,157,400	

エス・エム・エス	41,400	2,179.00	90,210,600	
サニーサイドアップグループ	3,700	605.00	2,238,500	
パーソルホールディングス	133,000	1,075.00	142,975,000	
リニカル	6,600	898.00	5,926,800	
クックパッド	46,800	319.00	14,929,200	
エスクリ	4,500	365.00	1,642,500	
アイ・ケイ・ケイ	6,700	648.00	4,341,600	
学情	4,800	1,131.00	5,428,800	
スタジオアリス	6,800	1,417.00	9,635,600	
シミックホールディングス	7,400	1,418.00	10,493,200	
エプコ	2,300	865.00	1,989,500	
ＮＪＳ	3,000	1,502.00	4,506,000	
綜合警備保障	52,900	5,440.00	287,776,000	
カカクコム	98,200	2,320.00	227,824,000	
アイロムグループ	4,700	1,333.00	6,265,100	
セントケア・ホールディング	8,900	402.00	3,577,800	
サイネックス	2,500	588.00	1,470,000	
ルネサンス	7,500	946.00	7,095,000	
ディップ	18,800	1,934.00	36,359,200	
オプトホールディング	7,300	1,535.00	11,205,500	
ツクイ	31,600	421.00	13,303,600	
キャリアデザインセンター	3,500	863.00	3,020,500	
ベネフィット・ワン	36,300	1,976.00	71,728,800	
エムスリー	293,100	4,005.00	1,173,865,500	
ツカダ・グローバルホールディング	8,800	340.00	2,992,000	
ブラス	1,800	392.00	705,600	
アウトソーシング	76,400	481.00	36,748,400	
ウェルネット	13,700	502.00	6,877,400	
ワールドホールディングス	4,500	1,289.00	5,800,500	
ディー・エヌ・エー	65,200	1,273.00	82,999,600	
博報堂ＤＹホールディングス	185,000	1,106.00	204,610,000	
ぐるなび	23,400	556.00	13,010,400	
タカミヤ	14,400	413.00	5,947,200	
ジャパンベストレスキューシステム	9,000	736.00	6,624,000	
ファンコミュニケーションズ	36,900	431.00	15,903,900	
ライク	4,500	1,350.00	6,075,000	
ビジネス・ブレークスルー	5,900	386.00	2,277,400	
エスプール	25,800	761.00	19,633,800	
ＷＤＢホールディングス	6,100	2,457.00	14,987,700	
ティア	8,000	556.00	4,448,000	
ＣＤＧ	1,500	1,389.00	2,083,500	
バリューコマース	7,500	2,042.00	15,315,000	

インフォマート	145,800	734.00	107,017,200	
ＪＰホールディングス	42,200	269.00	11,351,800	
エコナックホールディングス	25,500	89.00	2,269,500	
ＥＰＳホールディングス	20,100	1,159.00	23,295,900	
レッグス	3,400	890.00	3,026,000	
プレステージ・インターナショナル	49,900	874.00	43,612,600	
アミューズ	7,300	2,190.00	15,987,000	
ドリームインキュベータ	4,200	1,104.00	4,636,800	
クイック	8,400	1,032.00	8,668,800	
ＴＡＣ	8,700	169.00	1,470,300	
ケネディクス	124,100	449.00	55,720,900	
電通グループ	137,100	2,127.00	291,611,700	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,300	563.00	2,983,900	
ぴあ	3,900	2,900.00	11,310,000	
イオンファンタジー	5,200	1,523.00	7,919,600	
シーティーエス	15,200	531.00	8,071,200	
ネクシィーズグループ	4,800	1,024.00	4,915,200	
みらかホールディングス	37,200	2,348.00	87,345,600	
アルプス技研	11,800	1,565.00	18,467,000	
ダイオーズ	2,700	1,037.00	2,799,900	
日本空調サービス	14,100	734.00	10,349,400	
オリエンタルランド	141,400	14,440.00	2,041,816,000	
ダスキン	34,200	2,768.00	94,665,600	
明光ネットワークジャパン	15,800	778.00	12,292,400	
ファルコホールディングス	7,400	1,649.00	12,202,600	
ラウンドワン	37,300	789.00	29,429,700	
リゾートトラスト	61,000	1,078.00	65,758,000	
ビー・エム・エル	17,200	2,694.00	46,336,800	
ワタベウェディング	2,500	408.00	1,020,000	
りらいあコミュニケーションズ	24,100	1,140.00	27,474,000	
リソー教育	61,200	268.00	16,401,600	
早稲田アカデミー	4,500	1,055.00	4,747,500	
ユー・エス・エス	148,900	1,672.00	248,960,800	
東京個別指導学院	4,900	511.00	2,503,900	
サイバーエージェント	76,500	4,390.00	335,835,000	
楽天	619,600	930.00	576,228,000	
クリーク・アンド・リバー社	7,000	886.00	6,202,000	
テー・オー・ダブリュー	21,600	280.00	6,048,000	
山田コンサルティンググループ	6,600	1,092.00	7,207,200	
セントラルスポーツ	5,000	2,158.00	10,790,000	
フルキャストホールディングス	13,400	1,285.00	17,219,000	
エン・ジャパン	23,700	2,211.00	52,400,700	

リソルホールディングス	1,500	3,150.00	4,725,000	
テクノプロ・ホールディングス	26,600	5,060.00	134,596,000	
アトラ	3,600	264.00	950,400	
インターワークス	2,900	371.00	1,075,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	7,200.00	38,880,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,000	1,520.00	7,600,000	
ファーストロジック	3,300	600.00	1,980,000	
三機サービス	2,700	1,096.00	2,959,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,400	809.00	6,795,600	
デザインワン・ジャパン	3,400	200.00	680,000	
イー・ガーディアン	6,800	1,848.00	12,566,400	
リブセンス	9,000	254.00	2,286,000	
ジャパンマテリアル	41,000	1,563.00	64,083,000	
ベクトル	16,700	832.00	13,894,400	
ウチヤマホールディングス	6,900	329.00	2,270,100	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,500	847.00	9,740,500	
ライクキッズ	2,500	610.00	1,525,000	
キャリアリンク	4,600	451.00	2,074,600	
ＩＢＪ	9,300	719.00	6,686,700	
アサンテ	5,400	1,526.00	8,240,400	
Ｎ・フィールド	9,400	435.00	4,089,000	
バリューＨＲ	5,300	1,510.00	8,003,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	9,500	3,010.00	28,595,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,100	1,573.00	8,022,300	
ＥＲＩホールディングス	3,900	640.00	2,496,000	
アビスト	2,100	1,862.00	3,910,200	
シグマクシス	9,200	1,643.00	15,115,600	
ウィルグループ	8,900	615.00	5,473,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	19,200	184.00	3,532,800	
リクルートホールディングス	952,100	2,924.00	2,783,940,400	
エラン	7,900	1,757.00	13,880,300	
土木管理総合試験所	6,200	321.00	1,990,200	
ネットマーケティング	4,000	684.00	2,736,000	
日本郵政	1,089,500	816.50	889,576,750	
ベルシステム２４ホールディングス	22,400	1,168.00	26,163,200	
鎌倉新書	10,100	1,070.00	10,807,000	
ＳＭＮ	2,300	760.00	1,748,000	
一蔵	1,800	353.00	635,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,600	2,256.00	10,377,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,200	534.00	1,174,800	
エアトリ	5,900	939.00	5,540,100	
アトラエ	3,500	2,637.00	9,229,500	

ストライク	5,000	4,520.00	22,600,000	
ソラスト	36,700	1,063.00	39,012,100	
セラク	4,300	856.00	3,680,800	
インソース	6,500	2,262.00	14,703,000	
ベイカレント・コンサルティング	8,100	6,990.00	56,619,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,900	881.00	2,554,900	
アイモバイル	4,000	600.00	2,400,000	
キャリアインデックス	5,900	285.00	1,681,500	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,500	714.00	3,213,000	
船場	2,300	858.00	1,973,400	
グレイステクノロジー	6,100	2,882.00	17,580,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,100	2,790.00	39,339,000	
フルテック	2,000	1,192.00	2,384,000	
グリーンズ	3,700	447.00	1,653,900	
ツナググループ・ホールディングス	1,900	457.00	868,300	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	3,200	572.00	1,830,400	
ソウルドアウト	2,100	2,002.00	4,204,200	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,100	456.00	957,600	
ミダック	1,400	1,047.00	1,465,800	
日総工産	9,100	466.00	4,240,600	
キュービーネットホールディングス	5,500	1,678.00	9,229,000	
ＲＰＡホールディングス	7,800	651.00	5,077,800	
スプリックス	4,600	944.00	4,342,400	
マネジメントソリューションズ	4,400	1,114.00	4,901,600	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	1,400	931.00	1,303,400	
カーブスホールディングス	33,200	525.00	17,430,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,900	724.00	4,995,600	
リログループ	72,700	2,328.00	169,245,600	
東祥	8,400	958.00	8,047,200	
エイチ・アイ・エス	20,700	1,373.00	28,421,100	
ラックランド	3,200	1,716.00	5,491,200	
共立メンテナンス	22,100	2,414.00	53,349,400	
イチネンホールディングス	15,000	1,077.00	16,155,000	
建設技術研究所	9,200	1,673.00	15,391,600	
スペース	8,700	1,011.00	8,795,700	
長大	5,000	770.00	3,850,000	
燦ホールディングス	5,900	1,262.00	7,445,800	
スバル興業	800	7,850.00	6,280,000	
東京テアトル	5,300	1,168.00	6,190,400	
タナベ経営	2,700	1,217.00	3,285,900	
ナガワ	4,300	6,930.00	29,799,000	
よみうりランド	2,900	3,430.00	9,947,000	

東京都競馬	8,700	3,380.00	29,406,000	
カナモト	21,800	2,073.00	45,191,400	
東京ドーム	54,000	760.00	41,040,000	
西尾レントオール	13,500	2,109.00	28,471,500	
トランス・コスモス	12,700	2,054.00	26,085,800	
乃村工藝社	57,100	752.00	42,939,200	
藤田観光	5,900	1,715.00	10,118,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,300	839.00	6,963,700	
日本管財	14,300	1,816.00	25,968,800	
トーカイ	12,900	2,707.00	34,920,300	
白洋舎	1,600	2,525.00	4,040,000	
セコム	141,100	9,087.00	1,282,175,700	
セントラル警備保障	6,400	4,215.00	26,976,000	
丹青社	25,300	688.00	17,406,400	
メイテック	16,500	4,295.00	70,867,500	
応用地質	14,400	1,197.00	17,236,800	
船井総研ホールディングス	27,500	2,199.00	60,472,500	
進学会ホールディングス	5,400	559.00	3,018,600	
オオバ	9,800	537.00	5,262,600	
いであ	2,500	1,531.00	3,827,500	
学究社	4,000	1,111.00	4,444,000	
ベネッセホールディングス	44,300	2,999.00	132,855,700	
イオンディライト	16,400	3,045.00	49,938,000	
ナック	7,500	846.00	6,345,000	
ニチイ学館	19,000	1,106.00	21,014,000	
ダイセキ	22,300	2,303.00	51,356,900	
ステップ	5,000	1,351.00	6,755,000	
合　計	162,873,400		279,894,221,160	

(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	千葉興業銀行第７回新株予約権	38,100	－	
合計		38,100	－	

(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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	221,891,610
国債証券	443,601,981,750
地方債証券	29,121,706,936
特殊債券	35,727,264,003
社債券	23,302,950,950
未収入金	201,676,400
未収利息	765,982,340
前払費用	15,042,462
流動資産合計	532,958,496,451
資産合計	532,958,496,451
負債の部	
流動負債	
未払解約金	178,262,865
未払利息	315
流動負債合計	178,263,180
負債合計	178,263,180
純資産の部	
元本等	
元本	377,245,701,469
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	155,534,531,802
元本等合計	532,780,233,271
純資産合計	532,780,233,271
負債純資産合計	532,958,496,451

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 先物取引

	2020年 4月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 4月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	377,245,701,469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　101,514,000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　1.4123円
		(1万口当たり純資産額)　(14,123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

	2020年 4月20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。

	2020年 4月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 4月20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	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	381,287,025,782円
期中追加設定元本額	25,629,820,275円
期中一部解約元本額	29,671,144,588円
期末元本額	377,245,701,469円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,621,392,072円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	12,602,060円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	18,493,344,430円
世界経済インデックスファンド	1,933,341,184円
ＤＣマイセレクション２５	20,386,954,454円
ＤＣマイセレクション５０	21,427,314,114円
ＤＣマイセレクション７５	5,603,065,859円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	453,120,836円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	89,137,275,087円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,564,401,548円
ＤＣマイセレクションＳ２５	8,548,866,341円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,944,479,414円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,645,098,821円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,071,931,126円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,317,004,315円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	434,477,834円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,540,126,529円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	66,182,888円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,891,710円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	40,367,643円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	13,051,579円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	831,352円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	144,792,523円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	204,920,839円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	51,990,374円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	84,023,770円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,828,151,540円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	856,779,736円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,294,698,412円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	702,109,736円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	84,498,549円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,103,727,280円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	25,144,003円

区分	2020年 4月20日現在
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,285,711,011円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,627,467,137円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	146,210,886円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,713,574,733円
日本債券ファンド・シリーズ１	11,704,797,492円
分散投資コア戦略ファンドＡ	10,905,805,393円
分散投資コア戦略ファンドＳ	9,309,995,398円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	84,549,461円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	905,317,030円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	45,537,363円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,082,598円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	57,065,616円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	12,812,119円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	25,070,493円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,600,590円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,908,482円
グローバル経済コア	222,938,450円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	14,845,045円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,281,875円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	107,296円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	118,916円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	31,623円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	7,109円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	70,443,563,408円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	24,116,747円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△6,592,023,250
地方債証券	△323,778,213
特殊債券	△394,437,052
社債券	△276,246,260
合計	△7,586,484,775

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第４００回利付国債（２年）	130,000,000	130,340,600	
	第４０１回利付国債（２年）	2,880,000,000	2,888,179,200	
	第４０２回利付国債（２年）	500,000,000	501,525,000	
	第４０３回利付国債（２年）	3,690,000,000	3,701,808,000	
	第４０４回利付国債（２年）	460,000,000	461,568,600	
	第４０５回利付国債（２年）	960,000,000	963,408,000	
	第４０６回利付国債（２年）	780,000,000	782,987,400	
	第４０７回利付国債（２年）	360,000,000	361,483,200	
	第４０８回利付国債（２年）	690,000,000	692,932,500	
	第４０９回利付国債（２年）	2,670,000,000	2,681,694,600	
	第４１０回利付国債（２年）	90,000,000	90,410,400	
	第１２８回利付国債（５年）	1,610,000,000	1,614,781,700	
	第１２９回利付国債（５年）	3,340,000,000	3,351,589,800	
	第１３０回利付国債（５年）	3,160,000,000	3,172,924,400	
	第１３１回利付国債（５年）	4,990,000,000	5,013,902,100	
	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	4,794,851,700	
	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,406,542,800	
	第１３４回利付国債（５年）	6,050,000,000	6,090,474,500	
	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,109,824,800	
	第１３６回利付国債（５年）	4,140,000,000	4,172,871,600	
	第１３７回利付国債（５年）	6,900,000,000	6,956,787,000	
	第１３８回利付国債（５年）	9,510,000,000	9,590,549,700	
	第１３９回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,417,843,200	
	第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	7,364,094,000	
	第１４１回利付国債（５年）	6,020,000,000	6,076,046,200	
	第１４２回利付国債（５年）	6,050,000,000	6,108,140,500	
	第１回利付国債（４０年）	400,000,000	601,624,000	
	第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,654,964,100	
	第３回利付国債（４０年）	550,000,000	814,484,000	
	第４回利付国債（４０年）	1,000,000,000	1,495,190,000	

第５回利付国債（４０年）	920,000,000	1,334,680,800	
第６回利付国債（４０年）	1,460,000,000	2,090,836,800	
第７回利付国債（４０年）	830,000,000	1,147,068,300	
第８回利付国債（４０年）	800,000,000	1,037,128,000	
第９回利付国債（４０年）	930,000,000	905,820,000	
第１０回利付国債（４０年）	1,990,000,000	2,273,455,600	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,986,470,400	
第１２回利付国債（４０年）	1,240,000,000	1,246,088,400	
第３１５回利付国債（１０年）	3,140,000,000	3,189,612,000	
第３１６回利付国債（１０年）	1,170,000,000	1,187,117,100	
第３１７回利付国債（１０年）	890,000,000	905,726,300	
第３１８回利付国債（１０年）	1,960,000,000	1,991,850,000	
第３１９回利付国債（１０年）	1,710,000,000	1,745,687,700	
第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	4,657,744,000	
第３２１回利付国債（１０年）	2,470,000,000	2,524,216,500	
第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	765,022,500	
第３２３回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,973,560,100	
第３２４回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,795,896,000	
第３２５回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,986,897,200	
第３２６回利付国債（１０年）	1,520,000,000	1,554,154,400	
第３２７回利付国債（１０年）	1,610,000,000	1,650,491,500	
第３２８回利付国債（１０年）	3,400,000,000	3,473,542,000	
第３２９回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,317,207,500	
第３３０回利付国債（１０年）	1,690,000,000	1,744,519,400	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	922,860,000	
第３３２回利付国債（１０年）	3,110,000,000	3,193,596,800	
第３３３回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,395,939,000	
第３３４回利付国債（１０年）	1,790,000,000	1,843,163,000	
第３３５回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,516,321,500	
第３３６回利付国債（１０年）	510,000,000	524,586,000	
第３３７回利付国債（１０年）	3,330,000,000	3,394,002,600	
第３３８回利付国債（１０年）	3,060,000,000	3,137,050,800	
第３３９回利付国債（１０年）	5,230,000,000	5,369,902,500	
第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	6,497,339,200	
第３４１回利付国債（１０年）	2,160,000,000	2,211,105,600	
第３４２回利付国債（１０年）	5,880,000,000	5,955,205,200	
第３４３回利付国債（１０年）	3,250,000,000	3,294,395,000	
第３４４回利付国債（１０年）	6,940,000,000	7,038,686,800	
第３４５回利付国債（１０年）	2,290,000,000	2,323,846,200	
第３４６回利付国債（１０年）	3,540,000,000	3,593,029,200	
第３４７回利付国債（１０年）	310,000,000	314,699,600	
第３４８回利付国債（１０年）	4,940,000,000	5,015,680,800	

第３４９回利付国債（１０年）	3,130,000,000	3,178,327,200	
第３５０回利付国債（１０年）	5,790,000,000	5,877,660,600	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	3,590,000,000	3,641,588,300	
第３５２回利付国債（１０年）	4,190,000,000	4,246,690,700	
第３５３回利付国債（１０年）	4,470,000,000	4,526,366,700	
第３５４回利付国債（１０年）	3,780,000,000	3,823,885,800	
第３５５回利付国債（１０年）	4,940,000,000	4,992,117,000	
第３５６回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,767,098,600	
第３５７回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,694,483,900	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	138,936,600	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	197,574,400	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	147,520,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	143,079,200	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	61,708,500	
第６回利付国債（３０年）	190,000,000	240,177,100	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	226,720,800	
第８回利付国債（３０年）	100,000,000	120,461,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	277,116,000	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	178,800,000	
第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	107,660,700	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	237,788,800	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	359,916,100	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	389,598,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	447,402,600	
第１６回利付国債（３０年）	370,000,000	488,559,100	
第１７回利付国債（３０年）	570,000,000	747,070,500	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	448,286,100	
第１９回利付国債（３０年）	380,000,000	495,261,600	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	641,745,600	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	655,015,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	537,728,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	579,863,600	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	514,014,600	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	463,309,000	
第２６回利付国債（３０年）	530,000,000	712,007,300	
第２７回利付国債（３０年）	1,010,000,000	1,381,205,300	
第２８回利付国債（３０年）	1,640,000,000	2,257,148,400	
第２９回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,913,086,000	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,401,394,400	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,480,743,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,142,207,600	
第３３回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,339,869,200	

第３４回利付国債（３０年）	1,615,000,000	2,210,111,350	
第３５回利付国債（３０年）	1,940,000,000	2,588,037,600	
第３６回利付国債（３０年）	1,830,000,000	2,451,998,700	
第３７回利付国債（３０年）	1,910,000,000	2,527,980,500	
第３８回利付国債（３０年）	1,230,000,000	1,606,589,100	
第３９回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,596,828,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,170,000,000	1,533,846,600	
第４１回利付国債（３０年）	870,000,000	1,123,004,700	
第４２回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,744,443,000	
第４３回利付国債（３０年）	930,000,000	1,204,350,000	
第４４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,581,583,600	
第４５回利付国債（３０年）	990,000,000	1,238,658,300	
第４６回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,928,126,200	
第４７回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,724,314,500	
第４８回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,239,874,000	
第４９回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,773,100,800	
第５０回利付国債（３０年）	1,110,000,000	1,205,748,600	
第５１回利付国債（３０年）	1,840,000,000	1,771,239,200	
第５２回利付国債（３０年）	1,600,000,000	1,616,976,000	
第５３回利付国債（３０年）	690,000,000	714,639,900	
第５４回利付国債（３０年）	1,510,000,000	1,638,833,200	
第５５回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,129,471,200	
第５６回利付国債（３０年）	1,870,000,000	2,029,716,700	
第５７回利付国債（３０年）	1,190,000,000	1,292,459,000	
第５８回利付国債（３０年）	1,620,000,000	1,758,412,800	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	180,172,800	
第６０回利付国債（３０年）	2,530,000,000	2,813,284,100	
第６１回利付国債（３０年）	1,330,000,000	1,409,055,200	
第６２回利付国債（３０年）	170,000,000	171,079,500	
第６３回利付国債（３０年）	980,000,000	959,939,400	
第６４回利付国債（３０年）	1,700,000,000	1,662,787,000	
第６５回利付国債（３０年）	860,000,000	842,129,200	
第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	102,519,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	113,518,900	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	82,998,400	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	207,830,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	145,766,600	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	156,967,500	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	250,627,200	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	314,838,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	209,846,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	364,420,000	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	247,999,200	

第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	329,558,400	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	212,332,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	342,348,800	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	236,405,400	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	353,393,700	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	140,293,400	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	207,284,300	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	423,945,600	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	441,908,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	219,282,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	691,632,900	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	395,528,400	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	220,676,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	144,153,100	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	296,730,000	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	320,142,600	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	187,746,300	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	299,589,300	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	245,251,600	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	434,838,300	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	672,252,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	326,537,100	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	526,536,300	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	328,137,900	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	240,116,100	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	625,603,000	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	482,970,600	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	400,302,000	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	724,273,200	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	520,245,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	1,010,926,400	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	470,253,600	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	703,897,300	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	715,896,000	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,843,080,300	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	468,740,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	512,327,200	
第９９回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,344,913,500	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	567,369,600	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	856,534,250	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,515,540,600	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	477,840,000	

第１０４回利付国債（２０年）	360,000,000	424,144,800	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,395,007,800	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	452,454,600	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	308,383,400	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	771,342,000	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	609,408,800	
第１１０回利付国債（２０年）	950,000,000	1,130,310,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,167,171,900	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	943,331,100	
第１１３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,737,535,000	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,801,568,700	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	848,442,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,813,121,400	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,303,516,800	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	792,554,400	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	625,691,500	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,821,623,900	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,790,340,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,112,189,200	
第１２３回利付国債（２０年）	830,000,000	1,010,508,400	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	736,190,700	
第１２５回利付国債（２０年）	820,000,000	1,010,240,000	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	883,533,600	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,223,469,600	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,165,988,500	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,059,972,200	
第１３０回利付国債（２０年）	1,245,000,000	1,486,417,950	
第１３１回利付国債（２０年）	850,000,000	1,005,210,000	
第１３２回利付国債（２０年）	840,000,000	994,971,600	
第１３３回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,423,275,700	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,353,751,300	
第１３５回利付国債（２０年）	30,000,000	35,587,500	
第１３６回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,726,515,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,331,355,200	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	722,145,000	
第１３９回利付国債（２０年）	580,000,000	682,503,400	
第１４０回利付国債（２０年）	1,840,000,000	2,191,642,400	
第１４１回利付国債（２０年）	2,110,000,000	2,516,491,500	
第１４２回利付国債（２０年）	580,000,000	698,946,400	
第１４３回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,335,004,600	
第１４４回利付国債（２０年）	1,740,000,000	2,033,677,200	
第１４５回利付国債（２０年）	2,515,000,000	3,008,518,450	
第１４６回利付国債（２０年）	2,440,000,000	2,923,925,200	

	第１４７回利付国債（２０年）	2,280,000,000	2,706,405,600	
	第１４８回利付国債（２０年）	2,280,000,000	2,679,364,800	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,960,000,000	3,482,824,800	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,640,000,000	3,075,283,200	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,255,000,000	1,427,700,550	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,754,468,200	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,230,000,000	2,573,977,500	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,950,000,000	3,363,501,500	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,100,000,000	2,332,155,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	1,960,000,000	1,994,300,000	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,820,000,000	2,778,658,800	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,320,000,000	2,394,448,800	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,070,000,000	2,168,552,700	
	第１６０回利付国債（２０年）	1,920,000,000	2,041,958,400	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,750,000,000	1,831,200,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	580,000,000	606,790,200	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,729,903,400	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,720,000,000	1,769,450,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,686,330,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	900,000,000	956,979,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,540,000,000	2,609,037,200	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,402,315,400	
	第１６９回利付国債（２０年）	760,000,000	752,498,800	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,385,900,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,435,326,000	
国債証券合計		408,040,000,000	443,601,981,750	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,694,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	109,637,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	134,621,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	134,424,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	129,654,000	
	第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	128,621,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,801,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	118,011,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	234,618,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,690,000	
	第６９６回東京都公募公債	100,000,000	101,340,000	
	第７００回東京都公募公債	100,000,000	101,389,000	
	第７０２回東京都公募公債	100,000,000	101,676,000	
	第７１６回東京都公募公債	100,000,000	101,959,000	
	第７１７回東京都公募公債	100,000,000	101,732,000	
	第７２０回東京都公募公債	100,000,000	102,641,000	

第７２８回東京都公募公債	100,000,000	102,253,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,664,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,893,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,568,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	300,726,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	198,476,000	
平成２３年度第６回北海道公募公債	200,000,000	202,876,000	
平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	102,127,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,727,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	99,892,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	100,952,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	137,324,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,909,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,303,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	203,878,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,677,000	
第２２６回神奈川県公募公債	200,000,000	201,580,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,568,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	198,380,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	235,488,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,913,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,611,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,649,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,192,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,642,500	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,367,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,276,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	155,971,920	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	198,888,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	119,123,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	117,336,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	102,610,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,459,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	98,582,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	103,225,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	104,405,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	116,613,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	102,563,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	400,000,000	439,392,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,406,000	

平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	200,000,000	203,272,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	102,576,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	102,010,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	102,145,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	299,421,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	122,286,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	106,339,000	
平成２３年度第３回静岡県公募公債	103,290,000	104,599,717	
平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,499,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,876,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,639,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,782,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,845,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	119,369,000	
平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,290,000	
平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,566,000	
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,772,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,533,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,753,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,938,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,732,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	308,385,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,436,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	105,296,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	198,548,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	118,411,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	102,019,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	128,030,142	
平成２９年度第１回広島県公募公債	200,000,000	201,056,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,497,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,650,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,488,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	109,346,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	236,002,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	197,230,000	

平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,045,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	102,249,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,434,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	102,229,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,032,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,151,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,640,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,600,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,458,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	108,878,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	119,354,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	101,360,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	109,271,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	133,871,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,300,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,201,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	105,296,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	103,290,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,488,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,842,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,072,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	102,692,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,908,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	102,403,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,031,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,807,600	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	297,525,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,784,000	
第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,254,000	
第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,133,000	
第１０５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,737,000	
第１０７回共同発行市場公募地方債	800,000,000	814,432,000	
第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,879,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,042,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,790,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,820,000	

第１１３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,448,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,830,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,354,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,625,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,264,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,245,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,454,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,356,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,452,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,302,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,158,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,306,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,848,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,542,524	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,347,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,149,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,981,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,876,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,626,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,492,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,803,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,673,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,124,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,210,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,943,133	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,857,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,188,000	
平成２３年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	101,469,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	203,848,000	
平成２９年度第１回熊本県公募公債（５年）	100,000,000	99,943,000	
平成２３年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	101,615,000	
平成２３年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,615,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,904,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	237,998,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	296,925,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	103,730,000	
平成２９年度第１回大阪市公募公債（５年）	100,000,000	99,947,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	130,817,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	136,730,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	116,629,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	127,596,000	

第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,890,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,999,000	
平成２３年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,726,000	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,916,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	102,277,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,346,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	138,106,800	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	236,064,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	120,073,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	110,784,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	118,380,000	
平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	101,731,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,638,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	202,012,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,753,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	202,670,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	109,579,000	
平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,039,000	
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,841,000	
第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	116,919,000	
第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,530,000	
平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,848,000	
平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,191,000	
平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	99,919,000	
平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	118,647,000	
平成２３年度第６回福岡市公募公債	100,000,000	101,469,000	
平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	204,552,000	
平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,341,000	
平成２２年度第６回広島市公募公債	100,000,000	101,306,000	
平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	153,658,500	
平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,968,000	
平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,592,200	
平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	171,720,400	
令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	547,332,500	
平成２３年度第２回千葉市公募公債	200,000,000	203,278,000	
令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	198,350,000	
平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	202,816,000	

	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	116,296,000	
地方債証券合計		27,720,220,000	29,121,706,936	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,832,540	
	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,975,000	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	310,000,000	315,914,800	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,928,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,231,000	
	第７５回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,569,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,790,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	105,027,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	104,040,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	131,123,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	265,580,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	269,486,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,687,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	157,055,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,506,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	110,673,000	
	第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,015,000	
	第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,684,000	
	第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,004,000	
	第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,257,000	
	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	237,874,000	
	第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,044,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,010,000	
	第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,951,000	
	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	134,381,000	
	第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,418,000	
	第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,707,000	
	第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,791,000	

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	101,435,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,008,000	
第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,692,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,802,000	
第１５５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	305,966,500	
第１５７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,442,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,778,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,764,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,942,000	
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,870,000	
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,841,000	
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,489,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,293,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,906,000	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,824,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	617,394,000	
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	203,208,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	428,000,000	435,922,280	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,570,000	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	152,030,040	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,627,000	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,501,000	
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,786,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,706,060	
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,654,000	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,528,000	
	100,000,000	102,396,000	

第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,137,000	
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,446,000	
第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,767,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,420,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,288,000	
第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,643,000	
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,662,000	
第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,682,210	
第２９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	316,736,280	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,899,950	
第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,657,000	
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,260,000	
第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,770,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,362,000	
第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,372,000	
第３６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,797,000	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	216,886,860	
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,885,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	380,850,000	
第３回政府保証公営企業債券（１５年）	300,000,000	307,239,000	
第３回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,898,000	
第３回公営企業債券（２０年）	110,000,000	113,226,300	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	108,975,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	398,148,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	108,498,000	
第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	133,421,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	43,477,600	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	131,162,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	237,756,000	
	200,000,000	236,364,000	

	第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）			
	第２１回地方公共団体金融機構債券（５年）	400,000,000	399,876,000	
	第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	117,162,000	
	第２９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,533,000	
	第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,905,000	
	第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,190,000	
	第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,022,000	
	第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,277,000	
	第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,824,000	
	第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,594,000	
	第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,827,000	
	第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,736,000	
	第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,974,000	
	第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,768,000	
	第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,636,000	
	Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,165,000	
	第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,938,000	
	第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,911,000	
	第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,808,000	
	第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,231,000	
	第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,437,000	
	第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,571,260	
	第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,793,000	
	第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,765,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,243,000	
	第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,923,480	
	第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,343,000	
	Ｆ１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,458,000	
	Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,335,000	
	Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,534,000	
	Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,451,000	
	Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,709,000	
	第７回阪神高速道路債券	100,000,000	110,423,000	
	第１９回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
	第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,824,000	
	第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	121,092,000	
	第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,887,860	
	第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,794,000	
	第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,621,600	
	第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,330,020	

第８１回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,962,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	180,534,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	99,018,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	110,129,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	104,151,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,588,600	
第５９回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	508,920,000	
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,935,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,059,000	13,472,709	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,581,000	14,096,942	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,876,000	14,509,161	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	219,921,000	219,921,000	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	154,924,000	154,823,299	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,749,000	14,314,633	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,730,000	15,414,208	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	280,503,000	279,902,723	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,955,000	12,181,547	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	24,808,000	25,590,196	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,429,000	15,004,572	
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,615,000	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	295,296,000	294,079,380	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,074,000	13,538,780	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,278,000	16,081,164	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,053,000	13,536,222	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,265,000	16,065,343	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,489,000	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,390,000	12,544,131	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,727,000	12,883,287	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,118,000	21,544,366	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,671,000	22,194,039	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,276,000	25,180,907	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,092,000	26,880,557	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,427,000	29,513,920	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,470,000	30,563,968	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,522,000	64,948,579	

第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,288,000	13,761,318	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,347,000	31,118,091	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,432,000	13,902,254	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,182,000	13,783,494	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,917,000	33,976,923	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,324,000	12,741,413	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,082,000	34,184,975	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,158,000	32,096,556	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,441,000	15,205,506	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,386,000	65,000,407	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,271,000	35,247,297	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,864,000	14,489,127	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,583,000	46,088,586	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,329,000	43,691,365	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,540,000	43,959,289	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,736,000	93,588,084	
第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,885,000	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,740,000	100,138,295	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,633,000	50,807,867	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,777,000	51,373,887	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,304,000	51,992,547	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,362,000	45,552,648	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,261,000	45,121,655	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,888,000	51,592,973	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	180,319,500	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,544,000	137,176,714	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,596,000	185,190,004	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,965,000	52,032,551	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,616,000	53,788,517	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,675,000	54,737,753	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,418,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,191,000	172,650,844	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,786,000	58,758,745	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,734,000	121,032,906	
第９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,734,000	
第９３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,571,000	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,494,000	68,577,921	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,328,000	72,313,359	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,680,000	72,000,344	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	215,274,000	223,331,705	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,706,000	148,931,150	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,658,000	73,102,766	

第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,074,000	77,744,382	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,746,000	81,096,437	
第１１１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,117,000	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,108,000	85,691,840	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,233,000	85,632,742	
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,938,000	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,261,000	86,033,464	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,881,000	87,075,604	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,269,000	87,340,460	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,681,000	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,334,000	89,323,340	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,087,000	90,195,242	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,906,000	89,763,942	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,317,000	90,176,229	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,825,000	90,744,808	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,732,000	182,188,699	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,091,000	90,948,666	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,956,000	184,172,224	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,100,000	91,953,607	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,046,000	184,466,436	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,034,000	92,880,712	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,982,000	187,252,257	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,262,000	187,522,993	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	133,002,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,080,000	95,260,704	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,637,000	96,032,895	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,603,000	95,149,805	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,674,000	191,884,841	

第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,085,000	96,097,491	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,297,000	96,453,001	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,692,000	193,662,946	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,475,000	96,692,275	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,613,000	289,719,691	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,454,000	193,815,622	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,481,000	99,619,278	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,918,000	99,721,161	
第１６１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,210,000	
第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,265,000	
第１６９回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,300,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,134,000	
第１９４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,806,000	
第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	114,572,000	
第５７回日本学生支援債券	100,000,000	99,969,000	
第５８回日本学生支援債券	100,000,000	99,965,000	
第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	110,115,000	
い第７９５号商工債	200,000,000	199,796,000	
い第８００号商工債	200,000,000	199,804,000	
い第８０２号商工債	100,000,000	99,913,000	
い第８０４号商工債	300,000,000	299,652,000	
い第７９５号農林債	100,000,000	99,911,000	
い第７９６号農林債	200,000,000	199,812,000	
第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	99,999,000	
第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	99,999,000	
第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	199,998,000	
第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	99,907,000	
第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	99,774,000	
第２２１号商工債（３年）	200,000,000	200,010,000	
第２３６号商工債（３年）	300,000,000	299,304,000	
第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,802,000	
第２１回国際協力機構債券	100,000,000	118,203,000	
第３８回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,155,000	
第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,712,000	
第３３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,500,000	
第５９回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,482,000	
第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,985,000	

	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,427,000	
	第３２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,321,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,237,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,748,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	197,806,000	
特殊債券合計		34,071,539,000	35,727,264,003	
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	99,292,000	
	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	98,500,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	294,384,000	
	第１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,923,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,250,000	
	第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,923,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,202,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,491,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,440,000	
	第９回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,076,000	
	第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,648,000	
	第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,498,000	
	第１回ＨＳＢＣ・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	99,514,000	
	第１０回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	200,000,000	204,942,000	
	第１２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	400,000,000	398,116,000	
	第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,574,000	
	第２１回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,281,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,388,000	
	第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,454,000	
	第７回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,577,000	
	第１１回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,704,000	
	第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,292,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,537,000	
	第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,295,000	

第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,401,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第７回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,107,000	
第２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	101,885,000	
第１１回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,789,000	
第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,374,000	
第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第１２回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,388,000	
第５７回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,328,000	
第９回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,417,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,331,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,634,000	
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,758,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,515,000	
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,012,000	
第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,436,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	99,661,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,616,000	
第８回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	98,909,000	
第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,120,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,609,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,005,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,503,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,337,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,546,000	
第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,194,000	
第２８回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	98,445,000	
第１０回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,458,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,423,000	
第３６回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	200,812,000	
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,226,000	
第１５回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	199,982,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,006,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,274,000	
第１２回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,753,000	

第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,577,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,278,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,040,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,139,000	
第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,684,000	
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	99,435,000	
第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,696,000	
第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,176,000	
第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,047,000	
第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,125,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	96,235,000	
第１４回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,758,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,486,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,456,000	
第２回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	99,574,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,214,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,719,000	
第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,971,000	
第５０回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,700,000	
第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	96,708,000	
第１１回株式会社りそなホールディングス無担保社債	700,000,000	698,789,000	
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	117,172,000	
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	101,414,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	114,615,000	
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,940,000	
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	99,795,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,471,000	
第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	300,645,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,838,000	
第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,074,000	
第２３回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,742,000	
第３７回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,047,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,731,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,249,000	

第８２回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	198,514,000	
第８３回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	98,545,000	
第１９３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,212,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,016,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,260,000	
第４８回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,761,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,492,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,025,000	
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,278,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	198,470,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,182,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,658,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,226,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,951,000	
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	102,725,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,763,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,883,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,056,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,219,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,774,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,650,000	
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,053,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,699,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	234,104,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,613,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,801,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,438,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,772,540	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,248,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,958,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,623,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,829,200	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,434,000	

第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	126,803,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,430,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	112,095,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	97,880,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	99,777,000	
第５３回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	196,928,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,143,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,395,000	
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	202,662,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,759,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,353,000	
第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	100,000,000	101,564,000	
第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,071,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,354,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,497,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,172,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,719,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	96,871,000	
第４９６回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,466,000	
第５０５回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,883,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,661,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,510,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,144,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,979,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,211,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,602,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,777,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,202,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,895,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,952,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,077,360	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,288,000	
第４８７回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,693,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,531,000	
第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,395,000	
第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,885,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,068,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,205,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,558,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,626,000	
第３１７回北海道電力株式会社社債	200,000,000	205,898,000	

	第３２０回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,175,850	
	第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,076,000	
	第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,135,000	
	第３４４回北海道電力株式会社社債	200,000,000	199,662,000	
	第３５１回北海道電力株式会社社債	200,000,000	199,352,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,396,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,487,000	
	第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,303,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,664,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,826,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,946,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,575,000	
	第３回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,624,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	198,932,000	
社債券合計		23,066,000,000	23,302,950,950	
合計			531,753,903,639	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,054,251,435
コール・ローン	1,869,413,435
株式	350,210,568,293
投資信託受益証券	258,991,286
投資証券	9,442,663,748
派生商品評価勘定	1,204,296,368
未収配当金	358,163,768
差入委託証拠金	6,213,362,168
流動資産合計	377,611,710,501
資産合計	377,611,710,501

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,322
前受金	1,203,526,226
未払解約金	3,153,777,612
未払利息	2,657
流動負債合計	4,357,355,817
負債合計	4,357,355,817
純資産の部	
元本等	
元本	153,426,013,952
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	219,828,340,732
元本等合計	373,254,354,684
純資産合計	373,254,354,684
負債純資産合計	377,611,710,501

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

	2020年 4月20日現在
	(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 4月20日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		153,426,013,952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	2.4328円
	(1万口当たり純資産額)	(24,328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

	2020年 4月20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運用監理部が、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

	2020年 4月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2020年 4月20日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	141,673,785,602円
期中追加設定元本額	27,444,668,862円
期中一部解約元本額	15,692,440,512円
期末元本額	153,426,013,952円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,373,397,340円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,845,974円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	26,693,578,924円
世界経済インデックスファンド	8,204,843,225円
外国株式インデックス・オープン	818,812,705円
ＤＣマイセレクション２５	998,348,942円
ＤＣマイセレクション５０	5,260,343,810円
ＤＣマイセレクション７５	5,376,812,815円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	9,289,841,292円
ＤＣマイセレクションＳ２５	417,980,280円

区分	2020年 4月20日現在
ＤＣマイセレクションＳ５０	2,198,952,488円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,574,506,744円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	90,395,526円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	224,754,020円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	144,399,213円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,469,470,023円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	2,049,171,557円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	9,367,228円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,500,216円
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	38,006,453円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	44,005,456円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	158,673,874円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	35,018,335円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	195,440,180円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	670,106,334円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	346,025,322円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,353,218,471円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,912,308,106円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	75,354,319円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	348,191,526円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	8,613,717円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	107,261,652円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,025,028,928円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,162,372,960円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,044,279,546円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,264,957,748円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,503,070,291円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,342,559,032円
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,378,414,375円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,106,865,263円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,298,002,122円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,178,678,308円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	746,061,927円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,416,183円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	247,460,791円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,221,913,730円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	35,445,013,371円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	115,224,861円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	380,878,970円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	77,203,657円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,068,820円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	67,141,924円
グローバル経済コア	998,244,710円

区分	2020年 4月20日現在
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	9,581,110円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	868,234円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	492,227,230円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,871,744円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	333,019円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	462,582円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	195,499円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	102,698円
ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,210,343,528円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,232,489,057円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,783,815,032円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	126,353,983円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	108,510,773円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	402,638,376円
ＳＭＴＡＭバランスファンド２００２（適格機関投資家専用）	822,817,503円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△5,554,041,819
投資信託受益証券	△7,512,628
投資証券	△955,020,411
合計	△6,516,574,858

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	12,071,002,558	－	13,274,528,784	1,203,526,226
合計		12,071,002,558	－	13,274,528,784	1,203,526,226

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,333,147,220	－	1,332,426,400	720,820
	アメリカドル	971,370,000	－	970,920,000	450,000
	カナダドル	56,905,260	－	56,854,200	51,060
	ユーロ	35,176,800	－	35,178,000	△1,200
	イギリスポンド	55,269,640	－	55,243,400	26,240
	スイスフラン	60,158,700	－	60,199,200	△40,500
	スウェーデンクローナ	28,061,800	－	28,054,000	7,800
	デンマーククローネ	22,002,400	－	22,008,000	△5,600
	オーストラリアドル	53,600,820	－	53,406,600	194,220
	香港ドル	27,848,000	－	27,820,000	28,000
	シンガポールドル	22,753,800	－	22,743,000	10,800
合計		1,333,147,220	－	1,332,426,400	720,820

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APACHE CORP	64,273	8.49	545,677.77	
	BAKER HUGHES CO	57,644	13.03	751,101.32	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	20.96	752,023.84	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	41.33	908,268.08	
	CHEVRON CORP	180,346	87.17	15,720,760.82	

CONCHO RESOURCES INC	19,245	51.94	999,585.30	
CONOCOPHILLIPS	104,738	35.26	3,693,061.88	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	11.22	85,799.34	
DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	9.22	349,078.42	
DIAMONDBACK ENERGY INC	20,487	31.52	645,750.24	
EOG RESOURCES INC	55,564	41.84	2,324,797.76	
EXXON MOBIL	403,535	43.22	17,440,782.70	
HALLIBURTON CO	97,620	7.58	739,959.60	
HESS CORP	24,844	37.35	927,923.40	
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	27.02	381,252.20	
KINDER MORGAN INC	194,644	14.97	2,913,820.68	
MARATHON OIL CORP	74,537	4.35	324,235.95	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,097	25.45	1,580,368.65	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	11.67	433,680.54	
NOBLE ENERGY INC	67,291	6.95	467,672.45	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	85,461	13.63	1,164,833.43	
ONEOK INC	36,957	29.38	1,085,796.66	
PHILLIPS 66	42,441	59.53	2,526,512.73	
PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	76.63	1,214,125.72	
SCHLUMBERGER	132,260	15.28	2,020,932.80	
TARGA RESOURCES CORP	20,002	7.93	158,615.86	
TECHNIPFMC PLC	55,005	8.12	446,640.60	
VALERO ENERGY CORP	39,247	51.76	2,031,424.72	
WILLIAMS COS	114,214	18.08	2,064,989.12	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	21,038	221.50	4,659,917.00	
ALBEMARLE CORP	10,180	61.47	625,764.60	
AMCOR PLC	153,458	8.78	1,347,361.24	
AVERY DENNISON CORP	7,457	109.36	815,497.52	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	18.26	321,485.56	
BALL CORP	29,134	70.20	2,045,206.80	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	78.16	863,902.48	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	28.29	539,518.59	
CORTEVA INC	70,180	25.51	1,790,291.80	
CROWN HOLDINGS INC	12,992	62.90	817,196.80	
DOW INC	70,834	33.42	2,367,272.28	
DUPONT DE NEMOURS INC	70,752	38.36	2,714,046.72	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	55.10	653,375.80	
ECOLAB INC	24,761	178.75	4,426,028.75	
FMC CORP	12,118	86.10	1,043,359.80	
FREEPORT-MCMORAN INC	138,927	8.34	1,158,651.18	
INT'L PAPER CO	33,803	31.85	1,076,625.55	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,709	125.12	1,214,790.08	

LINDE PLC	51,243	188.55	9,661,867.65	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	52.19	1,331,523.47	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	198.87	1,189,441.47	
MOSAIC CO/THE	31,911	11.45	365,380.95	
NEWMONT CORPORATION	78,251	59.23	4,634,806.73	
NUCOR CORP	29,015	37.33	1,083,129.95	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	90.84	807,567.60	
PPG INDUSTRIES INC	22,118	93.31	2,063,830.58	
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	65.86	818,639.80	
SEALED AIR CORP	14,689	29.50	433,325.50	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,930	516.75	4,097,827.50	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	23.47	428,867.31	
VULCAN MATERIALS CO	12,657	112.03	1,417,963.71	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	40.78	140,894.90	
WESTROCK CO	24,734	30.69	759,086.46	
3 M COMPANY	55,862	146.46	8,181,548.52	
ACUITY BRANDS INC	3,505	86.36	302,691.80	
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	24.43	276,791.90	
ALLEGION PLC	8,963	97.63	875,057.69	
AMETEK INC	22,247	80.31	1,786,656.57	
BOEING CO	51,941	154.00	7,998,914.00	
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	13.74	1,038,070.74	
CATERPILLAR	53,692	116.30	6,244,379.60	
CUMMINS INC	13,652	149.18	2,036,605.36	
DEERE&CO	29,071	138.46	4,025,170.66	
DOVER CORP	13,872	88.49	1,227,533.28	
EATON CORP	40,190	79.26	3,185,459.40	
EMERSON ELECTRIC CO	59,226	50.54	2,993,282.04	
FASTENAL CO	55,807	35.93	2,005,145.51	
FLOWSERVE CORP	10,826	24.80	268,484.80	
FORTIVE CORP	28,503	60.36	1,720,441.08	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	46.60	596,946.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,906	138.19	3,303,570.14	
GENERAL ELECTRIC CO	848,526	6.84	5,803,917.84	
GRAINGER (WW) INC	4,461	280.22	1,250,061.42	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	29.78	453,430.28	
HEICO CORP	3,640	82.61	300,700.40	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	73.34	472,969.66	
HONEYWELL INTL INC	69,406	138.32	9,600,237.92	
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	11.65	425,807.50	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	195.96	690,171.12	
IDEX CORP	6,916	152.73	1,056,280.68	

ILLINOIS TOOL WORKS	31,233	158.58	4,952,929.14	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	26.81	846,177.22	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	84.20	1,012,589.20	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	53.67	1,078,767.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	23.77	487,285.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	75,045	29.54	2,216,829.30	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,485	203.50	4,372,197.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	183.88	530,493.80	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,659	401.51	9,900,835.09	
MASCO CORP	27,698	39.99	1,107,643.02	
MIDDLEBY CORP	4,364	51.68	225,531.52	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,557	356.30	5,542,959.10	
OTIS WORLDWIDE CORP	37,775	46.15	1,743,316.25	
OWENS CORNING	10,458	40.01	418,424.58	
PACCAR INC	32,395	67.65	2,191,521.75	
PARKER HANNIFIN CORP	12,505	138.60	1,733,193.00	
PENTAIR PLC	13,583	31.66	430,037.78	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	147,006	66.07	9,712,686.42	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,244	168.59	1,895,625.96	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,116	321.97	3,257,048.52	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	32.70	452,175.60	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	41.08	498,957.68	
SNAP-ON INC	4,900	118.33	579,817.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	22.64	192,009.84	
STANLEY BLACK&DECKER	14,798	112.54	1,665,366.92	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	318.08	1,113,598.08	
TEXTRON	21,534	27.75	597,568.50	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,309	89.91	2,095,712.19	
TRANSDIGM GROUP INC	4,693	337.40	1,583,418.20	
UNITED RENTALS INC	6,446	105.05	677,152.30	
WABCO HOLDINGS INC	4,981	135.36	674,228.16	
WABTEC CORP	17,764	49.25	874,877.00	
XYLEM INC	17,545	69.59	1,220,956.55	
CINTAS CORP	8,272	204.16	1,688,811.52	
COPART INC	19,784	72.10	1,426,426.40	
COSTAR GROUP INC	3,564	635.55	2,265,100.20	
EQUIFAX INC	11,791	127.97	1,508,894.27	
IHS MARKIT LTD	35,672	67.17	2,396,088.24	
MANPOWER GROUP	5,123	63.74	326,540.02	
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	13.26	462,097.74	
REPUBLIC SERVICES INC	21,742	80.28	1,745,447.76	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	43.24	413,633.84	

ROLLINS INC	14,566	38.96	567,491.36	
TRANSUNION	16,944	76.18	1,290,793.92	
VERISK ANALYTICS INC	14,560	153.79	2,239,182.40	
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	88.04	2,168,337.16	
WASTE MANAGEMENT INC	41,233	100.27	4,134,432.91	
AMERCO	602	275.25	165,700.50	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	11.57	114,774.40	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	74.23	978,796.78	
CSX CORP	71,794	62.77	4,506,509.38	
DELTA AIR LINES INC	15,095	24.27	366,355.65	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	71.74	1,138,370.32	
FEDEX CORP	24,100	124.85	3,008,885.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	107.58	894,958.02	
KANSAS CITY SOUTHERN	9,654	139.36	1,345,381.44	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	36.59	391,513.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,343	160.67	4,071,859.81	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,106	136.65	1,244,334.90	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	31.19	357,593.35	
UBER TECHNOLOGIES INC	38,449	28.00	1,076,572.00	
UNION PACIFIC CORP	67,430	149.89	10,107,082.70	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	29.08	174,567.24	
UNITED PARCEL SERVICE B	68,080	102.75	6,995,220.00	
XPO LOGISTICS INC	8,001	58.96	471,738.96	
APTIV PLC	24,462	63.92	1,563,611.04	
AUTOLIV INC	10,139	56.25	570,318.75	
BORGWARNER INC	19,890	26.98	536,632.20	
FORD MOTOR COMPANY	375,147	5.12	1,920,752.64	
GENERAL MOTORS CO	120,926	22.48	2,718,416.48	
HARLEY-DAVIDSON	14,677	19.35	283,999.95	
LEAR CORP	5,287	87.34	461,766.58	
TESLA INC	12,916	753.89	9,737,243.24	
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	12.93	149,302.71	
DR HORTON INC	32,171	39.88	1,282,979.48	
GARMIN LTD	12,758	82.11	1,047,559.38	
HANESBRANDS INC	31,136	9.21	286,762.56	
HASBRO INC	12,468	75.20	937,593.60	
LEGGETT & PLATT INC	10,594	28.89	306,060.66	
LENNAR CORP-CL A	28,545	42.93	1,225,436.85	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,596	225.86	2,393,212.56	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	79.60	402,935.20	
NEWELL BRANDS INC	37,563	12.86	483,060.18	
NIKE B	119,223	89.91	10,719,339.93	

NVR INC	337	2,917.75	983,281.75	
POLARIS INC	4,691	60.05	281,694.55	
PULTE GROUP INC	21,959	25.52	560,393.68	
PVH CORP	7,252	44.88	325,469.76	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	72.68	332,729.04	
TAPESTRY INC	25,989	15.22	395,552.58	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	9.85	157,107.50	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	8.89	144,755.87	
VF CORP	32,491	57.50	1,868,232.50	
WHIRLPOOL CORP	6,079	105.33	640,301.07	
ARAMARK	24,034	21.97	528,026.98	
CARNIVAL CORPORATION	46,126	12.56	579,342.56	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,577	820.27	2,113,835.79	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,266	63.35	713,701.10	
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	362.97	1,350,611.37	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,662	75.62	1,940,560.44	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	47.01	1,556,031.00	
MARRIOTT INTL A	26,598	84.26	2,241,147.48	
MCDONALD'S CORP	72,055	186.10	13,409,435.50	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	15.00	264,930.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	58,656	14.08	825,876.48	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	12.38	220,834.44	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	37.39	571,730.49	
STARBUCKS CORP	113,355	77.10	8,739,670.50	
VAIL RESORTS INC	3,574	162.71	581,525.54	
WYNN RESORTS LTD	9,302	78.46	729,834.92	
YUM BRANDS INC	29,166	84.17	2,454,902.22	
ACTIVISION BLIZZARD INC	73,316	66.88	4,903,374.08	
ALPHABET INC-CL A	28,573	1,279.00	36,544,867.00	
ALPHABET INC-CL C	29,486	1,283.25	37,837,909.50	
ALTICE USA INC- A	12,457	26.05	324,504.85	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14,344	499.42	7,163,680.48	
COMCAST CORP-CL A	432,984	38.08	16,488,030.72	
DISCOVERY INC - A	12,804	22.14	283,480.56	
DISCOVERY INC-C	31,156	20.20	629,351.20	
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	22.52	542,799.56	
ELECTRONIC ARTS INC	27,876	115.15	3,209,921.40	
FACEBOOK INC-A	229,762	179.24	41,182,540.88	
FOX CORP - CLASS A	33,968	26.87	912,890.00	
FOX CORP- CLASS B	15,092	26.23	395,863.16	
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	223.72	1,749,714.12	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	15.06	509,540.04	

LIBERTY BROADBAND-C	10,201	124.87	1,273,798.87	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	18.23	282,856.68	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,106	17.29	728,012.74	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	25.28	472,559.04	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	31.96	486,846.68	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	31.36	200,202.24	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	38.35	484,628.95	
MATCH GROUP INC	4,600	80.00	368,000.00	
NETFLIX INC	41,798	422.96	17,678,882.08	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	8.90	297,963.10	
OMNICOM GROUP	20,835	54.57	1,136,965.95	
PINTEREST INC- CLASS A	32,190	17.45	561,715.50	
ROKU INC	8,355	126.80	1,059,414.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	148,452	5.29	785,311.08	
SNAP INC - A	67,334	12.98	873,995.32	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	10,751	124.44	1,337,854.44	
THE WALT DISNEY CO	171,900	106.63	18,329,697.00	
TRIPADVISOR INC	10,393	18.78	195,180.54	
TWITTER INC	70,484	26.70	1,881,922.80	
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	15.80	852,820.80	
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	36.33	449,329.44	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	118.86	735,267.96	
AMAZON.COM	40,314	2,375.00	95,745,750.00	
AUTOZONE INC	2,285	991.80	2,266,263.00	
BEST BUY COMPANY INC	22,720	70.40	1,599,488.00	
BOOKING HOLDINGS INC	4,000	1,470.87	5,883,480.00	
BURLINGTON STORES INC	6,004	182.61	1,096,390.44	
CARMAX INC	15,777	65.22	1,028,975.94	
DOLLAR GENERAL CORP	24,570	182.11	4,474,442.70	
DOLLAR TREE INC	22,651	81.73	1,851,266.23	
EBAY	73,924	37.45	2,768,823.42	
EXPEDIA GROUP INC	13,383	63.22	846,073.26	
GAP	21,891	8.35	182,789.85	
GENUINE PARTS CO	13,937	74.65	1,040,397.05	
GRUBHUB INC	8,261	42.50	351,092.50	
HOME DEPOT	104,694	209.42	21,925,017.48	
KOHLS CORP	14,645	18.48	270,639.60	
LKQ CORP	29,351	20.93	614,463.18	
LOWES COMPANIES	73,381	97.10	7,125,295.10	
MERCADOLIBRE INC	4,280	597.50	2,557,300.00	
NORDSTROM INC	10,094	18.80	189,767.20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,237	373.51	2,703,091.87	

ROSS STORES INC	34,327	91.72	3,148,472.44	
TARGET (DAYTON HUDSON)	48,428	113.42	5,492,703.76	
TIFFANY & CO	10,426	129.15	1,346,517.90	
TJX COMPANIES INC	115,530	49.73	5,745,306.90	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	92.72	1,039,576.64	
ULTA BEAUTY INC	5,362	215.51	1,155,564.62	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,137	317.92	13,396,195.04	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	4.95	167,805.00	
KROGER CO	76,549	31.93	2,444,209.57	
SYSCO CORP	45,437	50.31	2,285,935.47	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,429	44.50	3,223,090.50	
WALMART INC	135,634	132.12	17,919,964.08	
ALTRIA GROUP INC	178,226	40.85	7,280,532.10	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	37.19	1,940,908.91	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	63.97	1,855,769.70	
BUNGE LIMITED	13,606	40.09	545,464.54	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	50.34	798,845.46	
COCA-COLA CO	388,189	48.06	18,656,363.34	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	22,612	41.62	941,111.44	
CONAGRA BRANDS INC	45,992	33.58	1,544,411.36	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,999	162.70	2,603,037.30	
GENERAL MILLS INC	57,694	60.67	3,500,294.98	
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	146.46	2,035,208.16	
HORMEL FOODS CORP	27,157	50.51	1,371,700.07	
INGREDION INC	5,835	80.69	470,826.15	
JM SMUCKER CO	10,802	121.58	1,313,307.16	
KELLOGG CO	24,092	65.02	1,566,461.84	
KRAFT HEINZ CO/THE	64,187	29.33	1,882,604.71	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	59.92	774,406.08	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,808	156.89	1,852,557.12	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	44.38	807,849.14	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	137,361	53.48	7,346,066.28	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,638	62.19	2,340,707.22	
PEPSICO INC	132,991	137.55	18,292,912.05	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	148,405	77.96	11,569,653.80	
TYSON FOODS INC	28,214	62.34	1,758,860.76	
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	73.55	1,725,041.70	
CLOROX COMPANY	11,988	193.50	2,319,678.00	
COLGATE-PALMOLIVE CO	77,689	73.42	5,703,926.38	
COTY INC-CL A	30,534	5.75	175,570.50	
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,244	174.26	3,701,979.44	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,715	141.94	4,643,567.10	

PROCTER & GAMBLE CO	237,820	124.69	29,653,775.80	
ABBOTT LABORATORIES	168,671	96.01	16,194,102.71	
ABIOMED INC	4,421	166.02	733,974.42	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	193.00	1,372,809.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	89.19	1,302,530.76	
ANTHEM INC	24,196	267.82	6,480,172.72	
BAXTER INTERNATIONAL	46,293	92.95	4,302,934.35	
BECTON DICKINSON & CO	25,805	261.40	6,745,427.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	133,021	38.29	5,093,374.09	
CARDINAL HEALTH	27,968	51.23	1,432,800.64	
CENTENE CORP	55,738	71.29	3,973,562.02	
CERNER CORP	30,009	70.01	2,100,930.09	
CIGNA CORP	35,629	194.13	6,916,657.77	
CVS HEALTH CORP	124,114	63.36	7,863,863.04	
DANAHER CORP	59,703	156.53	9,345,310.59	
DAVITA INC	9,056	78.16	707,816.96	
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	40.86	824,881.68	
DEXCOM INC	8,558	323.40	2,767,657.20	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19,907	228.41	4,546,957.87	
HCA HEALTHCARE INC	25,918	115.66	2,997,675.88	
HENRY SCHEIN INC	14,096	53.64	756,109.44	
HOLOGIC INC	24,459	43.79	1,071,059.61	
HUMANA INC	12,640	373.59	4,722,177.60	
IDEXX LABORATORIES INC	8,195	265.16	2,172,986.20	
INSULET CORP	5,923	199.34	1,180,690.82	
INTUITIVE SURGICAL INC	11,028	526.33	5,804,367.24	
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	148.52	1,310,986.04	
MCKESSON CORP	15,443	141.61	2,186,883.23	
MEDTRONIC PLC	127,849	103.33	13,210,637.17	
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	95.40	1,230,087.60	
RESMED INC	13,491	165.16	2,228,173.56	
STERIS PLC	8,111	154.97	1,256,961.67	
STRYKER CORP	32,154	189.51	6,093,504.54	
TELEFLEX INC	4,427	346.68	1,534,752.36	
THE COOPER COS INC	4,688	306.28	1,435,840.64	
UNITEDHEALTH GROUP INC	90,353	290.56	26,252,967.68	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	107.79	781,261.92	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	115.75	953,432.75	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	181.12	2,232,304.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,079	169.98	1,203,288.42	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,652	118.58	2,330,334.16	
ABBVIE INC	141,058	83.45	11,771,290.10	

AGILENT TECHNOLOGIES	29,560	79.55	2,351,498.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	103.48	2,144,726.48	
ALLERGAN PLC	31,323	187.00	5,857,401.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	138.48	1,476,889.20	
AMGEN	56,674	234.97	13,316,689.78	
BEIGENE LTD-ADR	3,859	157.43	607,522.37	
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	427.21	914,656.61	
BIOGEN INC	17,218	342.55	5,898,025.90	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	89.12	1,530,279.52	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	223,587	60.60	13,549,372.20	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	24.29	875,921.69	
EXACT SCIENCES CORP	13,278	74.65	991,202.70	
GILEAD SCIENCES INC	120,680	83.99	10,135,913.20	
ILLUMINA INC	14,031	316.36	4,438,847.16	
INCYTE CORP	17,504	100.00	1,750,400.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	55.07	705,832.19	
IQVIA HOLDINGS INC	15,762	131.57	2,073,806.34	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	111.19	552,725.49	
JOHNSON & JOHNSON	251,260	152.02	38,196,545.20	
LILLY (ELI) & CO	82,421	157.29	12,963,999.09	
MERCK & CO	242,811	83.46	20,265,006.06	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	720.91	1,629,977.51	
MYLAN NV	49,481	16.11	797,138.91	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	98.96	838,587.04	
PERKINELMER INC	10,645	83.63	890,241.35	
PERRIGO CO PLC	11,333	51.87	587,842.71	
PFIZER	527,795	36.91	19,480,913.45	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,727	568.79	4,395,040.33	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	118.54	847,205.38	
SEATTLE GENETICS INC	11,471	136.87	1,570,035.77	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	10.27	1,114,130.68	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,248	331.58	12,682,271.84	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,535	270.46	6,635,736.10	
WATERS CORP	6,363	197.51	1,256,756.13	
ZOETIS INC	45,448	130.72	5,940,962.56	
BANK OF AMERICA CORP	821,173	23.28	19,116,907.44	
CITIGROUP	208,268	45.45	9,465,780.60	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	19.87	794,998.70	
COMERICA INC	14,360	30.00	430,800.00	
EAST WEST BANCORP INC	13,827	28.01	387,294.27	
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	16.63	1,129,858.83	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	100.02	1,587,517.44	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	8.06	798,036.72	
JPMORGAN CHASE & CO	300,112	95.18	28,564,660.16	
KEY CORP	94,322	10.81	1,019,620.82	
M & T BANK CORP	11,742	105.48	1,238,546.16	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	11.48	421,545.60	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,823	101.50	4,245,034.50	
REGIONS FINL CORP	92,434	9.52	879,971.68	
SIGNATURE BANK	5,223	88.79	463,750.17	
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	173.69	858,549.67	
TRUIST FINANCIAL CORP	128,020	33.40	4,275,868.00	
US BANCORP	141,597	35.06	4,964,390.82	
WELLS FARGO & CO	386,720	28.38	10,975,113.60	
ZIONS BANCORPORATION	15,186	29.08	441,608.88	
ALLY FINANCIAL INC	36,028	15.37	553,750.36	
AMERICAN EXPRESS	66,370	87.39	5,800,074.30	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	110.95	1,314,757.50	
BANK NEW YORK CO	79,248	37.39	2,963,082.72	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	125,861	191.20	24,064,623.20	
BLACKROCK INC	11,048	476.87	5,268,459.76	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,958	50.01	3,148,529.58	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44,494	54.63	2,430,707.22	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	102.00	1,082,424.00	
CME GROUP INC	34,191	191.62	6,551,679.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,078	35.04	1,018,893.12	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	39.87	841,575.96	
EATON VANCE CORP	10,061	34.54	347,506.94	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	15.75	633,386.25	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	281.10	1,021,236.30	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	16.34	425,983.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,411	183.49	5,580,114.39	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53,142	90.40	4,804,036.80	
INVESCO LTD	30,943	9.07	280,653.01	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	13.20	339,319.20	
KKR & CO INC -A	47,403	23.92	1,133,879.76	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	429.78	1,544,199.54	
MOODY'S CORP	16,220	239.36	3,882,419.20	
MORGAN STANLEY	115,860	39.09	4,528,967.40	
MSCI INC	7,909	317.18	2,508,576.62	
NASDAQ INC	10,979	111.24	1,221,303.96	
NORTHERN TRUST CORP	19,520	80.00	1,561,600.00	
PRICE T ROWE GROUP INC	21,808	103.49	2,256,909.92	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	63.67	762,002.56	

S&P GLOBAL INC	23,319	282.59	6,589,716.21	
SCHWAB (CHARLES) CORP	110,150	35.79	3,942,268.50	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	50.20	615,502.20	
STATE STREET CORP	34,742	58.49	2,032,059.58	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	15.62	829,343.90	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	37.32	965,729.64	
VOYA FINANCIAL INC	12,505	43.52	544,217.60	
AFLAC	68,601	36.48	2,502,564.48	
ALLEGHANY CORP	1,276	558.52	712,671.52	
ALLSTATE CORP	30,932	104.92	3,245,385.44	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	71.36	500,447.68	
AMERICAN INT'L GROUP	83,130	24.50	2,036,685.00	
AON PLC	22,349	190.81	4,264,412.69	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	27.15	1,053,311.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	83.60	1,490,838.80	
ASSURANT INC	5,819	105.81	615,708.39	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	25.46	339,814.62	
BROWN & BROWN INC	22,945	38.10	874,204.50	
CHUBB LTD	43,249	118.79	5,137,548.71	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	85.80	1,274,215.80	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	176.84	383,035.44	
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	196.35	770,870.10	
FNF GROUP	24,961	27.46	685,429.06	
GLOBE LIFE INC	9,867	77.25	762,225.75	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	40.01	1,379,584.81	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	29.66	527,651.40	
LOEWS CORP	25,707	36.14	929,050.98	
MARKEL CORP	1,312	954.39	1,252,159.68	
MARSH & MCLENNAN COS	48,167	98.54	4,746,376.18	
METLIFE INC	74,667	33.06	2,468,491.02	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	30.53	812,689.02	
PROGRESSIVE CORP	55,794	82.50	4,603,005.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,690	56.60	2,133,254.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	99.90	542,556.90	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,122	157.29	805,639.38	
TRAVELERS COS INC/THE	24,049	105.07	2,526,828.43	
UNUM GROUP	18,574	15.51	288,082.74	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	195.39	2,347,806.24	
WR BERKLEY CORP	14,085	56.99	802,704.15	
CBRE GROUP INC-A	30,208	44.50	1,344,256.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.28	422,436.00	
JONES LANG LASALLE INC	4,484	107.00	479,788.00	

WEYERHAEUSER CO	69,607	20.10	1,399,100.70	
ACCENTURE PLC-CL A	60,578	175.09	10,606,602.02	
ADOBE INC	46,170	344.11	15,887,558.70	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	15,447	105.35	1,627,341.45	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	37.86	152,045.76	
ANSYS INC	8,044	263.90	2,122,811.60	
AUTODESK INC	20,964	180.94	3,793,226.16	
AUTOMATIC DATA PROCESS	41,287	141.08	5,824,769.96	
BLACK KNIGHT INC	14,413	67.48	972,589.24	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	77.26	1,038,219.88	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	109.94	1,206,151.74	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,369	78.65	2,073,921.85	
CDK GLOBAL INC	10,687	35.20	376,182.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	11,974	106.12	1,270,680.88	
CITRIX SYSTEMS INC	12,443	150.41	1,871,551.63	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	52,296	53.81	2,814,047.76	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	92.00	285,200.00	
DOCUSIGN INC	10,116	100.35	1,015,140.60	
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	19.18	464,482.06	
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	15.33	360,224.34	
EPAM SYSTEMS INC	5,266	209.94	1,105,544.04	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	58,635	127.96	7,502,934.60	
FISERV INC	55,147	100.63	5,549,442.61	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,052	223.59	1,800,346.68	
FORTINET INC	13,898	112.96	1,569,918.08	
GARTNER INC	8,569	105.96	907,971.24	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,687	154.88	4,443,042.56	
GODADDY INC - CLASS A	16,351	66.82	1,092,573.82	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	88.77	703,324.71	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	84,481	120.12	10,147,857.72	
INTUIT INC	24,837	265.36	6,590,746.32	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	169.66	1,248,697.60	
LEIDOS HOLDINGS	12,829	99.28	1,273,663.12	
MASTERCARD INC-CLASS A	85,613	259.97	22,256,811.61	
MICROSOFT CORP	692,070	178.60	123,603,702.00	
MONGODB INC	4,623	154.19	712,820.37	
NORTONLIFELOCK INC	59,628	20.12	1,199,715.36	
OKTA INC	10,083	148.09	1,493,191.47	
ORACLE CORP	219,169	54.62	11,971,010.78	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,363	193.43	1,811,085.09	
PAYCHEX INC	30,214	67.50	2,039,445.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	224.99	1,069,827.45	

PAYPAL HOLDINGS INC	106,402	111.85	11,901,063.70	
PTC INC	9,984	66.66	665,533.44	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,050	236.51	1,667,395.50	
SABRE CORP	24,114	5.99	144,563.43	
SALESFORCE.COM INC	79,469	162.62	12,923,248.78	
SERVICENOW INC	17,998	299.59	5,392,020.82	
SPLUNK INC	14,752	135.15	1,993,732.80	
SQUARE INC - A	33,186	61.09	2,027,332.74	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	52.00	1,132,300.00	
SYNOPSYS INC	14,359	154.98	2,225,357.82	
TWILIO INC - A	11,282	107.88	1,217,102.16	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	326.72	1,213,111.36	
VERISIGN INC	10,096	209.93	2,119,453.28	
VISA INC-CLASS A SHARES	163,330	169.54	27,690,968.20	
VMWARE INC-CLASS A	7,867	136.48	1,073,688.16	
WESTERN UNION CO	38,757	19.93	772,427.01	
WIX.COM LTD	5,010	126.24	632,462.40	
WORKDAY INC-CLASS A	15,669	149.30	2,339,381.70	
AMPHENOL CORPORATION	27,679	84.22	2,331,125.38	
APPLE INC	424,286	282.80	119,988,080.80	
ARISTA NETWORKS INC	4,940	210.02	1,037,498.80	
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	55.29	433,418.31	
CDW CORP/DE	13,742	108.82	1,495,404.44	
CISCO SYSTEMS	404,599	42.48	17,187,365.52	
COGNEX CORP	16,230	47.04	763,459.20	
CORNING	72,399	20.72	1,500,107.28	
DELL TECHNOLOGIES -C	15,558	41.51	645,812.58	
F5 NETWORKS INC	5,350	124.11	663,988.50	
FLEX LTD	48,956	8.16	399,725.74	
FLIR SYSTEMS INC	11,686	34.15	399,076.90	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	9.71	1,201,894.09	
HP INC	141,556	15.52	2,196,949.12	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	119.05	381,793.35	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	22.57	706,531.28	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	95.84	1,689,084.16	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,366	157.77	2,582,063.82	
NETAPP INC	20,586	42.15	867,699.90	
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	51.47	1,175,368.92	
TE CONNECTIVITY LTD	31,955	67.44	2,155,045.20	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	32.46	775,274.64	
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	42.32	1,204,173.28	
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	18.12	302,930.16	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	202.98	1,047,782.76	
AT&T INC	696,675	31.23	21,757,160.25	
CENTURYLINK INC	93,962	10.25	963,110.50	
T-MOBILE US INC	41,028	90.99	3,733,137.72	
VERIZON COMMUNICATIONS	394,419	58.46	23,057,734.74	
AES CORP	61,761	13.12	810,304.32	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	52.87	1,277,127.72	
AMEREN CORPORATION	23,120	77.83	1,799,429.60	
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,150	86.38	4,072,817.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	131.76	2,229,642.72	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	110.70	1,264,083.30	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	16.53	796,117.86	
CMS ENERGY CORP	26,742	63.17	1,689,292.14	
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	89.56	2,843,082.20	
DOMINION ENERGY INC	78,536	81.51	6,401,469.36	
DTE ENERGY COMPANY	18,360	105.85	1,943,406.00	
DUKE ENERGY CORP	69,920	90.10	6,299,792.00	
EDISON INTL	33,630	62.06	2,087,077.80	
ENTERGY CORP	18,696	101.27	1,893,343.92	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	43.36	903,362.24	
EVERGY INC	21,330	60.98	1,300,703.40	
EVERSOURCE ENERGY	30,920	91.56	2,831,035.20	
EXELON CORP	92,804	38.44	3,567,385.76	
FIRSTENERGY CORP	50,559	46.21	2,336,331.39	
NEXTERA ENERGY INC	46,622	246.26	11,481,133.72	
NISOURCE INC	35,781	26.38	943,902.78	
NRG ENERGY INC	23,078	31.37	723,956.86	
OGE ENERGY CORP	19,225	31.71	609,624.75	
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	79.91	860,790.52	
PPL CORPORATION	69,111	26.39	1,823,839.29	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	54.62	2,582,979.80	
SEMPRA ENERGY	26,914	124.44	3,349,178.16	
SOUTHERN CO	100,071	57.47	5,751,080.37	
UGI CORP	18,019	28.16	507,415.04	
VISTRA ENERGY CORP	35,087	17.54	615,425.98	
WEC ENERGY GROUP INC	30,120	100.34	3,022,240.80	
XCEL ENERGY INC	50,065	67.15	3,361,864.75	
ADVANCED MICRO DEVICES	100,963	56.60	5,714,505.80	
ANALOG DEVICES	35,161	102.80	3,614,550.80	
APPLIED MATERIALS	88,168	53.20	4,690,537.60	
BROADCOM INC	37,839	265.88	10,060,633.32	
INTEL CORP	414,846	60.36	25,040,104.56	

	KLA CORP	15,075	161.21	2,430,240.75	
	LAM RESEARCH CORP	13,850	279.02	3,864,427.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	60,583	25.95	1,572,431.76	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,878	53.09	1,373,863.02	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	80.34	1,835,286.96	
	MICRON TECHNOLOGY	105,648	45.70	4,828,113.60	
	NVIDIA CORP	55,452	292.32	16,209,728.64	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,067	90.17	2,440,631.39	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	13.73	494,225.08	
	QORVO INC	10,609	86.27	915,238.43	
	QUALCOMM	108,933	76.17	8,297,426.61	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,107	95.40	1,536,607.80	
	TERADYNE INC	16,048	63.83	1,024,343.84	
	TEXAS INSTRUMENTS	89,169	113.55	10,125,139.95	
	XILINX INC	23,543	89.00	2,095,327.00	
アメリカドル 小計		28,685,388		2,326,380,175.70 (250,993,157,156)	
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	13.67	561,317.54	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	122,328	18.74	2,292,426.72	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	3.84	371,197.44	
	ENBRIDGE	193,997	41.28	8,008,196.16	
	HUSKY ENERGY INC	31,439	3.78	118,839.42	
	IMPERIAL OIL	24,763	17.18	425,428.34	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	10.30	365,186.50	
	KEYERA CORP	18,607	17.29	321,715.03	
	OVINTIV INC	23,486	5.72	134,339.92	
	PARKLAND FUEL CORP	11,000	28.51	313,610.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	28.56	1,536,984.96	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	8.18	150,103.00	
	SUNCOR ENERGY	147,329	21.37	3,148,420.73	
	TC ENERGY CORP	88,526	63.28	5,601,925.28	
	AGNICO EAGLE MINES	23,423	75.55	1,769,607.65	
	BARRICK GOLD CORP	170,934	34.40	5,880,129.60	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	43.00	564,977.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	7.14	406,266.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	18,244	173.85	3,171,719.40	
	KINROSS GOLD CORP	125,340	8.50	1,065,390.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,848	48.45	1,300,785.60	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.11	380,304.73	
	METHANEX CORP	7,099	18.45	130,976.55	
	NUTRIEN LTD	55,504	50.25	2,789,076.00	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	11.07	505,644.39	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	29.80	128,944.60	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	45,525	48.16	2,192,484.00	
CAE INC	25,999	21.88	568,858.12	
WSP GLOBAL INC	9,471	86.10	815,453.10	
THOMSON REUTERS CORP	18,789	101.74	1,911,592.86	
AIR CANADA	11,591	18.15	210,376.65	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69,824	111.87	7,811,210.88	
CP RAILWAY LIMITED	13,160	313.95	4,131,582.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	50.81	1,421,562.18	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	22.59	398,916.81	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,485	64.52	1,644,292.20	
STARS GROUP INC/THE	20,487	35.38	724,830.06	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.87	469,224.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	23.11	1,041,960.57	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	98.62	533,435.58	
DOLLARAMA INC	26,700	44.05	1,176,135.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	84,121	40.38	3,396,805.98	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	32.25	491,909.25	
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	73.93	1,323,864.51	
METRO INC	24,937	59.72	1,489,237.64	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	105.10	723,403.30	
SAPUTO INC	24,489	34.80	852,217.20	
AURORA CANNABIS INC	53,000	0.97	51,410.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	24.45	679,710.00	
CANOPY GROWTH CORP	16,400	21.16	347,024.00	
CRONOS GROUP INC	15,900	8.44	134,196.00	
BANK MONTREAL	61,534	69.99	4,306,764.66	
BANK NOVA SCOTIA	116,919	54.45	6,366,239.55	
CANADIAN IMPERIAL BANK	42,951	80.90	3,474,735.90	
NATIONAL BANK OF CANADA	33,228	54.36	1,806,274.08	
ROYAL BANK OF CANADA	137,232	87.47	12,003,683.04	
TORONTO-DOMINION BANK	173,449	56.92	9,872,717.08	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	126,501	47.46	6,003,737.46	
CI FINANCIAL CORP	18,671	13.97	260,833.87	
IGM FINANCIAL INC	7,685	26.04	200,117.40	
ONEX CORP	6,603	60.00	396,180.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	422.16	1,124,212.08	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	23.06	548,551.28	
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	44.02	362,284.60	
INTACT FINANCIAL CORP	13,043	136.35	1,778,413.05	
MANULIFE FINANCIAL CORP	190,115	17.36	3,300,396.40	
POWER CORP OF CANADA	51,551	21.45	1,105,768.95	

	SUN LIFE FINANCIAL INC	56,979	46.25	2,635,278.75	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	5.98	235,612.00	
	CGI INC - CL A	23,396	84.79	1,983,746.84	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,978	1,369.95	2,709,761.10	
	OPEN TEXT CORP	24,643	54.96	1,354,379.28	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,812	831.52	8,158,874.24	
	BCE INC	15,355	58.48	897,960.40	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	60.28	2,110,885.04	
	TELUS CORP	32,908	22.77	749,315.16	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.81	1,026,514.58	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	14.89	363,241.55	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.35	206,233.35	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	35.42	365,676.08	
	EMERA INC	23,704	56.52	1,339,750.08	
	FORTIS INC	42,633	54.53	2,324,777.49	
	HYDRO ONE LTD	32,299	25.99	839,451.01	
カナダドル 小計		3,625,622		156,197,570.80 (12,002,221,340)	
ユーロ	ENI	248,488	8.58	2,133,766.45	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	9.62	473,541.44	
	NESTE OIL OYJ	40,117	29.27	1,174,224.59	
	OMV AG	14,984	26.92	403,369.28	
	REPSOL SA	133,012	7.78	1,035,631.43	
	TENARIS SA	40,648	5.80	235,758.40	
	TOTAL SA	229,526	31.02	7,119,896.52	
	VOPAK	6,360	50.50	321,180.00	
	AIR LIQUIDE	45,301	120.80	5,472,360.80	
	AKZO NOBEL	19,521	63.94	1,248,172.74	
	ARCELORMITTAL	66,229	8.88	588,113.52	
	ARKEMA	7,535	73.74	555,630.90	
	BASF SE	88,020	45.57	4,011,511.50	
	COVESTRO AG	15,098	31.07	469,094.86	
	CRH PLC	80,003	25.51	2,040,876.53	
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	21.87	432,019.98	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	37.24	214,576.88	
	HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	40.45	599,994.85	
	KONINKLIJKE DSM NV	17,129	112.10	1,920,160.90	
	LANXESS	7,293	42.63	310,900.59	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	26.06	509,863.90	
	SOLVAY SA	6,906	69.54	480,243.24	
	STORA ENSO OYJ R	54,792	10.12	554,495.04	
	SYMRISE AG	12,476	93.44	1,165,757.44	

THYSSEN KRUPP	33,044	5.89	194,629.16	
UMICORE	17,605	36.45	641,702.25	
UPM KYMMENE OYJ	50,623	24.61	1,245,832.03	
VOESTALPINE AG	12,422	19.59	243,346.98	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,018	20.85	459,075.30	
AIRBUS SE	56,107	56.80	3,186,877.60	
ALSTOM	18,760	39.89	748,336.40	
ANDRITZ AG	5,242	29.86	156,526.12	
BOUYGUES ORD	19,381	26.33	510,301.73	
BRENNTAG AG	15,254	38.20	582,702.80	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	5.59	520,015.34	
DASSAULT AVIATION SA	213	800.00	170,400.00	
EIFFAGE	7,209	73.76	531,735.84	
FERROVIAL SA	46,063	23.46	1,080,637.98	
GEA GROUP AG	13,382	21.27	284,635.14	
HOCHTIEF AG	2,222	70.40	156,428.80	
KINGSPAN GROUP PLC	15,306	44.54	681,729.24	
KION GROUP AG	5,887	44.47	261,794.89	
KNORR-BREMSE AG	4,123	82.11	338,539.53	
KONE OYJ-B	32,286	52.78	1,704,055.08	
LEGRAND SA	24,584	59.36	1,459,306.24	
LEONARDO SPA	35,425	6.66	236,001.35	
METSO OYJ	9,561	23.33	223,058.13	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	117.50	558,477.50	
PRYSMIAN SPA	21,155	15.40	325,787.00	
SAFRAN SA	31,568	80.50	2,541,224.00	
SAINT-GOBAIN	45,357	24.81	1,125,307.17	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,023	82.88	4,394,546.24	
SIEMENS	73,180	80.51	5,891,721.80	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	13.57	340,634.14	
THALES SA	9,665	72.20	697,813.00	
VINCI S.A.	49,409	76.46	3,777,812.14	
WARTSILA OYJ	34,386	7.06	242,765.16	
BUREAU VERITAS SA	25,073	18.82	471,999.22	
RANDSTAD NV	12,365	34.79	430,178.35	
TELEPERFORMANCE	5,732	197.45	1,131,783.40	
WOLTERS KLUWER	25,709	66.88	1,719,417.92	
ADP	2,382	88.40	210,568.80	
AENA SME SA	6,542	122.40	800,740.80	
ATLANTIA SPA	51,427	12.72	654,151.44	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.34	194,181.56	
DEUTSCHE POST AG-REG	91,789	26.19	2,403,953.91	

FRAPORT AG	3,561	39.50	140,659.50	
GETLINK	44,101	11.22	494,813.22	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,973	51.91	1,659,718.43	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	43.96	219,404.36	
CONTINENTAL AG	9,928	73.12	725,935.36	
DAIMLER AG	87,443	29.04	2,539,344.72	
FAURECIA	5,945	31.23	185,662.35	
FERRARI NV	11,268	148.60	1,674,424.80	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	111,379	7.32	815,517.03	
MICHELIN	16,459	88.66	1,459,254.94	
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	19.07	196,268.44	
PEUGEOT SA	52,883	11.70	618,731.10	
PIRELLI & C SPA	39,097	3.29	128,629.13	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	43.68	612,743.04	
RENAULT SA	17,362	16.38	284,389.56	
VALEO SA	19,350	15.89	307,471.50	
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,999	124.60	2,242,675.40	
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	134.50	437,259.50	
ADIDAS AG	17,294	218.70	3,782,197.80	
ESSILORLUXOTTICA	27,287	111.10	3,031,585.70	
HERMES INTERNATIONAL	3,057	684.80	2,093,433.60	
KERING	7,275	503.40	3,662,235.00	
LVMH	26,576	358.00	9,514,208.00	
MONCLER SPA	15,736	34.52	543,206.72	
PUMA SE	7,720	57.54	444,208.80	
SEB SA	2,075	117.80	244,435.00	
ACCOR	17,931	26.84	481,268.04	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	102.95	735,371.85	
SODEXO	8,135	65.34	531,540.90	
ALTICE NV -A	50,000	3.62	181,450.00	
BOLLORE	61,805	2.41	149,320.88	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	10.25	122,754.00	
JC DECAUX SA	9,522	17.17	163,492.74	
PUBLICIS GROUPE	21,469	26.37	566,137.53	
SES	31,369	6.52	204,776.83	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	34.78	173,830.44	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	70.00	651,770.00	
VIVENDI	77,307	20.63	1,594,843.41	
DELIVERY HERO SE	11,471	69.24	794,252.04	
INDITEX	101,980	25.55	2,605,589.00	
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	89.50	1,017,794.00	
PROSUS	45,890	65.44	3,003,041.60	

ZALANDO SE	13,985	43.70	611,144.50	
CARREFOUR	59,235	13.99	828,993.82	
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,810	35.55	206,545.50	
COLRUYT SA	5,424	54.50	295,608.00	
JERONIMO MARTINS	24,901	15.87	395,303.37	
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	22.31	2,303,819.84	
METRO AG	13,712	7.71	105,774.36	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,855	41.80	3,045,339.00	
DANONE (GROUPE)	59,282	63.62	3,771,520.84	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	64,414	6.95	447,677.30	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	70.95	759,235.95	
HEINEKEN NV	24,387	78.44	1,912,916.28	
KERRY GROUP PLC-A	14,641	105.60	1,546,089.60	
PERNOD-RICARD	19,918	139.95	2,787,524.10	
REMY COINTREAU	2,382	103.60	246,775.20	
BEIERSDORF AG	9,190	94.56	869,006.40	
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	69.65	709,733.50	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,238	78.20	1,348,011.60	
LOREAL	24,042	247.60	5,952,799.20	
UNILEVER NV	140,583	45.68	6,421,831.44	
BIOMERIEUX	4,175	107.40	448,395.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	92.90	318,647.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	64.84	1,295,827.40	
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,407	36.76	1,485,361.32	
KONINKLIJKE PHILIPS	87,231	37.45	3,266,800.95	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	230.00	746,580.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,846	37.11	551,009.29	
BAYER	94,130	58.57	5,513,194.10	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	476.00	551,208.00	
GALAPAGOS NV	4,368	193.55	845,426.40	
GRIFOLS SA	27,685	30.28	838,301.80	
IPSEN	2,722	55.50	151,071.00	
MERCK KGAA	12,078	100.55	1,214,442.90	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	41.77	411,601.58	
QIAGEN N.V.	21,801	37.23	811,651.23	
RECORDATI SPA	11,472	38.33	439,721.76	
SANOFI	107,940	86.57	9,344,365.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	191.40	574,965.60	
UCB (GROUPE)	12,416	85.20	1,057,843.20	
ABN AMRO BANK NV-CVA	53,189	7.09	377,429.14	
AIB GROUP PLC	70,200	0.92	64,935.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA	647,435	2.66	1,724,766.84	

BANCO DE SABADELL SA	449,651	0.39	175,768.57	
BANCO SANTANDER SA	1,599,817	1.95	3,134,681.42	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	1.41	119,028.00	
BANKIA SA	110,053	0.93	103,119.66	
BANKINTER SA	58,881	3.57	210,558.45	
BNP PARIBAS	110,192	25.47	2,806,590.24	
CAIXABANK	328,697	1.60	528,380.42	
COMMERZBANK AG	80,494	3.18	256,131.90	
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	6.53	701,733.39	
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	17.08	470,724.80	
FINECOBANK SPA	53,120	8.70	462,144.00	
ING GROEP NV-CVA	377,830	4.83	1,828,319.37	
INTESA SANPAOLO	1,460,677	1.37	2,010,183.68	
KBC GROEP NV	24,002	44.78	1,074,809.56	
MEDIOBANCA	53,990	5.00	270,057.98	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	14.31	178,731.90	
SOCIETE GENERALE	79,076	13.94	1,102,477.59	
UNICREDIT SPA	185,348	6.86	1,272,043.32	
AMUNDI SA	6,226	55.80	347,410.80	
DEUTSCHE BANK NAMEN	190,535	5.97	1,137,684.48	
DEUTSCHE BOERSE	18,261	139.60	2,549,235.60	
EURAZEO SA	3,357	42.26	141,866.82	
EXOR NV	10,345	49.18	508,767.10	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,222	71.54	588,201.88	
NATIXIS	69,996	2.01	140,761.95	
WENDEL	2,023	76.50	154,759.50	
AEGON	166,267	2.23	370,775.41	
AGEAS	16,065	31.56	507,011.40	
ALLIANZ SE-REG	39,899	163.90	6,539,446.10	
ASSICURAZIONI GENERALI	109,307	12.53	1,369,616.71	
AXA	185,927	14.92	2,774,774.54	
CNP ASSURANCES	11,830	8.05	95,231.50	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	134.20	776,883.80	
MAPFRE SA	90,939	1.72	156,869.77	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,866	195.45	2,710,109.70	
NN GROUP NV	27,631	23.45	647,946.95	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.70	354,469.50	
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	25.88	1,114,781.00	
SCOR SE	13,354	21.56	287,912.24	
AROUNDTOWN SA	111,346	4.90	546,597.51	
DEUTSCHE WOHNEN SE	33,768	35.50	1,198,764.00	
VONOVIA SE	49,525	45.42	2,249,425.50	

ADYEN NV	1,040	780.40	811,616.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	46.14	1,932,527.76	
ATOS SE	9,750	64.32	627,120.00	
CAPGEMINI SA	15,470	80.30	1,242,241.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	137.45	1,720,186.75	
EDENRED	22,756	36.79	837,193.24	
SAP SE	93,897	113.06	10,615,994.82	
WIRECARD AG	11,369	120.20	1,366,553.80	
WORLDLINE SA	12,702	60.34	766,438.68	
INGENICO GROUP	6,281	110.45	693,736.45	
NOKIA OYJ	545,632	3.18	1,739,474.81	
CELLNEX TELECOM SA	24,602	49.59	1,220,013.18	
DEUTSCHE TELEKOM	319,355	12.51	3,995,131.05	
ELISA A	15,574	54.26	845,045.24	
ILIAD SA	1,253	135.20	169,405.60	
KPN (KON.)	354,332	2.10	745,514.52	
ORANGE	188,105	11.36	2,137,813.32	
PROXIMUS	13,141	21.21	278,720.61	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.34	294,130.44	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.34	160,508.18	
TELEFONICA	438,199	4.10	1,800,559.69	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.52	168,890.77	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	30.16	286,912.08	
E.ON SE	216,142	8.83	1,908,533.86	
ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	7.25	444,685.38	
ENAGAS	25,299	19.55	494,721.94	
ENDESA	31,750	19.54	620,553.75	
ENEL	784,622	6.20	4,871,717.99	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.77	891,043.40	
ENGIE	171,054	9.49	1,623,644.56	
FORTUM OYJ	41,901	15.82	662,873.82	
IBERDROLA SA	590,508	8.98	5,305,123.87	
NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	15.31	462,132.35	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.23	603,595.36	
RWE STAMM	56,470	25.21	1,423,608.70	
SNAM SPA	203,694	3.82	779,333.24	
SUEZ	28,043	9.57	268,595.85	
TERNA SPA	130,230	5.49	715,744.08	
UNIPER SE	20,192	24.10	486,627.20	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	19.88	1,047,019.96	
VERBUND AG	7,463	38.84	289,862.92	
ASML HOLDING NV	40,714	271.55	11,055,886.70	

	INFINEON TECHNOLOGIES	122,254	16.55	2,023,303.70	
	STMICROELECTRONICS	66,237	21.37	1,415,484.69	
ユーロ 小計		18,373,367		310,461,323.95 (36,407,799,459)	
イギリスポンド	BP PLC	1,938,116	3.03	5,883,151.11	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	399,839	13.70	5,478,593.97	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	357,320	13.43	4,799,522.24	
	ANGLO AMERICAN PLC	96,044	14.22	1,366,129.85	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	7.82	280,609.05	
	BHP GROUP PLC	202,849	13.15	2,669,087.14	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,429	46.20	620,419.80	
	EVRAZ PLC	43,000	2.60	112,015.00	
	GLENCORE PLC	1,033,004	1.41	1,459,428.05	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	19.72	332,326.80	
	MONDI PLC	47,780	13.41	640,968.70	
	RIO TINTO PLC REG	107,837	38.16	4,115,599.10	
	ASHTEAD GROUP PLC	42,021	17.67	742,511.07	
	BAE SYSTEMS PLC	308,746	5.58	1,724,037.66	
	BUNZL PLC	33,283	16.70	555,992.51	
	DCC PLC	9,127	55.14	503,262.78	
	FERGUSON PLC	22,288	52.74	1,175,469.12	
	MEGGITT PLC	66,268	2.75	182,700.87	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	0.91	372,212.44	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	3.34	498,488.62	
	SMITHS GROUP PLC	37,146	11.85	440,365.83	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	88.22	640,036.10	
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	8.16	151,736.10	
	EXPERIAN PLC	87,481	23.78	2,080,298.18	
	G4S PLC	132,555	0.95	127,199.77	
	INTERTEK GROUP PLC	15,404	49.59	763,884.36	
	RELX PLC	185,932	18.39	3,419,289.48	
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	4.35	788,361.36	
	EASYJET PLC	11,633	6.38	74,311.60	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	4.85	468,549.93	
	BURBERRY GROUP PLC	40,410	14.71	594,633.15	
	PERSIMMON PLC	31,506	19.98	629,489.88	
	TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.36	368,957.64	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	40.27	426,821.73	
	CARNIVAL PLC	26,721	9.12	243,695.52	
	COMPASS GROUP PLC	151,733	13.32	2,021,083.56	
	GVC HOLDINGS PLC	59,240	6.83	404,727.68	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	35.63	571,540.83	

TUI AG-DI	37,945	3.31	125,673.84	
WHITBREAD PLC	11,623	27.00	313,821.00	
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	4.38	426,947.22	
INFORMA PLC	117,961	4.49	530,116.73	
ITV PLC	295,435	0.71	210,408.80	
PEARSON	66,305	4.88	323,568.40	
WPP PLC	113,065	5.58	631,128.83	
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	5.04	161,344.00	
KINGFISHER PLC	170,994	1.40	240,075.57	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	205,228	0.98	201,328.66	
NEXT PLC	13,238	44.35	587,105.30	
OCADO GROUP PLC	44,612	15.69	699,962.28	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.85	389,213.25	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.01	298,598.35	
TESCO	919,600	2.38	2,189,567.60	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	36,715	19.84	728,425.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	219,338	29.43	6,456,214.03	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.05	360,098.00	
DIAGEO	224,511	27.11	6,086,493.21	
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	15.64	1,430,203.32	
RECKITT BENCKISER PLC	67,934	62.48	4,244,516.32	
UNILEVER PLC	106,209	41.15	4,370,500.35	
NMC HEALTH PLC	9,509	9.38	89,232.45	
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	15.41	1,279,815.91	
ASTRAZENECA	125,500	79.70	10,002,350.00	
GLAXOSMITHKLINE	477,503	16.60	7,929,414.81	
BARCLAYS	1,669,454	0.90	1,514,361.72	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,941,394	4.14	8,044,166.03	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.30	2,020,999.38	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	479,086	1.06	508,789.33	
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	4.06	1,035,599.40	
3I GROUP PLC	88,121	7.69	678,355.45	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.32	506,935.67	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	30,265	74.82	2,264,427.30	
M&G PLC	229,107	1.30	298,984.63	
SCHRODERS PLC	11,794	25.57	301,572.58	
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	7.79	348,871.00	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.17	506,786.24	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	22.07	358,747.85	
AVIVA PIC	381,270	2.47	944,787.06	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.68	305,438.49	
LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.05	1,130,065.61	

	PRUDENTIAL	246,816	10.42	2,571,822.72	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	3.58	310,498.34	
	AVEVA GROUP PLC	6,717	33.51	225,086.67	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	3.67	106,901.07	
	SAGE GROUP PLC	111,321	6.31	703,326.07	
	HALMA PLC	37,159	21.19	787,399.21	
	BT GROUP PLC	817,227	1.20	985,575.76	
	VODAFONE GROUP PLC	2,514,733	1.08	2,738,041.29	
	CENTRICA PLC	440,558	0.31	140,141.49	
	NATIONAL GRID PLC	334,044	9.04	3,020,425.84	
	SEVERN TRENT PLC	25,000	23.12	578,000.00	
	SSE PLC	100,354	12.20	1,224,820.57	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.89	597,518.49	
イギリスポンド 小計		28,184,561		132,792,077.67 (17,893,732,466)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.85	310,554.30	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	621.50	505,279.50	
	GIVAUDAN-REG	864	3,214.00	2,776,896.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,534	37.00	1,758,758.00	
	SIKA AG-BR	12,290	160.55	1,973,159.50	
	ABB LTD	176,891	16.98	3,003,609.18	
	GEBERIT AG-REG	3,423	411.80	1,409,591.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	215.00	454,080.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	226.40	853,075.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	41.23	545,225.52	
	SGS SA	586	2,263.00	1,326,118.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	140.80	713,433.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	48,793	55.14	2,690,446.02	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	198.55	492,999.65	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	38.64	152,164.32	
	DUFRY AG-REG	3,825	27.15	103,848.75	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,896.00	530,880.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	84,000.00	840,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	8,050.00	837,200.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	283,950	106.04	30,110,058.00	
	ALCON INC	39,316	50.20	1,973,663.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	175.20	894,220.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	767.80	778,549.20	
	LONZA GROUP AG-REG	6,985	407.70	2,847,784.50	
	NOVARTIS	205,324	86.00	17,657,864.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	67,131	326.85	21,941,767.35	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	140.95	632,301.70	

	CREDIT SUISSE GROUP AG	241,636	7.92	1,915,206.93	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	35.09	743,100.93	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	66.00	224,202.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,811	736.20	1,333,258.20	
	UBS GROUP AG	370,150	9.27	3,431,290.50	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	138.90	667,414.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,265	328.40	1,072,226.00	
	SWISS RE LTD	28,362	77.22	2,190,113.64	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,328	303.20	4,344,249.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	91.40	681,661.20	
	TEMENOS AG - REG	6,511	118.90	774,157.90	
	SWISSCOM	2,441	517.60	1,263,461.60	
スイスフラン 小計		1,662,054		116,753,870.69 (13,015,721,504)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	207.70	3,577,009.40	
	BOLIDEN AB	23,903	202.40	4,837,967.20	
	ALFA LAVAL AB	25,639	177.40	4,548,358.60	
	ASSA ABLOY AB-B	101,748	191.85	19,520,353.80	
	ATLAS COPCO A	63,684	348.10	22,168,400.40	
	ATLAS COPCO B	36,538	304.10	11,111,205.80	
	EPIROC AB-A	53,833	95.46	5,138,898.18	
	EPIROC AB-B	29,972	93.60	2,805,379.20	
	SANDVIK AB	100,730	141.30	14,233,149.00	
	SKANSKA B	28,530	171.40	4,890,042.00	
	SKF AB-B	35,405	138.80	4,914,214.00	
	VOLVO B	153,020	124.40	19,035,688.00	
	SECURITAS B	22,844	112.00	2,558,528.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	128.25	2,330,302.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	55.90	2,164,000.80	
	HENNES & MAURITZ B	77,319	135.45	10,472,858.55	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	431.20	3,431,920.80	
	SWEDISH MATCH AB	16,014	602.80	9,653,239.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	305.10	17,416,633.50	
	NORDEA BANK ABP	309,938	55.34	17,151,968.92	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	67.52	10,513,539.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	79.70	11,985,764.20	
	SWEDBANK AB-A	86,716	107.58	9,328,907.28	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	198.45	3,332,372.40	
	INVESTOR AB-B SHS	43,938	485.90	21,349,474.20	
	KINNEVIK AB - B	23,604	195.95	4,625,203.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	424.60	3,091,088.00	
	ERICSSON (LM) B	298,755	86.60	25,872,183.00	

	HEXAGON AB-B SHS	26,504	459.90	12,189,189.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	8,677	287.50	2,494,637.50	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	135.10	6,756,621.20	
	TELIA CO AB	257,822	35.58	9,173,306.76	
スウェーデンクローナ 小計		2,344,461		302,672,404.99 (3,268,861,973)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	143.90	1,483,752.90	
	EQUINOR ASA	92,158	129.55	11,939,068.90	
	NORSK HYDRO	106,150	22.27	2,363,960.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	355.00	6,556,850.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	204.60	1,426,266.60	
	MOWI ASA	40,968	184.80	7,570,886.40	
	ORKLA	69,804	94.82	6,618,815.28	
	DNB ASA	96,834	113.05	10,947,083.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	182.00	3,380,468.00	
	TELENOR ASA	71,821	161.70	11,613,455.70	
ノルウェークローネ 小計		532,061		63,900,607.98 (665,205,329)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	592.00	6,125,424.00	
	NOVOZYMES A/S	21,895	326.60	7,150,907.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,605	588.60	10,362,303.00	
	ISS A/S	14,253	98.58	1,405,060.74	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	6,235.00	1,864,265.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	6,550.00	4,250,950.00	
	DSV PANALPINA A S	20,416	655.00	13,372,480.00	
	PANDORA A/S	8,431	228.90	1,929,855.90	
	CARLSBERG AS-B	10,388	836.40	8,688,523.20	
	COLOPLAST-B	11,223	1,055.00	11,840,265.00	
	DEMANT A/S	11,604	165.50	1,920,462.00	
	GENMAB A/S	6,320	1,550.50	9,799,160.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	222.60	1,084,284.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	169,280	431.05	72,968,144.00	
	DANSKE BANK A/S	59,378	73.52	4,365,470.56	
	TRYG A/S	9,828	182.00	1,788,696.00	
	ORSTED A/S	18,488	687.80	12,716,046.40	
デンマーククローネ 小計		395,275		171,632,297.40 (2,698,059,715)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	23.56	486,019.24	
	OIL SEARCH LTD	118,781	2.74	325,459.94	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.17	856,126.15	
	SANTOS	156,437	4.29	671,114.73	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	18.87	241,781.31	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	21.08	1,914,675.32	
WORLEY LTD	34,596	7.34	253,934.64	
ALUMINA LIMITED	170,458	1.57	268,471.35	
BHP GROUP LTD	281,528	31.28	8,806,195.84	
BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	10.39	512,517.92	
BORAL LIMITED	81,732	2.79	228,032.28	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	11.28	1,519,145.28	
INCITEC PIVOT LTD	150,599	2.18	328,305.82	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	19.24	831,706.72	
NEWCREST MINING LIMITED	74,098	28.57	2,116,979.86	
ORICA LTD	44,211	17.19	759,987.09	
RIO TINTO LTD	35,522	91.51	3,250,618.22	
SOUTH32 LTD	481,840	2.06	992,590.40	
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	23.80	219,436.00	
BRAMBLES LTD	160,308	11.58	1,856,366.64	
SEEK LTD	26,358	17.04	449,140.32	
AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.57	875,113.87	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	3.72	316,200.00	
TRANSURBAN GROUP	262,342	13.18	3,457,667.56	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	23.60	1,244,947.20	
CROWN RESORTS LTD	30,328	8.16	247,476.48	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	10.52	34,326.76	
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	2.98	497,201.08	
REA GROUP LTD	5,276	83.14	438,646.64	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	2.87	129,617.81	
WESFARMERS LTD	109,322	38.12	4,167,354.64	
COLES GROUP LTD	128,408	16.43	2,109,743.44	
WOOLWORTHS GROUP LTD	120,802	37.40	4,517,994.80	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.63	398,101.90	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	10.44	736,416.72	
COCHLEAR LIMITED	6,220	194.14	1,207,550.80	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	67.20	1,091,865.60	
SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	25.25	984,472.25	
CSL LIMITED	43,340	328.42	14,233,722.80	
AUST AND NZ BANKING GROUP	271,505	16.56	4,496,122.80	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	5.92	251,209.28	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	169,116	61.06	10,326,222.96	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	275,678	16.39	4,518,362.42	
WESTPAC BANKING	338,380	15.87	5,370,090.60	
AMP LTD	343,649	1.46	501,727.54	
ASX LTD	20,270	83.00	1,682,410.00	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	4.79	211,085.72	

	MACQUARIE GROUP LIMITED	32,981	100.41	3,311,622.21	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	48.41	528,249.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	6.32	1,323,123.60	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.65	715,129.00	
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	8.80	1,119,008.00	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	9.32	1,112,379.28	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	11.57	513,430.32	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	15.72	282,960.00	
	TELSTRA CORP	403,126	3.16	1,273,878.16	
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.81	245,819.75	
	AGL ENERGY LTD	64,235	17.66	1,134,390.10	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.83	343,411.07	
オーストラリアドル 小計		6,788,323		102,837,658.15 (7,042,322,830)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	4.00	306,576.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.11	519,044.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	19.81	1,324,377.74	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	30.00	1,635,600.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.30	446,699.10	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.35	865,354.20	
	MERCURY NZ LTD	85,000	4.40	374,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.37	483,077.28	
ニュージーランドドル 小計		713,761		5,954,728.82 (386,402,353)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	58.10	14,902,417.60	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	8.14	1,326,820.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	57.75	7,767,375.00	
	MTR CORP	151,000	43.15	6,515,650.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	13.00	890,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	211,000	49.95	10,539,450.00	
	SANDS CHINA LTD	242,800	31.85	7,733,180.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.90	1,042,800.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	13.72	1,931,776.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	104,500	21.50	2,246,750.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	26.60	1,702,400.00	
	WH GROUP LTD	936,500	7.55	7,070,575.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	16.76	1,829,521.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	24.20	8,724,100.00	
	HANG SENG BANK	74,200	137.00	10,165,400.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	115,000	247.00	28,405,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,155,200	72.60	83,867,520.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	257,996	47.80	12,332,208.80	

	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	16.48	2,851,040.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	32.25	4,038,603.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	22.00	1,419,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	621,500	9.02	5,605,930.00	
	SINO LAND CO	315,400	10.48	3,305,392.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	151,000	108.90	16,443,900.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	52.45	2,124,225.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.00	2,116,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140,000	31.30	4,382,000.00	
	WHEELOCK & CO LTD	82,000	55.05	4,514,100.00	
	PCCW LTD	357,000	4.70	1,677,900.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	47.75	3,223,125.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	81.50	12,795,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	981,504	14.38	14,114,027.52	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	51.30	7,053,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	84.10	1,993,170.00	
香港ドル 小計		8,210,684		296,651,506.52 (4,129,388,970)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	169,900	5.66	961,634.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	1.60	171,200.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	204,600	3.36	687,456.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	199,900	1.01	201,899.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	1.52	253,080.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	6.23	269,964.59	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	3.06	156,672.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.75	464,325.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	1.53	194,463.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	21.14	209,286.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.42	610,812.00	
	DBS GROUP	174,800	19.28	3,370,144.00	
	OCBC BANK	315,600	8.86	2,796,216.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	120,300	20.02	2,408,406.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.83	769,689.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	2.98	666,030.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.72	330,416.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.88	326,800.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.95	409,915.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.76	2,076,190.68	
シンガポールドル 小計		3,653,776		17,334,598.27 (1,314,309,240)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	11.54	781,904.24	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	440.10	944,454.60	

	BANK HAPOALIM BM	98,310	21.30	2,094,003.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	19.33	2,718,861.15	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	11.20	1,114,400.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	72.79	910,093.37	
	AZRIELI GROUP	4,323	183.50	793,270.50	
	NICE LTD	6,172	605.00	3,734,060.00	
イスラエルシェケル 小計		431,365		13,091,046.86 (393,385,958)	
合　計		103,600,698		350,210,568,293 (350,210,568,293)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,279,137.34	
		LENDLEASE GROUP	55,692	665,519.40	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	564,320.80	
	オーストラリアドル 小計		259,965	2,508,977.54 (171,814,781)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,755,180.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,507,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	6,262,680.00 (87,176,505)	
投資信託受益証券合計			855,465	258,991,286 (258,991,286)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	567,378.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,846	1,684,492.26	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	42,251	10,734,289.06	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	754,468.54	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,273,587.65	
		BOSTON PROPERTIES	14,788	1,412,254.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	771,762.16	
		CROWN CASTLE INTL CORP	39,669	6,626,706.45	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,743,577.20	
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,223,596.80	
		EQUINIX INC	8,137	5,654,808.15	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,050,157.60	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,475,939.83	
		ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,648,508.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,147,643.70	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	546,887.52	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,101	1,236,872.26	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	769,851.33	
	INVITATION HOMES INC	51,458	1,225,729.56	
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	688,374.54	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	315,830.44	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	859,118.12	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,238,852.50	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	514,790.95	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	680,398.54	
	PROLOGIS INC	70,356	6,347,518.32	
	PUBLIC STORAGE	15,009	2,948,968.32	
	REALTY INCOME CORP	30,146	1,578,746.02	
	REGENCY CENTERS CORP	14,271	551,716.86	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,751	3,384,737.33	
	SIMON PROPERTY GROUP	29,338	1,646,448.56	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	413,514.42	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,155,606.20	
	UDR INC	28,059	1,092,617.46	
	VENTAS INC	34,403	1,076,469.87	
	VEREIT INC	105,798	520,526.16	
	VICI PROPERTIES INC	44,224	711,564.16	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	647,149.50	
	WELLTOWER INC	38,031	1,867,322.10	
	WP CAREY INC	16,500	1,038,840.00	
アメリカドル 小計		1,244,559	74,827,622.14 (8,073,152,152)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	428,620.01	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	175,507.20	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	90,862.55	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	257,598.70	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	121,179.12	
カナダドル 小計		51,928	1,073,767.58 (82,508,300)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	293,998.50	
	GECINA SA	4,459	537,309.50	
	ICADE	2,845	210,672.25	
	KLEPIERRE	17,225	291,360.87	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	790,749.30	
ユーロ 小計		43,186	2,124,090.42 (249,092,083)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	309,317.53	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	374,954.20	

		SEGRO PLC	106,999	879,317.78	
	イギリスポンド 小計		244,963	1,563,589.51 (210,693,686)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	906,086.70	
		GOODMAN GROUP	162,271	2,226,358.12	
		GPT GROUP	167,884	688,324.40	
		MIRVAC GROUP	392,919	911,572.08	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,046,325.45	
		STOCKLAND	207,412	632,606.60	
		VICINITY CENTERS	291,115	404,649.85	
	オーストラリアドル 小計		1,802,354	6,815,923.20 (466,754,420)	
	香港ドル	LINK REIT	199,000	14,009,600.00	
	香港ドル 小計		199,000	14,009,600.00 (195,013,632)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	791,860.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	376,650.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	200,300	370,555.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	402,600.00	
		SUNTEC REIT	173,000	240,470.00	
	シンガポールドル 小計		1,110,300	2,182,135.00 (165,449,475)	
投資証券合計			4,696,290	9,442,663,748 (9,442,663,748)	
合計				9,701,655,034 (9,701,655,034)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　608銘柄	96.9%	—	—	69.7%
	投資証券　40銘柄	—	—	3.1%	2.2%
カナダドル	株式　83銘柄	99.3%	—	—	3.3%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.7%	0.0%
ユーロ	株式　236銘柄	99.3%	—	—	10.1%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.7%	0.1%

イギリスポンド	株式　93銘柄	98.8%	—	—	5.0%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式　39銘柄	100.0%	—	—	3.6%
スウェーデンクローナ	株式　32銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	0.7%
オーストラリアドル	株式　59銘柄	91.7%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.2%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　34銘柄	93.6%	—	—	1.1%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	2.0%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.4%	0.1%
シンガポールドル	株式　20銘柄	88.8%	—	—	0.4%
	投資証券　5銘柄	—	—	11.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	54,106,297
コール・ローン	4,302,475,787
国債証券	265,088,533,724
派生商品評価勘定	17,985,024
未収入金	3,822
未収利息	2,003,796,565
前払費用	82,371,058
差入委託証拠金	476,758,543
流動資産合計	272,026,030,820
資産合計	272,026,030,820

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,388,410
前受金	12,448,912
未払金	777,328
未払解約金	170,132,393
未払利息	6,116
流動負債合計	205,753,159
負債合計	205,753,159
純資産の部	
元本等	
元本	94,369,427,523
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	177,450,850,138
元本等合計	271,820,277,661
純資産合計	271,820,277,661
負債純資産合計	272,026,030,820

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。

	2020年 4月20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）

		2020年 4月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	94,369,427,523口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　2.8804円 (1万口当たり純資産額)　(28,804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

	2020年 4月20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。

	2020年 4月20日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 4月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	140,669,850,215円
期中追加設定元本額	9,293,278,412円
期中一部解約元本額	55,593,701,104円
期末元本額	94,369,427,523円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,634,414,616円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	625,424,130円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	448,133,431円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,017,120,522円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,906,861円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,601,512,502円
世界経済インデックスファンド	6,361,528,160円
ＤＣマイセレクション２５	1,743,012,422円
ＤＣマイセレクション５０	1,301,037,649円
ＤＣマイセレクション７５	799,600,345円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	1,962,892,298円
ＤＣマイセレクションＳ２５	727,772,450円
ＤＣマイセレクションＳ５０	542,903,113円
ＤＣマイセレクションＳ７５	234,598,906円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	43,385,976円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	63,853,100円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	29,672,423円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,355,517,660円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	609,476,708円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	30,914,927円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,454,903円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,876,546円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	50,215,703円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	82,235,073円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	118,357,246円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	126,924,698円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	234,445,541円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,860,523,488円

区分	2020年 4月20日現在
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	524,343,564円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,921,152,138円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	714,873,092円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	65,647,887円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	531,349,589円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	30,886,754円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	216,932,067円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	270,696,497円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	881,765,005円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	2,036,095,594円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	749,217,932円
外国債券ファンド・シリーズ１	595,895,322円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,585,957,544円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,634,375,008円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	298,729,790円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,736,593,237円
コア投資戦略ファンド（切替型）	563,477,235円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	195,025,883円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,720,480円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,052,269,917円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	174,974,454円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	19,836,499,894円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	86,797,149円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	97,845,469円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	165,150,873円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,540,817円
グローバル経済コア	826,636,245円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	8,324,704円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	146,691円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	218,715,325円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,162,672円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	78,038円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	139,275円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	59,045円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	31,738円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	620,033,456円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	10,454,051,591円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	343,985,635円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	367,942,520円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,036,586円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	15,121,057,068
合計	15,121,057,068

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2020年 4月20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	4,027,821,560	－	4,040,270,472	12,448,912
合計		4,027,821,560	－	4,040,270,472	12,448,912

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,093,358,858	－	4,076,506,560	△16,852,298
	アメリカドル	2,105,351,852	－	2,100,528,400	△4,823,452
	カナダドル	169,516,054	－	168,213,900	△1,302,154
	ユーロ	1,523,409,922	－	1,512,771,260	△10,638,662
	イギリスポンド	295,081,030	－	294,993,000	△88,030
合計		4,093,358,858	－	4,076,506,560	△16,852,298

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,913,121.10	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	5,060,937.50	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,837,679.68	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,695,031.25	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,160,546.90	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,622,832.05	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,805,123.01	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,175,195.30	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,591,699.22	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,149,531.24	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,141,015.65	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,602,744.13	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,077,875.00	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,147,031.24	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,295,703.10	
		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,927,296.89	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,930,312.50	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,642,953.12	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,643,417.96	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,840,177.71	
		T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,209,960.95	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,581,542.97	
		T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	15,975,367.18	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,164,648.45	
		T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,234,179.70	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,824,117.22	

		T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,581,419.89	
		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,417,235.98	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,863,501.97	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,571,533.20	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,834,075.15	
		T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,670,800.79	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,920,976.57	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,856,626.56	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,858,136.76	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,233,789.08	
		T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,047,984.35	
		T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,603,075.02	
		T 1.75% 07/31/21	6,700,000.00	6,835,046.87	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,342,320.31	
		T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,200,659.15	
		T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,207,402.37	
		T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,577,441.40	
		T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,676,816.42	
		T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,599,144.55	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,337,851.54	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,635,204.68	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,155,468.76	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,397,734.36	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,758,476.56	
		T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,545,757.82	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,455,007.83	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,923,203.16	
		T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,938,639.06	
		T 2.125% 05/15/25	9,400,000.00	10,214,789.08	
		T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,455,296.91	
		T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,675,927.72	
		T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,250,078.14	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,163,937.48	
		T 2.125% 08/15/21	5,370,000.00	5,507,711.12	
		T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,587,474.64	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,626,562.48	
		T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,052,528.13	
		T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,613,544.93	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,588,909.40	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,291,718.76	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,991,835.93	
		T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,161,171.88	

		T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,576,289.08	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,539,218.75	
		T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,079,628.91	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,603,386.76	
		T 2.25% 08/15/46	10,790,000.00	13,188,246.14	
		T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	12,650,390.67	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,836,730.45	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	11,021,076.14	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,838,625.00	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,617,007.81	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,822,558.60	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,138,281.29	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,295,507.80	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,215,850.02	
		T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,461,234.35	
		T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,134,062.50	
		T 2.375% 05/15/29	18,010,000.00	20,800,143.05	
		T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,590,332.00	
		T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,757,714.86	
		T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,817,535.17	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,506,250.00	
		T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,124,796.91	
		T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,592,086.74	
		T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,842,148.48	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,316,572.25	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,593,410.17	
		T 2.5% 05/15/46	10,050,000.00	12,838,089.89	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,884,496.11	
		T 2.625% 01/31/26	8,000,000.00	8,994,062.48	
		T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,720,299.26	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,494,554.68	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,045,517.56	
		T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,859,998.00	
		T 2.625% 06/15/21	10,000,000.00	10,284,179.70	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,266,734.37	
		T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,451,808.61	
		T 2.625% 12/31/23	6,500,000.00	7,054,531.25	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,533,859.37	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,277,617.18	
		T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,671,250.00	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,869,859.38	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,178,275.00	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,164,082.04	

		T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,484,453.14	
		T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,371,679.66	
		T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,912,187.50	
		T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,648,468.75	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,753,335.97	
		T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,430,078.08	
		T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,653,348.45	
		T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,479,031.25	
		T 2.75% 11/15/47	4,550,000.00	6,125,082.05	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,495,000.00	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,578,710.97	
		T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,865,996.11	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,754,484.37	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,298,992.20	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,164,041.39	
		T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,579,956.25	
		T 2.875% 08/15/45	9,300,000.00	12,597,140.62	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,171,748.03	
		T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,538,442.41	
		T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	5,999,082.04	
		T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,699,493.17	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,392,321.10	
		T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,581,542.97	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,246,679.70	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,115,650.00	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,910,546.90	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,646,874.59	
		T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,878,152.35	
		T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,545,312.48	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,881,347.67	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,121,406.25	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,464,346.12	
		T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,967,609.39	
		T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,804,933.62	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,445,312.50	
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,468,203.12	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,204,473.48	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,091,484.38	
		T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,266,730.46	
		T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,240,062.50	
		T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,840,117.20	
		T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,468,937.50	

		T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,772,773.46	
		T 3.125% 08/15/44	6,390,000.00	8,935,516.43	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,174,500.00	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,405,429.68	
		T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,534,567.18	
		T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	11,026,992.22	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,101,340.62	
		T 3.625% 02/15/44	6,700,000.00	10,044,765.62	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,982,812.50	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,987,968.76	
		T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	8,365,585.96	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,181,457.03	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	6,264,765.62	
		T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,940,546.91	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,193,075.00	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,828,359.37	
		T 3% 05/15/47	5,710,000.00	8,007,828.93	
		T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,704,937.50	
		T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,782,421.89	
		T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,701,757.80	
		T 3% 11/15/44	6,050,000.00	8,310,714.87	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,403,507.81	
		T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,707,675.79	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,565,078.13	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	3,026,343.75	
		T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,144,222.66	
		T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,999,856.25	
		T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,448,227.35	
		T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,542,000.00	
		T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,730,890.62	
		T 4.625% 02/15/40	3,580,000.00	5,856,096.87	
		T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,952,312.50	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,812,851.56	
		T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,750,000.00	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,808,320.31	
		T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,908,089.85	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,680,656.25	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,244,730.47	
		T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,053,222.66	
		T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,625,941.41	
		T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,977,873.05	
		T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,908,250.00	

アメリカドル 小計		1,105,800,000.00	1,245,602,217.89 (134,388,023,288)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,041,586.25	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,714,364.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,000,000.00	1,060,175.00	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,905,408.20	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,234,835.25	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,107,380.45	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,444,075.20	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	627,138.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,762,229.80	
	CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,738,583.00	
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	517,152.50	
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,523,272.50	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,460,022.50	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,964,628.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,518,850.40	
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,943,040.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,856,582.80	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,671,812.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	840,775.60	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,462,726.35	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,221,397.45	
	CAN 2% 12/01/51	1,070,000.00	1,267,366.85	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,840,000.00	1,898,990.40	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,178,114.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,850,000.00	2,805,081.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,706,386.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,575,112.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,580,000.00	2,546,501.80	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,813,507.75	
カナダドル 小計		55,750,000.00	64,407,095.55 (4,949,041,222)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,652,017.50	
	MBONO 10% 12/05/24	25,860,000.00	29,911,486.20	
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	24,908,899.95	
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	26,710,927.05	
	MBONO 6.5% 06/10/21	39,660,000.00	40,047,081.60	
	MBONO 6.75% 03/09/23	10,400,000.00	10,687,196.00	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	30,977,506.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	41,630,000.00	43,797,049.65	
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	17,679,324.10	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,252,289.25	

	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	16,270,038.20	
	MBONO 8.5% 05/31/29	27,050,000.00	29,980,461.75	
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	24,073,458.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	37,087,996.50	
	MBONO 8% 11/07/47	18,770,000.00	19,336,572.45	
	MBONO 8% 12/07/23	25,700,000.00	27,538,321.00	
メキシコペソ 小計		392,880,000.00	413,910,625.70 (1,858,458,709)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,060,000.00	1,059,671.40	
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,540,381.20	
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	664,870.20	
	BGB 0.5% 10/22/24	970,000.00	1,004,221.60	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,296,183.10	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,795,760.20	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,664,769.60	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,673,310.25	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	961,197.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	616,615.25	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,814,243.20	
	BGB 1.7% 06/22/50	630,000.00	791,585.55	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,592,819.20	
	BGB 1% 06/22/26	1,710,000.00	1,831,264.65	
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,630,015.30	
	BGB 2.15% 06/22/66	660,000.00	979,245.30	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,450,000.00	1,573,286.25	
	BGB 2.25% 06/22/57	680,000.00	991,137.40	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,738,570.60	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,240,062.50	
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,416,394.20	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,140,000.00	3,684,566.40	
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,510,117.25	
	BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,342,907.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,457,951.70	
	BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,326,512.10	
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,566,750.60	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,011,039.60	
	BGB 5% 03/28/35	2,270,000.00	3,807,414.25	
	BKO 0% 06/11/21	2,640,000.00	2,660,895.60	
	BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	1,980,833.40	
	BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	554,230.60	
	BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,564,068.50	
	BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,396,766.00	

		BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,142,234.85	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,180,031.80	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	1,999,120.00	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,579,471.10	
		BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,022,773.55	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,918,848.75	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	960,850.00	
		BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,925,288.00	
		BTPS 1.45% 03/01/36	550,000.00	502,359.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,308,222.50	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,062,894.00	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,418,600.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,424,447.95	
		BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,202,959.60	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,938,181.40	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,600,000.00	1,633,768.00	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,052,910.00	
		BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,165,972.40	
		BTPS 2.05% 08/01/27	1,740,000.00	1,791,651.90	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,310,688.00	
		BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,554,550.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	3,680,000.00	3,830,162.40	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,410,488.60	
		BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,759,994.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,618,000.00	
		BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	867,781.50	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,098,838.80	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,118,194.25	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,105,892.75	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,620,816.50	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,150,000.00	1,196,454.25	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,050,735.05	
		BTPS 2.95% 09/01/38	1,650,000.00	1,810,272.75	
		BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,694,533.50	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,154,591.45	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,587,623.90	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,229,396.00	
		BTPS 3.35% 03/01/35	1,210,000.00	1,396,188.75	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,511,383.80	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,546,258.20	
		BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,683,650.95	
		BTPS 3.75% 08/01/21	3,220,000.00	3,342,794.70	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,373,643.00	

		BTPS 3.85% 09/01/49	1,410,000.00	1,792,751.55	
		BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,317,255.50	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,095,207.50	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,433,277.60	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,952,427.40	
		BTPS 4.75% 08/01/23	2,390,000.00	2,675,700.60	
		BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,163,951.75	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,486,135.50	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,090,747.00	
		BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,229,114.70	
		BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	3,949,526.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,622,588.80	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,383,062.50	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,839,177.25	
		BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,348,359.40	
		BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,499,112.50	
		BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,153,280.00	
		BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	4,623,036.30	
		BTPS 5% 09/01/40	2,630,000.00	3,723,567.15	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,520,000.00	4,718,964.80	
		BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,518,856.50	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,895,075.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,018,740.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,392,829.80	
		DBR 0.25% 02/15/29	1,910,000.00	2,045,237.55	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,330,441.80	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,174,750.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,205,995.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,596,424.30	
		DBR 0.5% 08/15/27	3,160,000.00	3,420,605.20	
		DBR 0% 02/15/30	1,160,000.00	1,216,561.60	
		DBR 0% 08/15/26	1,870,000.00	1,947,464.75	
		DBR 0% 08/15/29	2,510,000.00	2,631,433.80	
		DBR 0% 08/15/50	860,000.00	877,144.10	
		DBR 1.25% 08/15/48	2,370,000.00	3,278,195.85	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,147,382.80	
		DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,329,024.80	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,497,668.65	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,947,952.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,807,154.25	
		DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,203,790.05	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,148,280.00	

		DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,494,096.00	
		DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,028,887.25	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,320,000.00	5,493,355.00	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,530,000.00	5,993,869.40	
		DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,454,885.50	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,120,689.00	
		DBR 3.25% 07/04/21	4,100,000.00	4,295,385.50	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,040,000.00	3,630,006.60	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,072,665.05	
		DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	3,404,863.40	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,681,639.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	4,534,777.00	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,030,000.00	4,119,123.75	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,140,000.00	3,540,523.00	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,656,125.80	
		DBR 6.25% 01/04/24	1,440,000.00	1,813,334.40	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,088,006.25	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,491,246.40	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,530,000.00	4,655,956.65	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,228,528.80	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,312,203.95	
		FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,191,220.00	
		FRTR 0.75% 05/25/28	3,640,000.00	3,886,555.40	
		FRTR 0.75% 05/25/52	550,000.00	551,421.75	
		FRTR 0.75% 11/25/28	4,570,000.00	4,890,494.10	
		FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,018,780.00	
		FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,360,938.90	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,042,998.50	
		FRTR 0% 03/25/25	3,690,000.00	3,746,623.05	
		FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,121,709.50	
		FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,092,241.50	
		FRTR 0% 11/25/29	3,250,000.00	3,246,571.25	
		FRTR 1.25% 05/25/34	3,710,000.00	4,208,920.80	
		FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,039,102.85	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,262,755.80	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,330,000.00	4,046,233.05	
		FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,905,310.05	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,580,000.00	2,156,881.70	
		FRTR 1.75% 06/25/39	2,560,000.00	3,165,721.60	
		FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,377,056.00	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,024,673.75	
		FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,864,942.60	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,548,191.50	

		FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,139,130.90	
		FRTR 2.5% 05/25/30	5,160,000.00	6,440,557.20	
		FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,724,271.00	
		FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,627,853.80	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,190,000.00	5,149,329.90	
		FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,973,434.25	
		FRTR 3.5% 04/25/26	4,550,000.00	5,570,906.25	
		FRTR 3.75% 04/25/21	5,670,000.00	5,912,874.45	
		FRTR 3% 04/25/22	3,520,000.00	3,769,638.40	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,855,980.60	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,580,000.00	8,218,558.10	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,091,080.80	
		FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	4,103,034.00	
		FRTR 4% 04/25/60	1,850,000.00	3,891,845.00	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,508,180.75	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,755,568.70	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,351,135.40	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,560,658.50	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,271,750.00	
		IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	472,065.60	
		IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	838,937.90	
		IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,139,881.70	
		IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,266.50	
		IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	999,432.80	
		IRISH 1.3% 05/15/33	630,000.00	703,442.25	
		IRISH 1.35% 03/18/31	390,000.00	435,277.05	
		IRISH 1.5% 05/15/50	490,000.00	578,763.50	
		IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	887,580.00	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,506,861.40	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,704,815.00	
		IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,418,836.65	
		IRISH 3.4% 03/18/24	930,000.00	1,061,422.95	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,133,740.15	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,917,284.75	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,494,116.00	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,676,232.00	
		NETHER 0.5% 01/15/40	760,000.00	835,259.00	
		NETHER 0.5% 07/15/26	1,860,000.00	1,968,093.90	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,283,663.55	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,762,041.60	
		NETHER 0% 01/15/22	980,000.00	989,858.80	
		NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,888,591.00	

		NETHER 1.75% 07/15/23	2,060,000.00	2,216,261.30	
		NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	702,273.00	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,650,000.00	2,210,191.50	
		NETHER 2.75% 01/15/47	1,900,000.00	3,260,552.00	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,206,979.65	
		NETHER 3.25% 07/15/21	2,740,000.00	2,870,013.00	
		NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,292,461.90	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,739,991.80	
		NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,555,328.90	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,380,000.00	2,010,694.50	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	244,782.00	
		OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,980,591.00	
		OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,686,397.75	
		OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,477,300.75	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,267,119.50	
		OBL 0% 10/07/22	1,390,000.00	1,414,165.15	
		OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,627,066.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,547,274.35	
		OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,423,343.50	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,227,733.65	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	931,932.35	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,727,146.80	
		RAGB 0.75% 10/20/26	1,110,000.00	1,180,401.75	
		RAGB 0% 02/20/30	470,000.00	470,784.90	
		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,522,080.00	
		RAGB 0% 07/15/24	920,000.00	934,646.40	
		RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,092.80	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,797,680.40	
		RAGB 1.5% 02/20/47	830,000.00	1,068,297.15	
		RAGB 1.5% 11/02/86	310,000.00	439,105.70	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,080,664.20	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,433,194.70	
		RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,407,626.40	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,350,046.75	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,384,161.95	
		RAGB 3.4% 11/22/22	1,680,000.00	1,850,704.80	
		RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,829,673.95	
		RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,257,347.20	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,051,277.20	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,770,000.00	2,934,394.50	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,709,360.05	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,727,478.70	
		RFGB 0.125% 04/15/36	340,000.00	336,963.80	

		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	647,391.60	
		RFGB 0.5% 09/15/27	520,000.00	544,861.20	
		RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	703,041.05	
		RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	682,178.25	
		RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	540,165.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	733,590.75	
		RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	394,245.15	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,510.40	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	426,793.50	
		RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	727,145.60	
		RFGB 1.375% 04/15/47	450,000.00	575,181.00	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	688,252.50	
		RFGB 1.625% 09/15/22	630,000.00	662,586.75	
		RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	865,131.75	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	518,952.00	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	800,977.90	
		RFGB 3.5% 04/15/21	1,040,000.00	1,081,360.80	
		RFGB 4% 07/04/25	640,000.00	786,236.80	
		SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,931,341.35	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,285,236.80	
		SPGB 0.35% 07/30/23	1,440,000.00	1,446,112.80	
		SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,407,279.70	
		SPGB 0.45% 10/31/22	2,210,000.00	2,230,243.60	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,150,000.00	2,086,188.00	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,738,897.70	
		SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,220,911.00	
		SPGB 0% 01/31/25	870,000.00	855,070.80	
		SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,619,515.75	
		SPGB 1.4% 04/30/28	4,430,000.00	4,683,285.25	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,491,763.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,038,935.90	
		SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,754,518.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,240,213.25	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,236,721.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	1,450,000.00	1,595,369.75	
		SPGB 1.95% 04/30/26	1,810,000.00	1,968,085.40	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,787,342.45	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,581,934.40	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,845,662.20	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,780,000.00	2,256,968.80	
		SPGB 2.75% 10/31/24	2,600,000.00	2,882,945.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	2,829,213.45	

		SPGB 3.45% 07/30/66	1,500,000.00	2,302,492.50	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,874,261.60	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	3,976,123.20	
		SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,001,494.40	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,469,372.40	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,271,599.20	
		SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,810,196.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,190,000.00	3,591,096.30	
		SPGB 5.15% 10/31/28	2,280,000.00	3,119,986.20	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,261,466.75	
		SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,319,470.50	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,390,000.00	3,580,619.70	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,730,000.00	4,263,113.40	
		SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,721,439.20	
		SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,634,733.60	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,520,583.75	
	ユーロ 小計		683,070,000.00	804,945,179.55 (94,395,921,205)	
	イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,573,329.10	
		UKT 0.625% 06/07/25	2,380,000.00	2,435,489.70	
		UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,970,367.95	
		UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,922,771.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,229,289.70	
		UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,170,060.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,585,565.80	
		UKT 1.625% 10/22/28	4,040,000.00	4,539,788.40	
		UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,446,742.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	1,530,000.00	2,347,830.90	
		UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,661,140.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,030,000.00	2,841,462.05	
		UKT 1.75% 09/07/22	2,470,000.00	2,567,219.20	
		UKT 1.75% 09/07/37	2,970,000.00	3,515,262.30	
		UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,208,779.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,680,587.50	
		UKT 2.5% 07/22/65	2,350,000.00	4,210,894.50	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,805,886.90	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,962,895.00	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,820,000.00	4,392,319.20	
		UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	4,959,231.30	
		UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,867,537.00	
		UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	3,999,758.40	
		UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,961,564.00	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,790,000.00	4,349,512.35	

	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,831,234.25	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,117,942.40	
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	876,768.70	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,839,739.05	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	4,066,582.90	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,703,029.75	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,220,000.00	4,842,930.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,748,447.15	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,432,575.60	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,950,000.00	2,857,042.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,285,195.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	4,297,872.00	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,093,490.75	
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,444,805.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,873,018.75	
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	805,882.20	
イギリスポンド 小計		91,020,000.00	127,321,839.25 (17,156,617,838)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,596,613.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,230,707.00	
	SGB 1.5% 11/13/23	11,870,000.00	12,651,995.60	
	SGB 1% 11/12/26	5,900,000.00	6,372,649.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	8,370,000.00	9,557,200.80	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,367,312.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,908,454.50	
スウェーデンクローナ 小計		57,740,000.00	65,684,931.90 (709,397,264)	
ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	3,610,000.00	3,832,935.55	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,193,086.05	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,120,000.00	4,446,180.40	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,517,255.45	
	NGB 1.75% 09/06/29	5,420,000.00	5,941,078.80	
	NGB 2% 04/26/28	2,920,000.00	3,231,885.20	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,835,329.70	
	NGB 3.75% 05/25/21	11,380,000.00	11,810,562.30	
	NGB 3% 03/14/24	5,050,000.00	5,559,014.75	
ノルウェークローネ 小計		53,860,000.00	57,367,328.20 (597,193,886)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,201,575.40	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,422,299.60	
	DGB 0.5% 11/15/29	7,310,000.00	7,830,289.25	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,380,000.00	7,905,271.50	

	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	10,033,881.95	
	DGB 3% 11/15/21	8,190,000.00	8,645,364.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,530,000.00	30,972,261.00	
デンマーククローネ 小計		62,210,000.00	80,010,942.70 (1,257,772,019)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	4,550,000.00	4,619,273.75	
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,864,629.30	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,168,845.75	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,158,010.30	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,011,619.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,750,000.00	5,141,685.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,475,152.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,960,000.00	4,361,266.80	
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,060,000.00	4,542,064.10	
	POLGB 2% 04/25/21	3,070,000.00	3,115,451.35	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,480,000.00	3,875,728.20	
	POLGB 4% 10/25/23	1,880,000.00	2,092,590.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	818,535.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,533,874.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,665,914.00	
ポーランドズロチ 小計		54,360,000.00	58,444,639.90 (1,511,962,834)	
オーストラリアドル	ACGB 1.25% 05/21/32	440,000.00	455,131.60	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,060,000.00	2,191,829.70	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,570,000.00	3,999,685.20	
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,071,760.35	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,400,057.35	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,603,809.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	956,900.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	730,000.00	884,015.40	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,841,937.55	
	ACGB 2.75% 11/21/28	2,960,000.00	3,449,761.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,110,000.00	3,666,705.55	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,987,485.05	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,967,060.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,980,475.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,693,936.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,193,309.90	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,149,072.80	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,515,350.50	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,725,655.95	
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,331,069.25	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,820,000.00	3,261,753.00	

	ACGB 5.75% 05/15/21	3,450,000.00	3,653,032.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,762,435.25	
オーストラリアドル 小計		60,470,000.00	70,742,229.50 (4,844,427,876)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	999,652.50	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	824,880.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	296,593.15	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	798,371.20	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,080,000.00	1,100,887.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	510,000.00	575,430.45	
	SIGB 2.375% 06/01/25	320,000.00	345,974.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	302,738.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	550,000.00	622,424.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	850,000.00	1,086,967.25	
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	764,070.75	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,141,369.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	976,138.80	
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	409,834.25	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	430,801.35	
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	678,323.20	
	SIGB 3.375% 09/01/33	840,000.00	1,057,623.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,033,252.00	
	SIGB 3% 09/01/24	840,000.00	924,088.20	
シンガポールドル 小計		12,870,000.00	14,369,419.50 (1,089,489,386)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,532,977.50	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	724,150.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	900,000.00	926,230.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,578,410.55	
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,263,343.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,031,045.15	
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	362,789.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,548,247.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,726,790.10	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,496,898.50	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	769,920.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,086,763.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	787,315.95	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,203,382.20	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,110,608.75	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,532,160.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,741,125.25	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,099,394.75	

		MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,010,599.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	467,207.90	
		MGS 4.16% 07/15/21	2,030,000.00	2,073,827.70	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,359,936.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,201,100.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	894,940.65	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,655,525.20	
		MGS 4.498% 04/15/30	1,410,000.00	1,582,999.95	
		MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,710,360.00	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,738,112.00	
		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,668,181.40	
		MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	960,360.00	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,276,201.50	
		MGS 4.935% 09/30/43	740,000.00	891,108.00	
		MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,727,922.20	
	マレーシアリンギット 小計		46,000,000.00	49,739,933.50 (1,227,084,159)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	31,790,000.00	34,101,768.80	
		SAGB 6.25% 03/31/36	18,840,000.00	12,048,180.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	6,650,000.00	4,142,883.50	
		SAGB 6.75% 03/31/21	5,350,000.00	5,468,796.75	
		SAGB 7.75% 02/28/23	16,800,000.00	17,483,088.00	
		SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	12,620,885.45	
		SAGB 8.25% 03/31/32	13,950,000.00	11,604,656.25	
		SAGB 8.5% 01/31/37	13,500,000.00	10,711,237.50	
		SAGB 8.75% 01/31/44	20,700,000.00	16,310,979.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	34,150,000.00	26,812,018.75	
		SAGB 8.875% 02/28/35	14,930,000.00	12,456,621.55	
		SAGB 8% 01/31/30	17,940,000.00	15,441,047.70	
		SAGB 9% 01/31/40	15,430,000.00	12,648,973.95	
	南アフリカランド 小計		226,360,000.00	191,851,137.20 (1,103,144,038)	
合計				265,088,533,724 (265,088,533,724)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　195銘柄	100.0%	50.7%
カナダドル	国債証券　29銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券　16銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　305銘柄	100.0%	35.6%
イギリスポンド	国債証券　41銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券　23銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券　19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　33銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券　13銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	474,622,483
コール・ローン	219,036,903
株式	58,464,910,526
投資信託受益証券	139,101,395
投資証券	70,614,107
派生商品評価勘定	49,533,917
未収入金	1,922,157
未収配当金	124,993,185
差入委託証拠金	502,467,212
流動資産合計	60,047,201,885
資産合計	60,047,201,885
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,696
前受金	49,490,221

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
未払金	2,058,067
未払解約金	177,372,136
未払利息	311
流動負債合計	228,978,431
負債合計	228,978,431
純資産の部	
元本等	
元本	24,693,413,516
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	35,124,809,938
元本等合計	59,818,223,454
純資産合計	59,818,223,454
負債純資産合計	60,047,201,885

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

	2020年 4月20日現在
	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 4月20日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		24,693,413,516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	2.4224円
	(1万口当たり純資産額)	(24,224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

	2020年 4月20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。

	2020年 4月20日現在
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運用監理部が、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

	2020年 4月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 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。

	2020年 4月20日現在

（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	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	21,633,015,345円
期中追加設定元本額	3,919,874,260円
期中一部解約元本額	859,476,089円
期末元本額	24,693,413,516円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	7,574,330,180円
世界経済インデックスファンド	3,633,445,841円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	4,366,881,283円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	4,750,433,404円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	159,282,802円
分散投資コア戦略ファンドＡ	350,413,663円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,250,606,036円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	502,116,585円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	601,766,853円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	336,177,565円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	20,474,508円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	114,124,252円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	83,769,540円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	262,484,487円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	54,821,315円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,997,211円

区分	2020年 4月20日現在
グローバル経済コア	447,952,752円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	18,515,240円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	162,462円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	221,447円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	93,096円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	47,832円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	90,273,776円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	73,021,386円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△6,884,930,694
投資信託受益証券	△43,862,941
投資証券	△55,597,279
合計	△6,984,390,914

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,067,415,649	－	1,116,905,870	49,490,221
合計		1,067,415,649	－	1,116,905,870	49,490,221

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	57,190,400	－	57,176,400	△14,000
	アメリカドル	57,190,400	－	57,176,400	△14,000
合計		57,190,400	－	57,176,400	△14,000

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	592,047	4.93	2,920,567.85	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.65	67,704.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	46,044	62.32	2,869,462.08	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,190	129.00	1,314,510.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	146,513	4.19	614,475.52	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.58	564,283.48	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	30,595	41.98	1,284,378.10	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	3.88	60,182.68	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.10	120,203.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	73,003	26.62	1,943,339.86	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	17.01	333,361.98	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	11.72	314,306.96	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	79.00	562,796.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	11.63	450,929.99	
	SOUTHERN COPPER CORP	11,367	30.26	343,965.42	
	51JOB INC-ADR	2,701	71.51	193,148.51	
	BEST INC - ADR	14,126	5.59	78,964.34	
	DP WORLD PLC	21,152	15.50	327,856.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	33,291	28.79	958,447.89	
	NIO INC - ADR	77,076	3.21	247,413.96	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	31.02	431,829.42	
	LUCKIN COFFEE INC - ADR	8,174	4.39	35,883.86	

	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,167	112.48	1,705,984.16	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	40,978	51.66	2,116,923.48	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	38,070	45.37	1,727,235.90	
	58.COM INC-ADR	9,450	51.30	484,785.00	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	79.68	523,577.28	
	BAIDU INC - SPON ADR	29,357	105.00	3,082,485.00	
	HUYA INC-ADR	8,211	16.55	135,892.05	
	IQIYI INC-ADR	11,977	19.28	230,916.56	
	JOYY INC	6,185	62.24	384,954.40	
	MOMO INC-SPON ADR	15,529	23.81	369,745.49	
	NETEASE INC-ADR	7,551	348.64	2,632,580.64	
	SINA CORP	5,725	34.46	197,283.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	10.89	98,804.97	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	36.69	192,585.81	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	185,886	209.50	38,943,117.00	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	30.93	108,502.44	
	JD.COM INC-ADR	78,907	46.15	3,641,558.05	
	PINDUODUO INC-ADR	20,442	44.46	908,851.32	
	TRIP.COM GROUP LTD	52,406	23.85	1,249,883.10	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	17.84	847,185.92	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47,223	9.47	447,437.92	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	7,243	19.15	138,703.45	
	ZAI LAB LTD-ADR	3,373	63.47	214,084.31	
	BANCO MACRO SA-ADR	4,035	16.39	66,133.65	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	173,806	3.90	677,843.40	
	CREDICORP LTD	7,332	144.02	1,055,954.64	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	14,502	7.33	106,299.66	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	289,100	10.33	2,986,403.00	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	0.92	349,117.16	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	24.57	49,655.97	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.78	42,729.12	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	6,140	59.00	362,260.00	
	GLOBANT SA	3,122	103.02	321,628.44	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.15	324,810.10	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	7.74	113,901.84	
アメリカドル 小計		3,074,826		82,877,825.63 (8,941,688,607)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,944,661	5.05	9,820,538.05	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	350,392	44.66	15,648,506.72	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	174.81	2,534,745.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	27.36	2,649,870.72	
	ALFA S.A.B.-A	359,900	10.13	3,645,787.00	

	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	48.49	1,818,375.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	240.13	5,596,229.65	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	137.58	4,275,986.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	152.48	2,589,110.40	
	ALSEA SAB DE CV	34,300	16.65	571,095.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	27.03	6,038,231.70	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	61.92	1,944,288.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	68.01	741,309.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	579,880	57.93	33,592,448.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	97.77	4,934,940.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	216,340	137.66	29,781,364.40	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	207.54	5,387,738.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	33.47	6,084,846.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	34.94	6,352,092.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	262,800	63.47	16,679,916.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	16.05	4,052,625.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,625,440	13.22	47,928,316.80	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	67.92	3,905,400.00	
メキシコペソ 小計		8,609,655		216,573,760.39 (972,416,184)	
ブラジルレアル	COSAN SA	18,400	53.50	984,400.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	423,000	16.70	7,064,100.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	422,640	16.13	6,817,183.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	14.05	1,062,180.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	21.00	310,800.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	7.59	478,170.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	12.30	1,291,500.00	
	SUZANO SA	62,679	35.84	2,246,415.36	
	VALE SA	340,278	44.00	14,972,232.00	
	EMBRAER SA	69,700	9.55	665,635.00	
	WEG SA	84,872	38.46	3,264,177.12	
	CCR SA	125,600	12.69	1,593,864.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	32.03	1,984,322.56	
	RUMO SA	114,200	20.24	2,311,408.00	
	COGNA EDUCACAO	181,284	5.04	913,671.36	
	B2W CIA DIGITAL	20,960	61.80	1,295,328.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	77,416	21.75	1,683,798.00	
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	37.50	3,109,012.50	
	MAGAZINE LUIZA SA	83,400	44.59	3,718,806.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	18.41	1,399,160.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	20.40	846,600.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	19,700	64.00	1,260,800.00	

	RAIA DROGASIL SA	24,500	103.91	2,545,795.00	
	AMBEV SA	517,700	11.60	6,005,320.00	
	BRF SA	52,500	19.05	1,000,125.00	
	JBS SA	106,400	21.31	2,267,384.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	62,900	33.34	2,097,086.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	52.40	1,053,240.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	46,200	55.60	2,568,720.00	
	HYPERA SA	35,300	31.36	1,107,008.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	146,698	18.87	2,768,191.26	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	483,948	20.36	9,853,181.28	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	29.58	2,611,914.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	529,381	23.22	12,292,226.82	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	505,867	9.14	4,623,624.38	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	222,703	39.53	8,803,449.59	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	25.92	1,788,480.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	69,100	11.92	823,672.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	46.73	341,129.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,963	9.59	824,385.17	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	20.95	951,130.00	
	CIELO SA	99,269	4.53	449,688.57	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	47.87	2,503,601.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	96,100	13.02	1,251,222.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	29.34	519,318.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	25.95	871,920.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	98,092	10.14	994,652.88	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	42.17	1,463,299.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	40.05	1,171,462.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	110,400	19.00	2,097,600.00	
ブラジルレアル 小計		6,255,559		134,922,388.55 (2,779,401,204)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	5,121.00	229,062,330.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,635.30	222,343,564.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	13,896	18,965.00	263,537,640.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	30,286	3,169.00	95,976,334.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	2,200.00	155,841,400.00	
	CENCOSUD SA	137,988	975.10	134,552,098.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,564	6,650.00	150,050,600.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,890.00	28,750,680.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	71.10	345,733,704.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,194	28,500.00	148,029,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	32.80	205,978,128.80	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	2.41	40,365,465.96	

	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	4,310.00	79,959,120.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	260.00	74,420,580.00	
	COLBUN SA	1,215,680	116.25	141,322,800.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,990,008	136.50	544,636,092.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	65.50	167,763,709.00	
チリペソ 小計		36,440,040		3,028,323,247.06 (382,477,226)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	1,950.00	953,509,050.00	
	GRUPO ARGOS SA	33,752	11,300.00	381,397,600.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	26,500.00	778,464,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	27,540.00	1,054,176,120.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	945.00	287,004,060.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	24,120.00	502,178,400.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,000.00	909,198,000.00	
コロンビアペソ 小計		965,424		4,865,927,230.00 (133,326,406)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,794	14.02	81,231.88	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	4,358	11.36	49,506.88	
	OPAP SA	17,668	6.83	120,672.44	
	JUMBO SA	14,899	13.88	206,798.12	
	ALPHA BANK AE	129,138	0.68	87,813.84	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	291,098	0.36	106,774.74	
	NATIONAL BANK OF GREECE	53,130	1.17	62,162.10	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	11.72	307,146.04	
ユーロ 小計		542,292		1,022,106.04 (119,862,375)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	15.21	406,107.00	
イギリスポンド 小計		26,700		406,107.00 (54,722,918)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	87.20	1,011,781.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	8.23	960,893.65	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	49,783	27.12	1,350,114.96	
	KOC HOLDING AS	89,884	15.02	1,350,057.68	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	28,973	20.10	582,357.30	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	10.52	654,249.32	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	57.90	376,407.90	
	ARCELIK AS	15,358	15.41	236,666.78	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	55.75	2,387,438.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	21,501	18.41	395,833.41	
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.79	1,599,898.59	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.39	2,013,532.88	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	4.95	856,409.40	

	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	7.78	889,860.84	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	13.29	1,901,679.39	
トルコリラ 小計		1,392,167		16,567,181.70 (258,945,049)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	535.00	3,992,705.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	52.40	3,602,395.20	
	CEZ AS	18,145	470.00	8,528,150.00	
チェココルナ 小計		94,356		16,123,250.20 (69,329,975)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,076.00	87,928,980.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	6,430.00	97,594,540.00	
	OTP BANK NYRT	24,834	8,475.00	210,468,150.00	
ハンガリーフォリント 小計		82,367		395,991,670.00 (131,429,635)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	11,057	64.82	716,714.74	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	61.24	1,880,864.12	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	259,894	3.73	971,483.77	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	72.44	951,282.08	
	CCC SA	3,138	46.30	145,289.40	
	LPP SA	124	5,700.00	706,800.00	
	AMREST HOLDINGS SE	7,816	25.50	199,308.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	339.50	2,276,008.00	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	24.90	585,199.80	
	DINO POLSKA SA	4,430	186.00	823,980.00	
	BANK MILLENNIUM SA	99,381	3.18	316,031.58	
	BANK PEKAO SA	22,583	54.54	1,231,676.82	
	M BANK SA	1,663	217.80	362,201.40	
	PKO BANK POLSKI SA	104,297	21.93	2,287,233.21	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	157.00	567,555.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	30.82	1,912,196.08	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.62	368,455.96	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	4.47	283,827.12	
ポーランドズロチ 小計		773,247		16,586,107.08 (429,082,590)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	2.14	209,720.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.00	1,152,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,901,400	3.87	11,228,418.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	392,500	14.24	5,589,200.00	
	CNOOC LTD-R	1,883,000	8.39	15,798,370.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.68	402,480.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,382,000	2.76	6,574,320.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.19	878,980.00	

ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	1.59	540,600.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	124,000	57.45	7,123,800.00	
BBMG CORPORATION - H	131,000	1.99	260,690.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	3.57	362,355.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	642,000	2.38	1,527,960.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	9.27	3,819,240.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	9.71	2,796,480.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	1.84	146,464.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	7.56	627,480.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	5.00	830,000.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	2.33	680,360.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.80	1,006,200.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	557,000	2.07	1,152,990.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	8.45	764,725.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.30	2,405,700.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	2.96	367,040.00	
BOC AVIATION LTD	32,500	49.65	1,613,625.00	
CHINA COMMUICATIONS CONST-H	519,000	5.23	2,714,370.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	5.76	1,128,960.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	35.70	5,694,150.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	79,000	10.34	816,860.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	8.60	1,646,900.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.42	2,095,080.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	6.04	1,026,800.00	
CITIC LTD	677,000	7.91	5,355,070.00	
CRRC CORP LTD-H	511,050	4.10	2,095,305.00	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	9.59	2,761,920.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	13.80	1,076,400.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	660,000	1.36	897,600.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.23	374,640.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	12.68	481,840.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.51	250,965.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	97,500	15.36	1,497,600.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	14.28	3,024,504.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	7.51	235,934.16	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	23.20	1,445,360.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	6.33	735,546.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	41,500	39.30	1,630,950.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	4.43	1,705,877.82	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	33.65	4,576,400.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	9.34	1,681,200.00	
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.28	1,129,920.00	

BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	5.47	590,760.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	308,000	2.95	908,600.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.06	1,499,855.82	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	3.50	616,000.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	474,000	2.12	1,004,880.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	232,344	3.98	924,729.12	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.78	1,369,680.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	64,000	8.13	520,320.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	14.60	1,867,661.20	
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	1.83	201,300.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	5.25	462,000.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	3.29	384,930.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.02	2,583,360.00	
BYD CO LTD-H	82,500	43.95	3,625,875.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.12	1,361,920.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	17.06	464,032.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	518,000	11.70	6,060,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	5.00	1,763,750.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	6.58	1,660,423.52	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	4.51	414,920.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	63.95	7,098,450.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	1.95	378,300.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	20.55	2,383,800.00	
LI NING CO LTD	194,000	24.25	4,704,500.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	76,900	93.85	7,217,065.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	13.30	598,500.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	27,000	10.50	283,500.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	37,000	32.00	1,184,000.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.95	1,377,500.00	
CHINA LITERATURE LTD	32,200	31.00	998,200.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	612,600	409.60	250,920,960.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.73	433,589.34	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	110,200	100.00	11,020,000.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	9.49	1,081,860.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	29.90	2,033,200.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	12.00	3,108,000.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	28.15	7,910,150.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	36.90	5,239,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.79	1,178,340.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	12.92	2,945,760.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	43.25	1,989,500.00	

UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.40	592,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.63	3,152,800.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	59.80	2,870,400.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	78,500	66.10	5,188,850.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	358,000	16.62	5,949,960.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	33,500	96.00	3,216,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	11.04	2,693,760.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.72	1,761,648.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	20.00	2,504,000.00	
3SBIO INC	119,000	8.71	1,036,490.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	9.52	952,000.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	498,000	16.40	8,167,200.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.81	757,575.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.41	566,060.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	12.86	1,054,520.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	64,000	29.20	1,868,800.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	94,000	33.35	3,134,900.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	3.84	312,960.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	27.20	1,509,600.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	742,000	11.54	8,562,680.00	
SSY GROUP LTD	114,000	6.09	694,260.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	19,100	105.10	2,007,410.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	82,500	116.50	9,611,250.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,152,000	3.11	9,802,720.00	
BANK OF CHINA LTD-H	8,635,200	2.98	25,732,896.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.82	5,294,649.50	
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.71	3,528,952.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,216,620	6.12	62,525,714.40	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	3.05	2,089,250.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	436,923	35.30	15,423,381.90	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	5.67	3,823,848.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.17	478,670.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,988,515	5.14	35,920,967.10	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	882,000	4.70	4,145,400.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.48	1,231,360.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	11.84	1,586,560.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	3.90	1,281,150.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	0.89	825,030.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	11.82	1,560,240.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	14.90	3,702,650.00	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.10	1,464,000.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.43	746,898.00	

GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	109,400	11.38	1,244,972.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	7.18	2,564,696.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	209,200	12.82	2,681,944.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	831,000	16.08	13,362,480.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	24.45	7,251,870.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	0.92	219,880.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	13.10	2,410,714.40	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	25.40	2,448,560.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.54	2,385,060.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.43	5,121,409.84	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	605,500	78.60	47,592,300.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	26.20	1,197,340.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	8.52	1,209,840.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	9.19	1,157,940.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	13.70	2,548,200.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	5.34	3,086,520.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	409,040	26.15	10,696,396.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	347,111	32.10	11,142,263.10	
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	25.55	4,558,120.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	5.92	1,633,920.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	865,154	9.78	8,461,206.12	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	204,000	7.13	1,454,520.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	10.08	1,362,816.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.01	469,560.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	11.34	1,729,350.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	150,000	12.80	1,920,000.00	
LONGFOR PROPERTIES	197,000	38.05	7,495,850.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.41	809,760.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	30.90	4,094,250.00	
SHUI ON LAND LTD	651,000	1.33	865,830.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	2.05	1,083,611.55	
SOHO CHINA LTD	291,500	3.63	1,058,145.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	34.35	8,621,850.00	
WHARF HOLDINGS	100,000	14.64	1,464,000.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.46	843,880.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	332,086	3.30	1,095,883.80	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	4.95	648,450.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	11.26	2,724,920.00	
KINGSOFT CORP LTD	92,000	26.45	2,433,400.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.76	1,087,040.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	39.20	2,802,800.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	16.40	1,394,000.00	

	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	3.88	915,680.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	19.68	1,318,560.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.38	509,220.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	9.48	200,028.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	4.38	3,206,160.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	75,500	113.00	8,531,500.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,109,600	10.40	11,539,840.00	
	ZTE CORP-H	82,908	23.85	1,977,355.80	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	654,500	60.30	39,466,350.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	2.54	3,444,240.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.73	7,899,180.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	618,000	5.00	3,090,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.15	1,615,425.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.05	1,860,500.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.91	2,563,220.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,600	23.25	4,640,700.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	431,000	3.90	1,680,900.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.51	1,005,660.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	40.20	3,457,200.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	9.24	1,620,696.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	138,000	1.09	150,420.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	84,700	80.25	6,797,175.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	15.86	5,075,200.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	2.38	437,920.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	2.69	995,300.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	4.52	1,627,200.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	3.58	164,680.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	16.16	727,200.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	310,500	15.04	4,669,920.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	376,453	4.71	1,773,093.63	
香港ドル 小計		97,139,093		1,007,035,451.12 (14,017,933,479)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.27	1,352,694.36	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.02	527,602.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	5.65	1,524,935.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	3.87	558,441.00	
	GAMUDA BHD	141,520	3.24	458,524.80	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.23	276,186.00	
	IJM CORP BHD	198,100	1.75	346,675.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	1.85	622,240.10	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.10	543,629.40	

	MISC BHD	125,040	7.91	989,066.40	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.92	274,400.00	
	GENTING BHD	307,200	3.95	1,213,440.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.23	824,431.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	13,200	28.20	372,240.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	21,300	31.52	671,376.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.63	134,820.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.00	718,560.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	55,646	21.14	1,176,356.44	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	138.80	957,720.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	16.74	881,863.20	
	QL RESOURCES BHD	83,200	8.15	678,080.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.86	1,200,643.56	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	7.68	1,218,048.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.22	1,196,946.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	168,300	6.80	1,144,440.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	265,600	3.10	823,360.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	517,519	3.63	1,878,593.97	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	13.74	842,152.08	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	46,033	13.40	616,842.20	
	MALAYAN BANKING BHD	404,004	7.70	3,110,830.80	
	PUBLIC BANK BERHAD	324,420	16.04	5,203,696.80	
	RHB BANK BHD	206,419	4.80	990,811.20	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.81	1,086,951.09	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.58	1,427,586.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.46	1,462,734.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	3.96	279,385.92	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	15.50	1,170,250.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	323,475	12.70	4,108,132.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.76	193,059.22	
マレーシアリンギット 小計		7,187,548		43,057,744.04 (1,062,234,545)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	364,800	5.60	2,042,880.00	
	IRPC PCL - NVDR	829,500	2.58	2,140,110.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	164,500	76.50	12,584,250.00	
	PTT PCL-NVDR	1,253,200	34.25	42,922,100.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	38.00	4,563,800.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	25.75	5,314,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	36.75	8,266,324.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	327.00	26,487,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	58.50	25,043,850.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.95	7,312,150.00	

	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	11.20	9,066,400.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	323,310	20.60	6,660,186.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	55,100	33.50	1,845,850.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	743,535	13.50	10,037,722.50	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	39.75	7,059,600.00	
	CP ALL PCL-NVDR	657,100	65.25	42,875,775.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	458,200	26.75	12,256,850.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	39.00	2,574,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	449,700	12.90	5,801,130.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,083,700	20.70	22,432,590.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	118.00	3,870,400.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	114.50	5,942,550.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	99.50	12,576,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	99.00	7,751,700.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	10.80	4,737,420.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127,400	69.25	8,822,450.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,147,300	0.90	2,832,570.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	45.25	4,063,450.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	51.25	3,910,375.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	49.50	11,201,850.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.25	6,322,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	195.00	23,341,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	48.50	11,819,450.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	40.25	2,656,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.30	3,172,649.70	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	41.00	2,189,400.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	36,000	239.00	8,604,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	36.25	6,724,375.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	63.25	4,313,650.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	262,000	34.25	8,973,500.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	59.25	3,217,275.00	
タイバーツ 小計		16,630,638		404,331,232.70 (1,342,379,692)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	44.05	10,481,257.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	597.00	16,883,160.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	490.00	3,360,420.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	289,060	53.80	15,551,428.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	860.00	19,612,300.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	80.50	11,632,250.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	145.00	8,846,450.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	126.80	12,117,008.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	60.90	3,644,560.50	

	BDO UNIBANK INC	219,911	105.00	23,090,655.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	41.65	6,717,603.55	
	SECURITY BANK CORP	30,810	104.50	3,219,645.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	2.70	6,360,390.00	
	AYALA LAND INC	742,900	31.55	23,438,495.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	2.80	1,786,400.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	15.26	1,419,180.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,156,150	31.95	36,938,992.50	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,230.00	10,458,700.00	
	PLDT INC	10,460	1,138.00	11,903,480.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	26.80	2,398,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	269.00	7,830,590.00	
フィリピンペソ 小計		6,477,376		237,691,564.55 (503,906,116)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,035.00	1,489,675,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	1,980.00	885,654,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	17,325.00	3,480,592,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	990.00	2,853,675,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	5,200.00	1,269,840,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	10,975.00	2,085,250,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	5,275.00	457,342,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	6,475.00	2,237,760,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	2,920.00	360,620,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	3,800.00	8,180,260,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,340.00	1,213,638,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	792,300	4,240.00	3,359,352,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	46,000.00	2,741,600,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	1,635.00	1,500,766,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	10,200.00	1,642,200,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,250.00	2,681,875,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	6,875.00	5,131,500,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,195.00	3,293,300,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,051,000	27,125.00	28,508,375,000.00	
	BANK MANDIRI	2,133,796	4,380.00	9,346,026,480.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	4,160.00	3,370,432,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	669,100	960.00	642,336,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	6,046,500	2,830.00	17,111,595,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	795.00	543,303,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	424.00	682,809,600.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	5,349,700	3,230.00	17,279,531,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	387,000	2,400.00	928,800,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	835.00	660,902,500.00	

インドネシアルピア 小計		34,413,196		123,939,012,080.00 (867,573,084)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	38,800.00	255,808,400.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	67,200.00	298,838,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	97,700.00	545,752,200.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	14,400.00	154,166,400.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	19,750.00	143,029,500.00	
	KCC CORP	732	144,000.00	105,408,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	404,000.00	316,332,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,512	66,200.00	166,294,400.00	
	LG CHEM LTD	4,819	362,500.00	1,746,887,500.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,129	173,000.00	195,317,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	194,000.00	374,420,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	39,550.00	44,572,850.00	
	POSCO	8,609	176,000.00	1,515,184,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	52,100.00	177,087,900.00	
	CJ CORP	1,230	72,200.00	88,806,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,217	78,700.00	253,177,900.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	33,865	3,355.00	113,617,075.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	22,450.00	96,714,600.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	23,700.00	160,212,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	18,350.00	51,838,750.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	3,301	18,850.00	62,223,850.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	33,150.00	306,272,850.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,348	233,500.00	314,758,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10,619	22,600.00	239,989,400.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	82,000.00	357,028,000.00	
	LG CORP	9,902	62,100.00	614,914,200.00	
	LOTTE CORP	2,370	27,450.00	65,056,500.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	13,250.00	79,341,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	8,727	95,900.00	836,919,300.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	11,450.00	212,008,200.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	4,335.00	161,049,585.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,449	188,500.00	650,136,500.00	
	S-1 CORPORATION	2,394	83,700.00	200,377,800.00	
	CJ LOGISTICS	862	147,500.00	127,145,000.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,307	104,500.00	241,081,500.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	20,900.00	115,033,600.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	3,260.00	96,939,360.00	
	HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	21,400.00	151,212,400.00	
	HANON SYSTEMS	19,000	9,120.00	173,280,000.00	
	HYUNDAI MOBIS	6,916	179,500.00	1,241,422,000.00	

HYUNDAI MOTOR CO	15,682	100,500.00	1,576,041,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,286	63,300.00	271,303,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	60,100.00	180,480,300.00	
KIA MOTORS CORPORATION	29,688	29,900.00	887,671,200.00	
COWAY CO LTD	5,058	61,700.00	312,078,600.00	
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	33,300.00	135,864,000.00	
HLB INC	3,060	105,200.00	321,912,000.00	
LG ELECTRONICS INC	11,019	54,500.00	600,535,500.00	
KANGWON LAND INC	13,208	24,950.00	329,539,600.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	16,950.00	85,936,500.00	
KAKAO CORP	5,728	172,000.00	985,216,000.00	
NAVER CORP	14,853	179,000.00	2,658,687,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,650	649,000.00	1,070,850,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	96,400.00	237,626,000.00	
PEARL ABYSS CORP	921	206,800.00	190,462,800.00	
CJ ENM CO LTD	830	112,500.00	93,375,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	77,700.00	237,062,700.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	65,900.00	80,529,800.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	86,600.00	89,544,400.00	
SHINSEGAE CO LTD	881	252,500.00	222,452,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	151,000.00	82,899,000.00	
EMART	2,723	115,500.00	314,506,500.00	
GS RETAIL CO LTD	4,060	31,850.00	129,311,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	237,000.00	183,675,000.00	
KT&G CORP	11,869	78,000.00	925,782,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,968	117,500.00	348,740,000.00	
OTTOGI CORPORATION	68	536,000.00	36,448,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,873	180,500.00	518,576,500.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	2,100	64,100.00	134,610,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,024	1,249,000.00	1,278,976,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	278	675,000.00	187,650,000.00	
PACIFIC CORP	3,393	62,500.00	212,062,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,381	80,600.00	514,308,600.00	
CELLTRION INC	10,296	211,000.00	2,172,456,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	490	262,000.00	128,380,000.00	
HELIXMITH CO LTD	1,641	85,200.00	139,813,200.00	
MEDY-TOX INC	335	191,000.00	63,985,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,803	566,000.00	1,020,498,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,802	46,700.00	177,553,400.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,153	4,800.00	231,134,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	32,598	24,750.00	806,800,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	7,880.00	223,240,400.00	

	KB FINANCIAL GROUP INC	44,011	32,350.00	1,423,755,850.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	48,174	28,500.00	1,372,959,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	8,220.00	488,317,320.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	49,100.00	225,958,200.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,015.00	144,430,560.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	48,121	5,440.00	261,778,240.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	22,174	9,110.00	202,005,140.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	29,000.00	55,071,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	28,850.00	166,637,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	37,700.00	158,679,300.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	44,037	1,815.00	79,927,155.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	24,550.00	223,429,550.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	191,500.00	595,182,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	48,550.00	360,095,350.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	164,000.00	610,900,000.00	
	KMW CO LTD	1,901	64,800.00	123,184,800.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	11,500.00	276,816,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	132,500.00	187,487,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	114,000.00	638,742,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	510,272	51,400.00	26,227,980,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	87,965	44,050.00	3,874,858,250.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,042	286,500.00	1,731,033,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	12,150.00	268,818,750.00	
	SK TELECOM	2,172	199,000.00	432,228,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	30,309	20,600.00	624,365,400.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	26,900.00	122,072,200.00	
	SK HYNIX INC	58,170	84,100.00	4,892,097,000.00	
韓国ウォン 小計		1,702,113		79,217,039,085.00 (7,026,551,366)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	137,240	82.60	11,336,024.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	43.50	10,186,656.00	
	CHINA STEEL	1,266,261	19.75	25,008,654.75	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	396,061	71.10	28,159,937.10	
	FORMOSA PLASTICS CORP	489,824	83.20	40,753,356.80	
	NAN YA PLASTICS CORP	548,752	60.10	32,979,995.20	
	TAIWAN CEMENT	540,479	42.00	22,700,118.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	497.00	5,964,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	24.85	8,648,495.80	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,237	245.00	5,203,065.00	
	CHINA AIRLINES LTD	437,203	7.17	3,134,745.51	
	EVA AIRWAYS CORP	164,159	10.30	1,690,837.70	
	EVERGREEN MARINE	359,039	10.25	3,680,149.75	

TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	32.25	5,708,250.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	33.10	5,860,719.10	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	280.00	5,582,360.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	36,207	146.00	5,286,222.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	121,000	31.90	3,859,900.00	
GIANT MANUFACTURING	25,464	141.50	3,603,156.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	210.50	3,368,000.00	
POU CHEN	273,780	28.55	7,816,419.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	62,108	66.40	4,123,971.20	
TATUNG CO LTD	210,000	22.65	4,756,500.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	501.00	15,030,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	287.00	17,089,128.00	
STANDARD FOODS CORP	35,756	65.60	2,345,593.60	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	526,395	67.80	35,689,581.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	559,468	20.30	11,357,200.40	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,026,237	19.60	39,714,245.20	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,071,573	26.30	28,182,369.90	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,004,094	21.00	21,085,974.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	912,945	18.65	17,026,424.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,173,339	29.05	34,085,497.95	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	11.90	13,766,979.10	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,201,768	12.25	14,721,658.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	476,620	10.50	5,004,510.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,055,621	19.90	21,006,857.90	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	42.70	14,127,764.70	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	132,022	99.50	13,136,189.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,125,153	16.85	18,958,828.05	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	823,123	38.20	31,443,298.60	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	8.60	10,808,308.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	307,791	19.85	6,109,651.35	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	710,082	40.60	28,829,329.20	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,166,470	8.44	9,845,006.80	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	103,120	41.30	4,258,856.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	98,440	41.80	4,114,792.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	206.00	9,888,000.00	
ACER INC	255,803	15.75	4,028,897.25	
ADVANTECH CO LTD	39,402	279.00	10,993,158.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	76,092	198.00	15,066,216.00	
AU OPTRONICS CORP	945,090	7.37	6,965,313.30	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	217.00	15,124,900.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	81.80	5,054,585.60	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	6.25	4,843,750.00	

	COMPAL ELECTRONICS	431,760	18.70	8,073,912.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	209,903	134.50	28,231,953.50	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	54.50	5,060,325.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,333,248	75.80	101,060,198.40	
	INVENTEC CO LTD	280,511	23.60	6,620,059.60	
	LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	3,850.00	42,504,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	42.95	9,683,163.40	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	93.00	5,580,000.00	
	PEGATRON CORP	200,474	65.10	13,050,857.40	
	QUANTA COMPUTER INC	286,270	62.80	17,977,756.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	38.45	4,925,445.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	193.50	5,224,500.00	
	WISTRON CORP	355,695	26.05	9,265,854.75	
	WIWYNN CORP	8,000	663.00	5,304,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	37.75	5,424,373.00	
	YAGEO CORPORATION	22,764	339.50	7,728,378.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	102.50	6,142,005.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	400,315	108.50	43,434,177.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	65.90	10,346,300.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	178,200	106.00	18,889,200.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	349,315	66.80	23,334,242.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	379.50	9,108,000.00	
	MEDIATEK INC	160,804	368.00	59,175,872.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	154,000	61.10	9,409,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	69,045	185.00	12,773,325.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	270.50	3,137,529.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	99,770	97.00	9,677,690.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	230.50	11,742,592.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,632,389	306.50	806,827,228.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	15.05	18,210,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	68.20	6,069,800.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	274.00	8,768,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	13.30	4,641,700.00	
新台湾ドル 小計		35,532,048		2,076,516,733.61 (7,454,695,073)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	360.10	23,809,812.00	
	COAL INDIA LTD	147,331	148.75	21,915,486.25	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	217.70	12,936,822.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	86.00	16,663,790.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	76.30	19,281,696.70	
	PETRONET LNG LTD	83,779	211.60	17,727,636.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	306,633	1,224.00	375,318,792.00	

AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	172.95	12,717,532.35	
ASIAN PAINTS LTD	28,520	1,756.25	50,088,250.00	
BERGER PAINTS INDIA LTD	16,698	515.75	8,611,993.50	
GRASIM INDUSTRIES LTD	41,773	545.55	22,789,260.15	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	124.15	15,066,471.55	
JSW STEEL LTD	80,284	177.30	14,234,353.20	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,471.00	18,046,228.00	
SHREE CEMENT LTD	901	18,946.75	17,071,021.75	
TATA STEEL LTD	39,709	293.35	11,648,635.15	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,743	3,534.05	37,966,299.15	
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	363.30	19,692,313.20	
VEDANTA LTD	198,772	84.10	16,716,725.20	
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	48.90	7,022,186.70	
HAVELLS INDIA LTD	23,476	528.60	12,409,413.60	
LARSEN & TOUBRO LTD	49,730	932.90	46,393,117.00	
SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,197.65	7,097,273.90	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	268.15	16,766,346.90	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	376.90	9,970,889.50	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,068.30	8,930,988.00	
BAJAJ AUTO LTD	8,362	2,379.15	19,894,452.30	
BHARAT FORGE LTD	30,322	283.80	8,605,383.60	
BOSCH LTD	965	10,739.95	10,364,051.75	
EICHER MOTORS LTD	1,254	14,770.35	18,522,018.90	
HERO MOTOCORP LTD	10,359	1,835.90	19,018,088.10	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	363.20	27,482,980.80	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,151	5,505.00	66,891,255.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	86.80	6,669,451.60	
TATA MOTORS LTD	190,082	76.85	14,607,801.70	
PAGE INDUSTRIES LTD	601	17,133.45	10,297,203.45	
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	975.50	32,084,195.00	
INFO EDGE INDIA LTD	6,428	2,486.55	15,983,543.40	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	140.15	11,138,140.95	
AVENUE SUPERMARTS LTD	14,325	2,212.10	31,688,332.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	2,832.15	14,466,622.20	
ITC LTD	388,437	188.10	73,064,999.70	
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	17,324.30	41,491,698.50	
UNITED SPIRITS LTD	32,483	530.05	17,217,614.15	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	5,255	1,378.30	7,242,966.50	
DABUR INDIA LTD	58,111	490.10	28,480,201.10	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	552.75	21,260,976.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	87,189	2,385.00	207,945,765.00	
MARICO LTD	42,465	300.15	12,745,869.75	

	AUROBINDO PHARMA LTD	37,851	542.70	20,541,737.70	
	CIPLA LTD	47,915	598.00	28,653,170.00	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	2,332.20	21,125,067.60	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	3,929.55	49,685,230.20	
	LUPIN LTD	26,552	822.25	21,832,382.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	892.65	10,463,643.30	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	457.10	37,916,445.00	
	AXIS BANK LTD	228,324	478.80	109,321,531.20	
	BANDHAN BANK LTD	36,073	216.30	7,802,589.90	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	177,443	1,680.60	298,210,705.80	
	ICICI BANK LTD	515,616	375.55	193,639,588.80	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	277.75	7,768,945.25	
	STATE BANK OF INDIA	187,504	193.25	36,235,148.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	18,080	2,308.15	41,731,352.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,676.95	10,962,110.25	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	179.80	5,021,634.20	
	REC LTD	48,168	95.50	4,600,044.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	19,022	802.05	15,256,595.10	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	4,999.70	19,438,833.60	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	49,372	495.50	24,463,826.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	17,954	1,199.40	21,534,027.60	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	369.95	11,739,253.40	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	32,481	702.45	22,816,278.45	
	DLF LTD	56,420	136.90	7,723,898.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	122,073	455.25	55,573,733.25	
	INFOSYS LTD	365,523	628.75	229,822,586.25	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	96,664	1,806.20	174,594,516.80	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	509.85	24,500,841.75	
	WIPRO LTD	118,712	187.00	22,199,144.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	263,301	502.45	132,295,587.45	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	168.30	6,025,813.20	
	GAIL INDIA LTD	174,768	89.70	15,676,689.60	
	NTPC LTD	260,019	95.50	24,831,814.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	167.75	33,778,978.75	
	TATA POWER CO LTD	93,250	34.40	3,207,800.00	
インドルピー 小計		6,798,523		3,309,048,489.50 (4,698,848,855)	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	96.32	7,031,360.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	105.45	7,012,425.00	
	MCB BANK LTD	53,300	154.00	8,208,200.00	
パキスタンルピー 小計		192,800		22,251,985.00 (14,463,790)	

カタールリアル	QATAR FUEL QSC	57,358	16.85	966,482.30	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.84	819,485.55	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	6.85	1,348,981.74	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.01	819,223.84	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	3.74	1,523,711.92	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	8.04	792,710.03	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	15.15	1,730,584.50	
	QATAR NATIONAL BANK	487,496	17.70	8,628,679.20	
	QATAR INSURANCE CO	189,640	2.16	409,622.40	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.76	573,294.87	
	OOREDOO QSC	72,800	6.11	445,463.20	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	14.80	923,830.80	
カタールリアル 小計		2,541,237		18,982,070.35 (560,540,537)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,900	114.10	3,982,090.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	7,385	908.38	6,708,386.30	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,716	412.31	18,436,853.96	
	GOLD FIELDS LTD	89,344	120.28	10,746,296.32	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	77,953	108.00	8,418,924.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	343.45	1,845,013.40	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	86.35	2,931,582.50	
	SASOL LTD	57,207	57.60	3,295,123.20	
	SIBANYE STILLWATER LTD	218,901	33.21	7,269,702.21	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	143.79	3,983,270.58	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	90.61	3,672,332.69	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	131.00	3,734,810.00	
	NASPERS LTD-N SHS	47,573	2,775.54	132,040,764.42	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	83,044	11.39	945,871.16	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	77.77	1,868,968.64	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	30.21	3,338,053.95	
	BID CORP LTD	33,071	232.17	7,678,094.07	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	269.30	7,249,825.30	
	PICK N PAY STORES LTD	45,989	60.41	2,778,195.49	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	58,453	118.98	6,954,737.94	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	184.96	4,304,759.04	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	178.58	2,325,647.34	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	18.29	2,863,171.47	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	111.50	4,152,706.00	
	ABSA GROUP LTD	92,885	83.30	7,737,320.50	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,385	909.75	3,989,253.75	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	94.50	3,594,496.50	
	STANDARD BANK GROUP LTD	142,629	103.33	14,737,854.57	

	FIRSTRAND LTD	377,344	37.67	14,214,548.48	
	INVESTEC LTD	28,883	36.93	1,066,649.19	
	PSG GROUP LTD	18,494	140.84	2,604,694.96	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	287.81	4,946,590.47	
	REMGRO LTD	55,441	130.78	7,250,573.98	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	50.00	3,719,900.00	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	84.30	2,950,162.80	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	18,158	67.65	1,228,388.70	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	16.78	1,142,348.84	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	12.43	6,085,877.16	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	23.83	2,413,216.44	
	SANLAM LTD	221,098	54.78	12,111,748.44	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	32,121	90.99	2,922,689.79	
	MTN GROUP LTD	173,000	52.75	9,125,750.00	
	TELKOM SA LTD	11,353	21.05	238,980.65	
	VODACOM GROUP	73,306	120.65	8,844,368.90	
南アフリカランド 小計		3,398,804		362,450,594.10 (2,084,090,916)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	4.36	1,174,976.40	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	3.47	446,200.36	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	11.58	3,280,173.96	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	509,421	1.51	769,225.71	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.13	202,996.59	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	2.52	970,300.80	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	200,413	14.72	2,950,079.36	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		1,955,857		9,793,953.18 (288,138,102)	
香港・オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	6.42	583,578.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	7.55	289,165.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	5.89	517,142.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	8.62	527,544.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	2.91	478,113.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	58.21	1,713,702.40	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	4.93	190,791.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	22,500	37.57	845,325.00	
	BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	98,100	4.66	457,146.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	9.08	484,872.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	13.85	513,835.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.14	525,540.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.20	253,580.00	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	61,700	7.86	484,962.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.20	484,220.00	

SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	69,000	7.50	517,500.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	5,180	36.33	188,189.40	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	23,600	22.62	533,832.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	38,900	19.62	763,218.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	31,500	19.59	617,085.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	43,200	12.11	523,152.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.93	546,746.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	34,900	44.12	1,539,788.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	12.00	283,200.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.65	294,100.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	22.78	259,692.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	17.32	294,440.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	25,000	25.70	642,500.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	6.78	654,948.00	
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	75,820	7.54	571,682.80	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	63,200	9.88	624,416.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	494,300	4.24	2,095,832.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.27	1,111,443.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	136.95	1,835,130.00	
CRRC CORP LTD-A	79,000	6.35	501,650.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	12,900	63.17	814,893.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	40.31	548,216.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	12,200	67.68	825,696.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	21.06	1,023,516.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	3.76	613,632.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	19.60	821,240.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	29.70	605,880.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	8.17	184,642.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	13.45	581,040.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	9.97	200,506.67	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	24.95	788,420.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	36,300	19.07	692,241.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	12.73	563,939.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	9.97	803,582.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	37,300	16.39	611,347.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	51.34	564,740.00	
AIR CHINA LTD-A	25,900	6.82	176,638.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.26	170,400.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	2.01	752,946.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.85	837,755.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	2.39	151,287.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	14.19	439,890.00	

S F HOLDING CO LTD-A	13,700	48.66	666,642.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	67.72	360,202.68	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.32	191,808.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	35.16	291,828.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	16,800	31.22	524,496.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	104,734	5.47	572,894.98	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	19.23	717,279.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	52,300	10.14	530,322.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	20.90	716,870.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	20.36	596,548.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	19.00	809,400.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	54.70	1,011,950.00	
NAVINFO CO LTD-A	33,200	14.92	495,344.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	5,500	105.78	581,790.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	14.82	385,320.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	30,100	19.21	578,221.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	6.35	503,555.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	18,600	27.10	504,060.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.96	533,856.00	
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	12.29	208,930.00	
CITIC GUOAN INFORMATION-A	174,400	3.44	599,936.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	4.33	603,602.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	1,800	392.50	706,500.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	42.94	699,922.00	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	52,800	13.87	732,336.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	9.13	751,946.80	
PERFECT WORLD CO LTD-A	15,200	50.20	763,040.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	36.34	890,330.00	
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	22,800	21.72	495,216.00	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	81.30	1,203,240.00	
HLA CORP LTD-A	21,400	6.41	137,174.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	17.81	302,770.00	
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	8.85	405,330.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	10.34	418,770.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	18,700	36.11	675,257.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	4,800	127.30	611,040.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	15,900	41.09	653,331.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	60.31	621,193.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	21,100	33.21	700,731.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	11,800	125.95	1,486,210.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	22.52	617,048.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	41.18	700,060.00	

HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	32,400	39.90	1,292,760.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	29.95	1,027,344.90	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	28.72	496,856.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	89.76	816,816.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	45.00	517,500.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,226.00	9,317,600.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	78.33	767,634.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	14,100	123.97	1,747,977.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	32.67	875,556.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	97.45	652,915.00	
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	50,891	12.22	621,888.02	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	12.82	405,112.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	63,900	30.79	1,967,481.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	128.82	2,730,984.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	37,500	15.87	595,125.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,780	43.09	593,780.20	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	126.01	630,050.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	10,938	67.33	736,455.54	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	18.61	180,889.20	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	6,500	113.60	738,400.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	57,300	17.59	1,007,907.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	38.99	577,052.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	11.44	284,169.60	
OVCTEK CHINA INC-A	9,300	61.09	568,137.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	259.24	1,373,972.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	4,700	115.80	544,260.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	29,100	25.35	737,685.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,800	182.30	692,740.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	19,500	34.79	678,405.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	7,400	87.89	650,386.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	1,100	555.10	610,610.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	39.31	601,443.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	29.02	296,004.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	77.66	768,834.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	27.06	600,542.58	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.58	505,280.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	76.94	615,520.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	14,500	48.77	707,165.00	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	26,926	22.47	605,027.22	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	26,460	96.60	2,556,036.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	12,600	54.30	684,180.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	127.86	869,448.00	

SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	18.68	130,760.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	21.80	244,857.60	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	11.93	232,635.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	36.55	621,350.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	6,300	98.79	622,377.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	85.18	604,778.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	134.84	525,876.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	36,900	27.52	1,015,488.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	28.18	681,956.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.44	1,216,384.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.78	277,240.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	5.19	513,291.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	5.92	342,176.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	7.46	376,730.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	23.22	557,280.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.29	377,195.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.35	793,115.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.61	465,329.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	32.86	3,447,014.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.79	1,584,144.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.48	773,712.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.15	1,345,180.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	16.06	1,528,912.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	12.89	1,539,066.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.20	1,410,660.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	2.50	79,750.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	3.94	482,650.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	6.44	1,188,180.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	56,200	17.89	1,005,418.00	
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	23.38	1,010,016.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	34.94	842,054.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	85,500	17.64	1,508,220.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	11.23	1,143,214.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	7.06	584,568.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	13.89	841,734.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	117.91	636,714.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	7.48	324,632.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	6.12	537,948.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	9.44	299,248.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.41	913,752.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	29.30	533,260.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	59,100	72.40	4,278,840.00	

CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	21.40	299,600.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	16.78	917,866.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	26.72	1,434,864.00	
GEMDALE CORP-A	45,500	13.76	626,080.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	5.50	646,800.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	15.82	1,294,076.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	31.64	404,992.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	52,200	12.51	653,022.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	19.65	528,585.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	29.60	399,600.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	25.07	722,016.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	71.88	481,596.00	
GLODON CO LTD-A	15,400	45.85	706,090.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	7,000	95.21	666,470.00	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	34.63	374,004.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	174.80	524,400.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	15,500	46.43	719,665.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	29,900	45.09	1,348,191.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	34.38	460,692.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.89	445,794.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	19.87	556,360.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	11.65	405,420.00	
DAWNING INFORMATION INDUST-A	17,600	46.02	809,952.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	32.45	674,960.00	
GOERTEK INC -A	26,900	19.14	514,866.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	9.00	450,000.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	58,500	30.24	1,769,040.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	37.30	735,257.60	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	38,500	16.88	649,880.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	45,732	42.09	1,924,859.88	
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	14.88	465,744.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	28.96	703,728.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	3,400	230.19	782,646.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	38.30	513,220.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	23.68	674,880.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	13.52	635,440.00	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	37,800	17.38	656,964.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	98.91	415,422.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,500	87.64	657,300.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	16.82	509,646.00	
ZTE CORP-A	12,600	40.00	504,000.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	600,000	5.29	3,174,000.00	

	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.45	773,410.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	17.12	2,294,080.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.64	1,085,812.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	7.69	519,844.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.37	805,500.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	2.84	234,300.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	3,200	269.00	860,800.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	28.92	471,396.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	21.52	873,712.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	266.40	692,640.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	11,700	59.47	695,799.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,900	175.80	509,820.00	
香港・オフショア人民元 小計		12,833,990		183,417,538.07 (2,795,283,280)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	14.20	334,537.80	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	129,846	30.15	3,914,856.90	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	43.80	429,415.20	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	9.60	306,508.80	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	13.90	448,733.70	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	19,671	64.40	1,266,812.40	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	35.30	1,587,935.20	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	83,163	76.20	6,337,020.60	
	SAUDI CEMENT	7,489	50.90	381,190.10	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	17.00	358,003.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	8.00	528,912.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	43.05	1,143,235.80	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	71.00	314,672.00	
	JARIR MARKETING CO	7,199	137.80	992,022.20	
	ALMARAI CO	30,130	48.05	1,447,746.50	
	SAVOLA	25,336	41.00	1,038,776.00	
	AL RAJHI BANK	135,049	53.30	7,198,111.70	
	ALINMA BANK	109,956	15.10	1,660,335.60	
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	18.48	1,065,150.24	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	11.30	404,686.90	
	BANK ALBILAD	32,374	20.58	666,256.92	
	BANQUE SAUDI FRANSI	57,797	27.30	1,577,858.10	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	133,085	35.10	4,671,283.50	
	RIYAD BANK	120,952	15.40	1,862,660.80	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	20.74	2,108,905.42	
	SAUDI BRITISH BANK	71,793	21.30	1,529,190.90	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,609	102.00	164,118.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	64.30	425,215.90	

	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	8.14	383,328.88	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	7.01	323,770.87	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	24.84	854,843.76	
	SAUDI TELECOM CO	43,949	91.30	4,012,543.70	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	16.62	1,532,713.02	
サウジアラビアリアル 小計		1,691,778		51,271,352.41 (1,475,589,522)	
合　計		286,751,634		58,464,910,526 (58,464,910,526)	

(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	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	5,815,472.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	5,815,472.00 (26,111,469)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,028,954.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	58,600	1,552,900.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	707,685.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,023,910.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	26,962	1,171,498.90	
	ブラジルレアル 小計		192,062	5,484,947.90 (112,989,926)	
投資信託受益証券合計			250,462	139,101,395 (139,101,395)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	5,930,532.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	5,930,532.00 (26,628,088)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	189,245	2,089,264.80	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	4,124,757.06	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	1,435,720.70	
	南アフリカランド 小計		1,032,277	7,649,742.56 (43,986,019)	
投資証券合計			1,340,677	70,614,107 (70,614,107)	
合計				209,715,502 (209,715,502)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　57銘柄	100.0%	—	—	15.2%
メキシコペソ	株式　23銘柄	94.9%	—	—	1.7%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.5%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	2.6%	0.0%
ブラジルレアル	株式　50銘柄	96.1%	—	—	4.7%
	投資信託受益証券　5銘柄	—	3.9%	—	0.2%
チリペソ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	0.7%
コロンビアペソ	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ユーロ	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.2%
イギリスポンド	株式　1銘柄	100.0%	—	—	0.1%
トルコリラ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.4%
チェココルナ	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.7%
香港ドル	株式　207銘柄	100.0%	—	—	23.9%
マレーシアリンギット	株式　39銘柄	100.0%	—	—	1.8%
タイバーツ	株式　41銘柄	100.0%	—	—	2.3%
フィリピンペソ	株式　21銘柄	100.0%	—	—	0.9%
インドネシアルピア	株式　28銘柄	100.0%	—	—	1.5%
韓国ウォン	株式　109銘柄	100.0%	—	—	12.0%
新台湾ドル	株式　88銘柄	100.0%	—	—	12.7%
インドルピー	株式　84銘柄	100.0%	—	—	8.0%
パキスタンルピー	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.0%
カタールリアル	株式　12銘柄	100.0%	—	—	1.0%
南アフリカランド	株式　44銘柄	97.9%	—	—	3.6%
	投資証券　3銘柄	—	—	2.1%	0.1%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.5%
香港・オフショア人民元	株式　237銘柄	100.0%	—	—	4.8%
サウジアラビアリアル	株式　33銘柄	100.0%	—	—	2.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,087,165,957
コール・ローン	695,304,768
国債証券	49,748,605,305
未収利息	815,725,323
前払費用	78,494,098
流動資産合計	52,425,295,451
資産合計	52,425,295,451
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,643,146
未払利息	988
流動負債合計	20,644,134
負債合計	20,644,134
純資産の部	
元本等	
元本	34,170,474,683
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,234,176,634
元本等合計	52,404,651,317
純資産合計	52,404,651,317
負債純資産合計	52,425,295,451

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

	2020年 4月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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	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）

		2020年 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		34,170,474,683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	1.5336円
	(1万口当たり純資産額)	(15,336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

	2020年 4月20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為替予約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、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。

	2020年 4月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 4月20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	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	30,677,256,766円
期中追加設定元本額	5,148,907,762円
期中一部解約元本額	1,655,689,845円
期末元本額	34,170,474,683円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国債券インデックス・オープン	4,162,232,543円
世界経済インデックスファンド	5,789,549,629円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	4,446,049,230円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,508,398,184円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,821,311,662円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	97,969,760円
分散投資コア戦略ファンドＡ	240,523,876円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,167,243,911円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	268,370,771円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,572,573,264円
コア投資戦略ファンド（切替型）	86,647,214円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	185,869,215円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	91,440,097円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	163,321,977円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,286,355,123円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	117,605,010円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	134,521,174円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	220,239,731円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,976,564円
グローバル経済コア	721,233,748円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	28,048,658円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,567,889円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	122,886円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	157,211円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	63,646円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	29,735円
ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	91,056,304円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	142,193,733円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	275,740,363円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△650,036,106
合計	△650,036,106

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	38,372,180.00	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	95,136,107.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	51,600,000.00	50,148,234.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	82,688,802.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	79,150,000.00	79,922,504.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	19,950,000.00	20,500,919.25	
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	84,577,420.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000.00	96,946,868.25	
		MBONO 7.75% 05/29/31	56,200,000.00	59,212,039.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	61,658,362.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	25,062,960.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	81,800,000.00	90,661,803.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	52,430,256.50	
		MBONO 8% 09/05/24	39,800,000.00	42,822,810.00	
		MBONO 8% 11/07/47	50,050,000.00	51,560,759.25	
		MBONO 8% 12/07/23	112,900,000.00	120,975,737.00	
	メキシコペソ 小計		994,100,000.00	1,052,677,762.25 (4,726,523,152)	

ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	26,849,567.71	
	BLTN 0% 01/01/24	11,800,000.00	9,685,753.88	
	BLTN 0% 07/01/21	24,650,000.00	23,743,227.56	
	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00	25,203,886.08	
	BLTN 0% 07/01/23	48,550,000.00	41,423,262.96	
	BNTNF 10% 01/01/23	35,100,000.00	39,673,997.77	
	BNTNF 10% 01/01/25	27,300,000.00	31,569,019.12	
	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000.00	28,045,817.06	
	BNTNF 10% 01/01/29	12,700,000.00	15,099,948.55	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,457,750.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	496,125.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,954,625.00	
ブラジルレアル 小計		243,900,000.00	245,202,980.69 (5,051,181,402)	
チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,855,000,000.00	2,069,986,367.68	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,700,000,000.00	1,946,859,794.80	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,405,000,000.00	1,519,747,119.94	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,170,000,000.00	2,584,297,886.45	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,770,000,000.00	2,429,268,020.16	
チリペソ 小計		8,900,000,000.00	10,550,159,189.03 (1,332,485,105)	
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	7,650,000,000.00	7,256,063,250.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	81,900,000,000.00	92,862,315,000.00	
コロンビアペソ 小計		89,550,000,000.00	100,118,378,250.00 (2,743,243,564)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,650,000.00	4,615,287.75	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	6,630,892.25	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,650,000.00	4,221,571.75	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,105,132.75	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	7,880,985.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,200,000.00	9,555,993.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	8,871,337.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,150,000.00	8,554,081.25	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	7,000,000.00	9,034,235.00	
ペルーヌエボソル 小計		58,650,000.00	67,469,516.25 (2,135,410,189)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	12,158,640.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	16,487,878.50	
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	28,646,518.50 (71,329,831)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	19,369,086.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	23,385,375.00	

ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	42,754,461.00 (85,081,377)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,572,380.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	7,337,622.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	8,532,420.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	10,153,160.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	8,063,100.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	5,600,000.00	5,370,204.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,687,397.50	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	4,891,380.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,429,210.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,298,768.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	5,911,100.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	11,100,000.00	8,866,069.50	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	9,500,000.00	9,180,182.50	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,839,920.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,197,880.00	
トルコリラ 小計		112,650,000.00	102,330,793.50 (1,599,430,302)	
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	46,074,096.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	31,500,000.00	31,120,897.50	
	CZGB 0.95% 05/15/30	48,400,000.00	46,985,510.00	
	CZGB 1% 06/26/26	47,900,000.00	47,440,160.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	55,246,625.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	55,000,000.00	60,676,000.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	55,048,775.50	
	CZGB 2% 10/13/33	50,400,000.00	54,006,120.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	39,704,987.50	
	CZGB 4.7% 09/12/22	43,400,000.00	47,588,534.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	45,095,609.00	
チェココルナ 小計		501,100,000.00	528,987,314.50 (2,274,645,452)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	560,500,050.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	573,369,660.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	265,000,000.00	269,923,700.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	462,500,000.00	495,034,562.50	
	HGB 3% 06/26/24	512,500,000.00	544,615,812.50	
	HGB 3% 08/21/30	439,000,000.00	464,933,925.00	
	HGB 3% 10/27/27	678,000,000.00	731,019,600.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	688,000,000.00	826,910,640.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	616,400,730.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	451,302,540.00	
	HGB 7% 06/24/22	462,000,000.00	519,103,200.00	

ハンガリーフォリント 小計		5,473,000,000.00	6,053,114,420.00 (2,009,028,675)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	12,650,000.00	12,842,596.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,393,960.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	5,600,000.00	5,940,340.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,912,014.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000.00	15,950,454.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000.00	17,806,467.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000.00	17,755,854.75	
	POLGB 2.75% 04/25/28	12,950,000.00	14,262,223.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	10,350,000.00	11,578,907.25	
	POLGB 2% 04/25/21	10,050,000.00	10,198,790.25	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,756,723.75	
	POLGB 4% 10/25/23	20,050,000.00	22,317,254.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,172,235.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	5,350,000.00	5,768,423.50	
ポーランドズロチ 小計		180,750,000.00	194,656,244.00 (5,035,757,032)	
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	167,144,880.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	165,389,660.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	187,136,790.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	172,434,639.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	98,200,000.00	103,848,464.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	172,572,007.50	
	RFLB 7.4% 07/17/24	219,200,000.00	232,254,456.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	172,466,762.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	126,161,715.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,500,000.00	65,818,702.50	
	RFLB 7.6% 07/20/22	138,700,000.00	144,640,521.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	92,300,000.00	101,857,203.50	
	RFLB 7.7% 03/16/39	116,500,000.00	132,290,992.50	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	194,055,316.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	197,603,277.50	
	RFLB 7.95% 10/07/26	147,000,000.00	162,376,200.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	100,717,182.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	111,328,272.00	
	RFLB 7% 12/15/21	170,500,000.00	174,464,977.50	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	174,689,580.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	144,211,113.00	
ロシアルーブル 小計		2,995,950,000.00	3,203,462,711.00 (4,677,055,558)	
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,327,675.00	

	MGS 3.62% 11/30/21	10,700,000.00	10,901,427.50	
	MGS 3.733% 06/15/28	14,200,000.00	14,943,441.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,027,219.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	8,998,032.75	
	MGS 3.828% 07/05/34	3,750,000.00	4,041,637.50	
	MGS 3.885% 08/15/29	13,900,000.00	14,991,358.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,463,562.50	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,565,200.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	8,916,978.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,963,560.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	10,100,000.00	10,687,921.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	11,850,000.00	12,105,841.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	10,040,152.50	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,700,000.00	7,840,708.50	
マレーシアリンギット 小計		140,450,000.00	148,814,715.25 (3,671,259,025)	
タイバーツ	THAIGB 1.45% 12/17/24	27,500,000.00	28,207,575.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	40,000,000.00	40,753,200.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	39,500,000.00	40,430,817.50	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	96,500,000.00	98,928,905.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	94,500,000.00	100,488,465.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	101,000,000.00	106,855,475.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	73,653,807.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	84,500,000.00	87,362,437.50	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	111,800,000.00	138,596,783.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000.00	218,860,602.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	91,438,200.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	167,140,525.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	75,600,000.00	79,302,888.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	100,912,854.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	95,800,000.00	110,488,056.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	116,000,000.00	150,210,140.00	
タイバーツ 小計		1,425,500,000.00	1,633,630,730.50 (5,423,654,025)	
フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	14,725,950.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	36,952,050.00	
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	51,678,000.00 (109,557,360)	
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,498,331,500.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	18,675,198,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,344,408,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	48,800,000,000.00	47,279,148,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	32,140,980,000.00	

		INDOGB 6.5% 06/15/25	10,200,000,000.00	9,883,188,000.00	
		INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	21,037,440,000.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	26,700,000,000.00	24,516,607,500.00	
		INDOGB 7.5% 06/15/35	6,200,000,000.00	5,872,857,000.00	
		INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	23,885,000,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	36,400,805,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	35,125,232,000.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	25,300,000,000.00	23,810,209,500.00	
		INDOGB 8.125% 05/15/24	29,600,000,000.00	30,562,296,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	38,000,000,000.00	38,626,810,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	33,233,532,000.00	
		INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	19,046,191,500.00	
		INDOGB 8.25% 07/15/21	31,800,000,000.00	32,815,215,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	58,800,000,000.00	60,990,594,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	53,024,920,000.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	21,357,728,000.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000.00	52,204,122,500.00	
		INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	34,128,663,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,473,937,000.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	39,500,000,000.00	41,890,540,000.00	
	インドネシアルピア 小計		722,800,000,000.00	724,823,953,500.00 (5,073,767,674)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	109,850,000.00	117,838,292.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	22,190,650.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	52,700,000.00	32,831,573.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	51,200,000.00	53,281,792.00	
		SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	32,305,757.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	41,801,718.75	
		SAGB 8.5% 01/31/37	88,000,000.00	69,821,400.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	53,739,554.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	70,111,662.50	
		SAGB 8.875% 02/28/35	69,400,000.00	57,902,849.00	
		SAGB 8% 01/31/30	79,050,000.00	68,038,730.25	
		SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	28,691,775.00	
	南アフリカランド 小計		769,450,000.00	648,555,753.50 (3,729,195,582)	
合計				49,748,605,305 (49,748,605,305)	

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
メキシコペソ	国債証券　16銘柄	100.0%	9.5%
ブラジルレアル	国債証券　12銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券　5銘柄	100.0%	2.7%
コロンビアペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	5.5%
ペルーヌエボソル	国債証券　9銘柄	100.0%	4.3%
ウルグアイペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券　15銘柄	100.0%	3.2%
チェココルナ	国債証券　11銘柄	100.0%	4.6%
ハンガリーフォリント	国債証券　11銘柄	100.0%	4.0%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	10.1%
ロシアルーブル	国債証券　21銘柄	100.0%	9.4%
マレーシアリンギット	国債証券　15銘柄	100.0%	7.4%
タイバーツ	国債証券　16銘柄	100.0%	10.9%
フィリピンペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券　25銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券　12銘柄	100.0%	7.5%

(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

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,073,702,377
投資証券	100,073,095,650
派生商品評価勘定	220,103,340
未収配当金	944,656,690
前払金	421,060,260
差入委託証拠金	701,289,000

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	104,433,907,317
資産合計	104,433,907,317
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	641,163,600
未払解約金	29,891,647
未払利息	2,948
流動負債合計	671,058,195
負債合計	671,058,195
純資産の部	
元本等	
元本	65,198,217,010
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	38,564,632,112
元本等合計	103,762,849,122
純資産合計	103,762,849,122
負債純資産合計	104,433,907,317

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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)、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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 4月20日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		65,198,217,010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	1.5915円
	(1万口当たり純資産額)	(15,915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

	2020年 4月20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不動産投信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、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 4月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引

	2020年 4月20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	「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	58,176,735,197円
期中追加設定元本額	11,721,617,436円
期中一部解約元本額	4,700,135,623円
期末元本額	65,198,217,010円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,603,915,856円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,241,491円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	14,389,257,855円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	31,380,052,863円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,260,170,305円

区分	2020年 4月20日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,024,464,783円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,395,670,023円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,117,739,091円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,107,909,967円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	31,194,852円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	427,055,025円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,759,485円
グローバル経済コア	285,305,486円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	6,795,898円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	459,690,245円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	40,058,213円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,012,626,092円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	5,477,077円
Ｊ－ＲＥＩＴパッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	313,301円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	929,183,953円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	393,453,328円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	319,881,821円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△31,514,001,309
合計	△31,514,001,309

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2020年 4月20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	不動産投信指数先物取引				
	買建	4,100,792,260	－	3,679,732,000	△421,060,260
合計		4,100,792,260	－	3,679,732,000	△421,060,260

(注)1.時価の算定方法

不動産投信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.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

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
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,480	138,232,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,763	155,672,900	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	2,711	326,946,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,043	2,591,563,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	15,609	1,134,774,300	
	森ヒルズリート投資法人	13,998	1,954,120,800	
	産業ファンド投資法人	15,669	2,286,107,100	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,539	3,732,866,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,937	1,361,989,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,096	1,990,344,000	
	ＧＬＰ投資法人	30,303	3,875,753,700	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,297	1,705,634,000	
	日本プロロジスリート投資法人	18,307	5,164,404,700	
	星野リゾート・リート投資法人	1,851	714,486,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,896	441,768,000	
	イオンリート投資法人	13,130	1,418,040,000	
	ヒューリックリート投資法人	10,347	1,263,368,700	
	日本リート投資法人	3,952	1,182,438,400	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	78,163	1,090,373,850	
	積水ハウス・リート投資法人	35,574	2,411,917,200	
	トーセイ・リート投資法人	2,648	262,152,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,699	811,987,200	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,595	292,197,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,435	222,072,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	39,277	5,235,624,100	
	いちごホテルリート投資法人	2,016	133,257,600	
	ラサールロジポート投資法人	11,312	1,696,800,000	
	スターアジア不動産投資法人	4,038	331,923,600	

	マリモ地方創生リート投資法人	1,199	109,828,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,462	1,568,286,000	
	大江戸温泉リート投資法人	2,067	118,439,100	
	さくら総合リート投資法人	2,632	185,029,600	
	投資法人みらい	13,836	566,584,200	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	2,855	248,385,000	
	三菱地所物流リート投資法人	2,395	853,817,500	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	2,287	308,287,600	
	ザイマックス・リート投資法人	1,766	164,591,200	
	タカラレーベン不動産投資法人	3,453	293,505,000	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,532	292,699,200	
	日本ビルファンド投資法人	11,782	7,469,788,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,166	7,275,268,000	
	日本リテールファンド投資法人	22,994	2,878,848,800	
	オリックス不動産投資法人	24,241	3,359,802,600	
	日本プライムリアルティ投資法人	7,996	2,550,724,000	
	プレミア投資法人	10,989	1,253,844,900	
	東急リアル・エステート投資法人	8,157	1,126,481,700	
	グローバル・ワン不動産投資法人	8,448	763,699,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	27,318	3,212,596,800	
	森トラスト総合リート投資法人	8,695	1,079,049,500	
	インヴィンシブル投資法人	53,367	1,601,010,000	
	フロンティア不動産投資法人	4,321	1,382,720,000	
	平和不動産リート投資法人	7,577	712,238,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,949	1,979,301,000	
	福岡リート投資法人	6,292	674,502,400	
	ケネディクス・オフィス投資法人	3,764	2,130,424,000	
	いちごオフィスリート投資法人	9,421	658,527,900	
	大和証券オフィス投資法人	2,808	1,707,264,000	
	阪急阪神リート投資法人	5,495	637,969,500	
	スターツプロシード投資法人	1,895	355,312,500	
	大和ハウスリート投資法人	17,359	4,320,655,100	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,193	1,571,639,300	
	大和証券リビング投資法人	14,894	1,346,417,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	11,254	1,388,743,600	
合計		715,544	100,073,095,650	

(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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	621,354,957
コール・ローン	60,619,871
投資証券	84,410,365,810
派生商品評価勘定	15,220
未収入金	6,594,381
未収配当金	70,868,080
流動資産合計	85,169,818,319
資産合計	85,169,818,319
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,246
未払金	274,263,236
未払解約金	14,672,280
未払利息	86
流動負債合計	288,975,848
負債合計	288,975,848
純資産の部	
元本等	
元本	55,864,218,710
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	29,016,623,761
元本等合計	84,880,842,471
純資産合計	84,880,842,471
負債純資産合計	85,169,818,319

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 為替予約取引

	2020年 4月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 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。 (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）

		2020年 4月20日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		55,864,218,710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	1.5194円
	(1万口当たり純資産額)	(15,194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

	2020年 4月20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。

	2020年 4月20日現在
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為替予約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、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 4月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	42,697,507,440円
期中追加設定元本額	16,485,723,957円
期中一部解約元本額	3,319,012,687円
期末元本額	55,864,218,710円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	99,823,787円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	135,560,497円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,629,189,573円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,423,756円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	10,125,895,055円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	28,444,475,615円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,438,322,562円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,925,261,290円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,792,054,915円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,241,728,627円
コア投資戦略ファンド（切替型）	691,612,815円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	196,068,821円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	398,653,196円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,324,840円
グローバル経済コア	291,935,696円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	6,969,574円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	321,460,040円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	40,970,099円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,048,493,770円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	819,943,743円

区分	2020年 4月20日現在
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	63,814,564円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	143,235,875円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△20,075,868,564
合計	△20,075,868,564

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	60,460,326	－	60,435,300	△25,026
	アメリカドル	10,793,000	－	10,788,000	△5,000
	カナダドル	12,294,416	－	12,292,800	△1,616
	イギリスポンド	6,737,150	－	6,737,000	△150
	オーストラリアドル	8,246,280	－	8,216,400	△29,880
	ニュージーランドドル	11,014,470	－	11,029,600	15,130
	シンガポールドル	11,375,010	－	11,371,500	△3,510
合計		60,460,326	－	60,435,300	△25,026

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	63,420	729,330.00	
		AGREE REALTY CORP	35,256	2,196,096.24	
		ALEXANDER'S INC	1,490	444,377.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	93,640	14,543,228.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	35,495	931,743.75	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	106,446	3,584,036.82	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	83,590	568,412.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	196,578	4,884,963.30	
		AMERICOLD REALTY TRUST	147,810	5,065,448.70	
		APARTMENT INVEST & MGMT	114,915	4,498,922.25	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	162,263	1,337,047.12	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	129,375.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	66,030	45,798.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	106,571	18,156,501.27	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	53,100.00	
		BOSTON PROPERTIES	109,990	10,504,045.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,000	60,480.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	126,778	1,340,043.46	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	218,523	2,049,745.74	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	42,700	406,077.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	44,250.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	73,159	6,424,823.38	
		CARETRUST REIT INC	72,760	1,254,382.40	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	99,840	21,625.34	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	43,913.33	
		CHATHAM LODGING TRUST	37,360	266,750.40	
		CITY OFFICE REIT INC	37,050	311,590.50	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	36,500.00	
		COLONY CAPITAL INC	402,574	833,328.18	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	86,283	1,157,055.03	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,600	518,300.00	
		CORECIVIC INC	88,003	1,024,354.92	
		COREPOINT LODGING INC	22,000	70,400.00	
		CORESITE REALTY CORP	29,298	3,493,786.50	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	82,289	2,140,336.89	
		COUSINS PROPERTIES INC	113,943	3,623,387.40	

		CUBESMART	149,347	3,815,815.85
		CYRUSONE INC	85,520	5,896,604.00
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	143,300	697,871.00
		DIGITAL REALTY TRUST INC	200,275	29,881,030.00
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	180,800	497,200.00
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	127,445	3,934,227.15
		DUKE REALTY CORP	282,337	9,859,208.04
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	54,598	1,480,697.76
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	29,878	3,210,092.32
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	110,335	981,981.50
		EPR PROPERTIES	57,742	1,419,298.36
		EQUINIX INC	64,920	45,116,154.00
		EQUITY COMMONWEALTH	95,089	3,222,566.21
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	140,001	8,876,063.40
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	266,320	18,586,472.80
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	69,910	784,390.20
		ESSEX PROPERTY TRUST	50,525	13,178,941.00
		EXTRA SPACE STORAGE INC	99,120	9,228,072.00
		FARMLAND PARTNERS INC	19,000	117,610.00
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	54,190	4,083,758.40
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	98,637	3,508,518.09
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	49,960	974,719.60
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	443,038.53
		FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	37,530	454,488.30
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	157,568	4,162,946.56
		GEO GROUP INC/THE	89,496	1,152,708.48
		GETTY REALTY CORP	25,485	614,953.05
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	365,769.00
		GLADSTONE LAND CORP	11,500	145,820.00
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	34,430	386,648.90
		GLOBAL NET LEASE INC	66,202	852,019.74
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	104,018	3,135,102.52
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	157,576	3,922,066.64
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	380,134	9,982,318.84
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	35,650	178,963.00
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	80,854	3,088,622.80
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	542,371	6,166,758.27
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	120,690	2,972,594.70
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,738	610,996.76
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	48,270	853,413.60

		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	12,593	924,829.92	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,899	523,261.20	
		INVITATION HOMES INC	413,410	9,847,426.20	
		IRON MOUNTAIN INC	217,227	5,428,502.73	
		JBG SMITH PROPERTIES	91,912	3,011,956.24	
		KILROY REALTY CORPORATION	73,890	4,752,604.80	
		KIMCO REALTY CORP	327,219	2,918,793.48	
		KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	516,839.40	
		LEXINGTON CORP PROPERTIES	182,032	1,867,648.32	
		LIFE STORAGE INC	34,448	3,210,898.08	
		LTC PROPERTIES INC	29,406	1,055,969.46	
		MACERICH CO/THE	90,380	629,948.60	
		MACK-CALI REALTY CORP	70,670	1,137,787.00	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,066,564	773,258.90	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	390,657	6,707,580.69	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	87,604	9,943,054.00	
		MONMOUTH REIT -CL A	71,792	897,400.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	132,667	4,137,883.73	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	45,810	1,216,255.50	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	32,315	1,756,643.40	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	63,000	178,290.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	17,500	496,300.00	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	34,470	886,568.40	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	167,919	5,443,933.98	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,000	188,760.00	
		PARAMOUNT GROUP INC	148,276	1,355,242.64	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	178,464	1,461,620.16	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	96,445	1,028,103.70	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	61,970	56,677.76	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	144,691	2,291,905.44	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	92,445	1,625,183.10	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,300	101,343.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	28,300	198,383.00	
		PRIME US REIT	295,000	213,875.00	
		PROLOGIS INC	561,972	50,701,113.84	
		PS BUSINESS PARKS INC	14,830	1,983,660.80	
		PUBLIC STORAGE	114,500	22,496,960.00	
		QTS REALTY TRUST INC	45,588	2,923,558.44	
		REALTY INCOME CORP	261,751	13,707,899.87	
		REGENCY CENTERS CORP	127,061	4,912,178.26	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	85,450	692,999.50	
		RETAIL PROPERTISE OF AME-A	165,590	854,444.40	

		RETAIL VALUE	8,969	105,565.13	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	86,073	3,581,497.53	
		RLJ LODGING TRUST	126,009	1,038,314.16	
		RPT REALTY	70,450	390,997.50	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	43,490	1,215,545.50	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	161,856	2,130,024.96	
		SAFEHOLD INC	9,940	538,946.80	
		SAUL CENTERS INC	8,800	272,448.00	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	29,200	290,540.00	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	125,070	734,160.90	
		SIMON PROPERTY GROUP	234,278	13,147,681.36	
		SITE CENTERS CORP	111,320	641,203.20	
		SL GREEN REALTY CORP	63,410	3,250,396.60	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	73,209	1,953,948.21	
		STAG INDUSTRIAL INC	116,030	3,026,062.40	
		STORE CAPITAL CORP	166,698	2,827,198.08	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	90,470	443,303.00	
		SUN COMMUNITIES INC	71,263	9,084,607.24	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	165,442	1,431,073.30	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	75,170	428,469.00	
		TAUBMAN CENTERS INC	45,150	1,852,053.00	
		TERRENO REALTY CORP	52,507	2,878,433.74	
		UDR INC	220,740	8,595,615.60	
		UMH PROPERTIES INC	27,000	306,990.00	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10,040	1,052,995.20	
		URBAN EDGE PROPERTIES	92,220	796,780.80	
		URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	288,900.00	
		VENTAS INC	281,034	8,793,553.86	
		VEREIT INC	825,380	4,060,869.60	
		VICI PROPERTIES INC	354,906	5,710,437.54	
		VORNADO REALTY TRUST	120,245	5,056,302.25	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	195,250	148,390.00	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	62,270	1,426,605.70	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	89,090	1,330,113.70	
		WELLTOWER INC	309,744	15,208,430.40	
		WHITESTONE REIT	38,340	224,289.00	
		WP CAREY INC	129,850	8,175,356.00	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	80,230	721,267.70	
	アメリカドル 小計		19,004,468	589,891,402.59 (63,643,383,425)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	46,542	2,072,980.68	

		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	375,184.80	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	19,560	489,000.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	63,090	3,042,830.70	
		CHOICE PROPERTIES REIT	123,670	1,655,941.30	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	70,620	615,806.40	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,577	526,689.46	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	40,730	531,119.20	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	55,550	543,279.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	419,497.80	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	76,200	1,072,896.00	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,300	1,172,089.00	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	115,539	1,110,329.79	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	44,460	628,219.80	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	32,900	565,551.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	299,735.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	178,784.30	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	27,993	951,762.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	69,170	638,439.10	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	120,696	2,007,174.48	
		SLATE OFFICE REI	17,000	65,790.00	
		SLATE RETAIL REIT	10,300	90,434.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	57,576	1,239,035.52	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	43,000	425,270.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	145,770.00	
	カナダドル 小計		1,210,913	20,863,609.33 (1,603,159,740)	
	ユーロ	AEDIFICA	18,546	1,693,249.80	
		ALSTRIA OFFICE REIT -AG	120,690	1,699,315.20	
		ALTAREA	2,730	304,668.00	
		BEFIMMO S.C.A.	16,810	647,185.00	
		COFINIMMO	19,267	2,377,547.80	
		COVIVIO(FP)	34,992	2,073,276.00	
		EUROCOMMERCIAL	32,890	304,890.30	
		GECINA SA	41,430	4,992,315.00	
		HAMBORNER REIT AG	59,000	463,386.00	
		HIBERNIA REIT PLC	482,550	520,188.90	
		ICADE	21,380	1,583,189.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	120,968.20	

		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	182,422	1,494,948.29	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	14,300	313,170.00	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	328,021	385,096.65	
		KLEPIERRE	163,360	2,763,234.40	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,000	133,000.00	
		MERCIALYS	23,450	180,565.00	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	288,918	2,174,107.95	
		MONTEA	8,100	670,680.00	
		NSI NV	12,300	448,950.00	
		RETAIL ESTATES	8,800	422,840.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	104,042	6,007,385.08	
		VASTNED RETAIL	13,750	211,200.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	97,380	2,333,224.80	
		WERELDHAVE NV	24,970	179,784.00	
	ユーロ 小計		2,188,888	34,498,365.37 (4,045,623,306)	
	イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	72,000	42,336.00	
		ASSURA PLC	1,901,950	1,481,619.05	
		BIG YELLOW GROUP PLC	114,876	1,153,355.04	
		BRITISH LAND CO PLC	730,850	2,846,660.75	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	634,297	1,070,059.03	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	29,000	28,124.20	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	466,910	454,770.34	
		DERWENT LONDON PLC	80,321	2,610,432.50	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	496,000	325,872.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	198,030	1,373,932.14	
		HAMMERSON PLC	611,600	438,639.52	
		INTU PROPERTIES PLC	521,960	35,884.75	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	580,122	3,715,101.28	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	624,500	1,154,700.50	
		LXI REIT PLC	415,000	442,390.00	
		NEWRIVER REIT PL	218,000	133,198.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	450,000	324,000.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	897,207	1,403,231.74	
		RDI REIT PLC	154,400	98,507.20	
		REGIONAL REIT LTD	292,000	224,840.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	155,566	1,086,628.51	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	138,425.00	
		SEGRO PLC	840,890	6,910,434.02	
		SHAFTESBURY PLC	162,683	1,090,789.51	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	223,286	222,839.42	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,261,418	1,453,153.53	

	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	652,000	430,320.00	
	UNITE GROUP PLC	283,402	2,285,637.13	
	WORKSPACE GROUP PLC	94,047	727,923.78	
イギリスポンド 小計		13,512,315	33,703,804.94 (4,541,587,715)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	266,440	692,744.00	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	159,000.00	
	ARENA REIT	241,053	547,190.31	
	BWP TRUST	340,160	1,187,158.40	
	CENTURIA OFFICE REIT	319,000	610,885.00	
	CHARTER HALL GROUP	350,960	2,719,940.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	304,532	1,419,119.12	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	288,380	974,724.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	164,800	374,096.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,462,633	1,192,045.89	
	DEXUS	835,636	8,047,174.68	
	GDI PROPERTY GROUP	446,500	462,127.50	
	GOODMAN GROUP	1,226,689	16,830,173.08	
	GPT GROUP	1,430,047	5,863,192.70	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	243,760	755,656.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	148,000	352,240.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	159,588	579,304.44	
	MIRVAC GROUP	3,062,130	7,104,141.60	
	NATIONAL STORAGE REIT	598,730	987,904.50	
	RURAL FUNDS GROUP	272,766	533,257.53	
	SCENTRE GROUP	4,106,173	8,828,271.95	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	731,060	1,637,574.40	
	STOCKLAND	1,811,374	5,524,690.70	
	VICINITY CENTERS	2,457,150	3,415,438.50	
	VIVA ENERGY REIT	475,000	1,178,000.00	
オーストラリアドル 小計		21,817,561	71,976,050.70 (4,928,919,951)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	652,278	684,891.90	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	840,300	1,844,458.50	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,147,030	1,158,500.30	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	800,000	1,248,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	220,460	573,196.00	
ニュージーランドドル 小計		3,660,068	5,509,046.70 (357,482,040)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,523,000	7,203,790.00	
	FORTUNE REIT	1,034,000	7,517,180.00	
	LINK REIT	1,599,600	112,611,840.00	

	PROSPERITY REIT	782,000	1,955,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	791,000	3,132,360.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,208,000	4,674,960.00	
香港ドル 小計		6,937,600	137,095,130.00 (1,908,364,209)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	442,500.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,311,000	6,678,790.00	
	ASCOTT TRUST	1,442,077	1,276,238.14	
	CACHE LOGISTICS TRUST	881,000	462,525.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	2,129,428	3,300,613.40	
	CAPITALAND MALL TRUST	2,212,000	4,092,200.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	637,729	841,802.28	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	712,300	680,246.50	
	ESR REIT	1,854,065	648,922.75	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	780,000	382,200.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	430,480.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	562,529	1,153,184.45	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	230,000.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	1,744,296	1,779,181.92	
	KEPPEL DC REIT	952,903	2,286,967.20	
	KEPPEL REIT	1,388,900	1,444,456.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	147,870.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,610,473	2,947,165.59	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,137,460	2,764,027.80	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,333,552	4,083,716.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,652,100	1,536,453.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,903,644	818,566.92	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	288,000	976,320.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	155,525.50	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	465,800	328,389.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	268,911.24	
	SPH REIT	572,300	457,840.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	549,153.00	
	SUNTEC REIT	1,754,000	2,438,060.00	
シンガポールドル 小計		33,930,112	43,602,305.69 (3,305,926,817)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,500	116,375,000.00	
韓国ウォン 小計		17,500	116,375,000.00	

				(10,322,462)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	131,500	2,182,900.00	
	イスラエルシェケル 小計		131,500	2,182,900.00 (65,596,145)	
合計			102,410,925	84,410,365,810 (84,410,365,810)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券　157銘柄	100.0%	75.4%
カナダドル	投資証券　25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券　26銘柄	100.0%	4.8%
イギリスポンド	投資証券　29銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券　25銘柄	100.0%	5.8%
ニュージーランドドル	投資証券　5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	2.3%
シンガポールドル	投資証券　29銘柄	100.0%	3.9%
韓国ウォン	投資証券　1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券　1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	13,820,973
コール・ローン	831,725
投資証券	274,994,761
未収配当金	135,770
流動資産合計	289,783,229
資産合計	289,783,229
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,024
未払利息	1
流動負債合計	2,025
負債合計	2,025
純資産の部	
元本等	
元本	652,254,337
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△362,473,133
元本等合計	289,781,204
純資産合計	289,781,204
負債純資産合計	289,783,229

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 4月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

	2020年 4月20日現在
	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。 (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）

		2020年 4月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	652,254,337口
2．	「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 362,473,133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 0.4443円 (1万口当たり純資産額) (4,443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

	2020年 4月20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為替予約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、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 4月20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	2020年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月22日
期首元本額	541,560,335円
期中追加設定元本額	162,190,157円
期中一部解約元本額	51,496,155円
期末元本額	652,254,337円

区分	2020年 4月20日現在
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	290,554,085円
ＳＭＴ　新興国ＲＥＩＴインデックス・オープン	361,700,252円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△101,500,969
合計	△101,500,969

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	109,900	2,115,575.00	
		CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	81,200	387,324.00	
		FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	378,100	7,270,863.00	
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	97,200	1,862,352.00	
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	100,300	2,331,975.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	57,800	2,214,318.00	
	メキシコペソ 小計		824,500	16,182,407.00 (72,659,007)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	248,842	301,098.82	
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	60,670	87,364.80	
			309,512	388,463.62	

	トルコリラ 小計			(6,071,686)	
	マレーシアリンギット	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	97,900	189,926.00	
		CAPITALAND MALAYSIA MALL TRU	114,400	99,528.00	
		IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	226,400	387,144.00	
		KLCCP STAPLED GROUP	57,700	458,715.00	
		PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	99,900	161,838.00	
		SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	196,400	314,240.00	
	マレーシアリンギット 小計		792,700	1,611,391.00 (39,753,015)	
	タイバーツ	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	204,700	5,885,125.00	
		FRASERS PROPERTY THAILAND IN	162,800	2,458,280.00	
		HEMARAJ LEASEHOLD REIT	72,700	548,885.00	
		IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	81,200	1,258,600.00	
		S PRIME GROWTH LEASEHOLD REA	43,500	535,050.00	
		TESCO LOTUS RETAIL GROWTH FR	222,900	3,945,330.00	
		WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	141,100	2,031,840.00	
	タイバーツ 小計		928,900	16,663,110.00 (55,321,525)	
	南アフリカランド	ARROWHEAD PROPERTIES LTD-B	109,831	208,678.90	
		ATTACQ LTD	90,957	580,305.66	
		EMIRA PROPERTY FUND LTD	50,248	351,736.00	
		EQUITES PROPERTY FUND LTD	71,972	1,259,510.00	
		FORTRESS REIT LTD-A	152,446	1,683,003.84	
		FORTRESS REIT LTD-B	107,060	222,684.80	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	375,350	5,247,393.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	31,141	604,758.22	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	687,694	1,801,758.28	
		RESILIENT REIT LTD	36,720	1,457,416.80	
		SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	307,969	443,475.36	
		STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	47,824	604,973.60	
		VUKILE PROPERTY FUND LTD	113,057	784,615.58	
	南アフリカランド 小計		2,182,269	15,250,310.04 (87,689,282)	
	サウジアラビアリアル	AL RAJHI REIT	14,397	119,783.04	
		DERAYAH REIT	10,074	95,703.00	
		JADWA REIT SAUDI FUND	10,575	118,228.50	
		MUSHARAKA REIT FUND	5,247	41,923.53	
		RIYAD REIT FUND	12,328	93,446.24	
	サウジアラビアリアル 小計		52,621	469,084.31 (13,500,246)	
			5,090,502	274,994,761	

合計		(274,994,761)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	投資証券　6銘柄	100.0%	26.4%
トルコリラ	投資証券　2銘柄	100.0%	2.2%
マレーシアリンギット	投資証券　6銘柄	100.0%	14.5%
タイバーツ	投資証券　7銘柄	100.0%	20.1%
南アフリカランド	投資証券　13銘柄	100.0%	31.9%
サウジアラビアリアル	投資証券　5銘柄	100.0%	4.9%

(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

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン】

【純資産額計算書】

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	2,394,761,832円
Ⅱ　負債総額	20,470,153円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,374,291,679円
Ⅳ　発行済口数	2,387,834,767口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9943円
（1万口当たり純資産額）	（9,943円）

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	314,250,145,045円
Ⅱ　負債総額	802,079,558円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	313,448,065,487円
Ⅳ　発行済口数	212,335,378,830口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4762円
（1万口当たり純資産額）	（14,762円）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	556,073,536,556円
Ⅱ　負債総額	15,914,233,413円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	540,159,303,143円
Ⅳ　発行済口数	382,125,773,582口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4136円
（1万口当たり純資産額）	（14,136円）

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	**401,607,744,014円**
Ⅱ　負債総額	**1,882,677,216円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**399,725,066,798円**
Ⅳ　発行済口数	**154,591,953,075口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.5857円**
（1万口当たり純資産額）	**（25,857円）**

外国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	**276,217,479,303円**
Ⅱ　負債総額	**48,429,626円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**276,169,049,677円**
Ⅳ　発行済口数	**95,174,617,742口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.9017円**
（1万口当たり純資産額）	**（29,017円）**

新興国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	**62,974,991,984円**
Ⅱ　負債総額	**238,569,977円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**62,736,422,007円**
Ⅳ　発行済口数	**25,274,016,451口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.4822円**
（1万口当たり純資産額）	**（24,822円）**

新興国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	57,239,345,932円
Ⅱ　負債総額	3,599,917円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	57,235,746,015円
Ⅳ　発行済口数	35,077,067,644口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6317円
（1万口当たり純資産額）	（16,317円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	116,155,022,847円
Ⅱ　負債総額	1,007,823,218円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	115,147,199,629円
Ⅳ　発行済口数	67,313,405,890口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7106円
（1万口当たり純資産額）	（17,106円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	89,849,819,155円
Ⅱ　負債総額	568,912,581円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	89,280,906,574円
Ⅳ　発行済口数	57,396,670,696口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5555円
（1万口当たり純資産額）	（15,555円）

新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

Ⅰ　資産総額	314,286,884円
Ⅱ　負債総額	1,020,068円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	313,266,816円

Ⅳ　発行済口数	674,262,573口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.4646円
（1万口当たり純資産額）	（4,646円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年 5月29日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2020年 7月20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。

2020年5月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	540	12,378,815
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	296,794
単位型公社債投資信託	28	214,518
合計	647	12,890,127

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2)　委託者の財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、当事業年度より百万円単位で記載することに変更いたしました。

(3)　委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		前事業年度 （2019年3月31日現在）		当事業年度 （2020年3月31日現在）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		23,830		24,869
金銭の信託		－		5,823
有価証券		2,268		－
前払費用		197		348
未収委託者報酬		6,351		7,284
未収運用受託報酬		5,525		5,842
未収収益		212		190
その他		2,261		4,624
流動資産合計		40,648		48,983
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	282	※1	256
器具備品	※1	564	※1	576
その他	※1	14	※1	0
有形固定資産合計		861		832
無形固定資産				
ソフトウェア		1,487		3,030
その他		7		40
無形固定資産合計		1,494		3,070
投資その他の資産				
投資有価証券		11,334		8,469
関係会社株式		4,663		5,636
繰延税金資産		141		700
その他		32		35
投資その他の資産合計		16,171		14,842
固定資産合計		18,527		18,745
資産合計		59,176		67,729

（単位：百万円）

	前事業年度 （2019年3月31日現在）	当事業年度 （2020年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
固定負債		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	393	△587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	△302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	－	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	－
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	－	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	－
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	－
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	△125	△193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300	350	350
当期変動額			
その他資本剰余金から資本金への振替	1,700	△1,700	△1,700
会社分割による増加		18,589	18,589
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	1,700	16,889	16,889
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から資本金への振替					－
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		△30	△30	△30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	－	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	0	－	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から資本金への振替				－
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				△30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
その他資本剰余金から資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			

当期変動額合計	―	―	―
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から資本金への振替					―
会社分割による増加					―
剰余金の配当	230		△2,536	△2,305	△2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	―	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から資本金への振替				―
会社分割による増加				―
剰余金の配当				△2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△980	151	△829	△829
当期変動額合計	△980	151	△829	6,022
当期末残高	△587	284	△302	56,464

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

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．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、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。

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

６．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。

７．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

８．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。

９．連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

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 （2019年3月31日）		当事業年度 （2020年3月31日）	
建　　物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	〃	285	〃
そ の 他	3	〃	4	〃
計	408	〃	367	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日　至 2019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(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29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(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日　至 2020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(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28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
2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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（2019年3月31日）　（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	23,830	23,830	－
（2）金銭の信託	－	－	－
（3）未収委託者報酬	6,351	6,351	－
（4）未収運用受託報酬	5,525	5,525	－

(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,602	13,602	―
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	―
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	―
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	―
デリバティブ取引計	81	81	―

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2020年3月31日）　　（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	―
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	―
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	―
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	―
(5) 投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	―
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	―
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	―
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	―
デリバティブ取引計	(107)	(107)	―

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1)　金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金
　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。

(2) 金銭の信託
　信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、 及び(4)未収運用受託報酬
　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。

(5) 有価証券及び投資有価証券
　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。

(6) 未払金
　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。

(7) デリバティブ取引
　（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

(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:百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

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、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」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（2019年3月31日） （単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	－	－	－
未収委託者報酬	6,351	－	－	－
未収運用受託報酬	5,525	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020年3月31日） （単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	－	－	－
未収委託者報酬	7,284	－	－	－
未収運用受託報酬	5,842	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	9	5,605	－

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、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子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、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子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

前事業年度（2019年3月31日） （単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	9,196	9,602	△406
小計	9,196	9,602	△406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度（2020年3月31日）　（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	7,578	8,509	△931
小計	7,578	8,509	△931
合計	8,469	9,316	△846

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）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。

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887	－	3	3
	英ポンド	66	－	1	1
	カナダドル	3	－	0	0
	スイスフラン	7	－	△0	△0
	香港ドル	183	－	0	0
	ユーロ	183	－	2	2
	買建				
	米ドル	10	－	0	0
	スイスフラン	1	－	0	0
	香港ドル	0	－	0	0
	ユーロ	2	－	△0	△0
合計		1,346	－	7	7

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739	－	△8	△8
合計		6,739	－	△8	△8

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	－	13
	英ポンド		2,575	－	50
	カナダドル		40	－	0
	スイスフラン		34	－	△0
	香港ドル		566	－	2
	人民元		1,725	－	9
	ユーロ		262	－	6
	買建				
	ユーロ		6	－	△0
合計			8,643	－	82

（注）　1．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	－	△23	△23
	英ポンド	79	－	△1	△1
	カナダドル	15	－	△0	△0
	スイスフラン	26	－	△0	△0
	香港ドル	247	－	△4	△4
	人民元	18	－	△0	△0
	ユーロ	223	－	△2	△2
合計		2,055	－	△32	△32

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
　　2．時価の算定方法
　　取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	－	358	358
合計		8,412	－	358	358

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
　　2．時価の算定方法
　　金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,819	－	△44
	英ポンド		2,660	－	△67
	カナダドル		6	－	△0
	スイスフラン		35	－	△0
	香港ドル		71	－	△1
	ユーロ		72	－	△0
合計			5,666	－	△114

（注）　1．時価の算定方法
　　取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要
　　当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

２．確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	△38	△11
退職給付債務の期末残高	537	600

（2）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

（3）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用　前事業年度79百万円　　当事業年度74百万円

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

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 （2019年3月31日）		当事業年度 （2020年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	〃	99	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	〃	183	〃
有価証券評価差額	―		259	〃
その他	82	〃	151	〃
繰延税金資産 合計	413	〃	862	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△173	〃	―	
繰延ヘッジ損益	△58	〃	△125	〃
その他	△38	〃	△35	〃
繰延税金負債 合計	△271	〃	△161	〃
繰延税金資産の純額	141	〃	700	〃

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。

（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］

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 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	 18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	―	―

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

③ 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。

④ 吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

前事業年度（2019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（2020年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

と。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 7月20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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

③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） （2019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。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ａｕカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	9,257	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
藍澤證券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＧＭＯクリック証券株式会社	4,346	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2019年3月末日現在）
④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。
⑤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。

再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でＪＴＣホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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みます。）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

2020年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年４月１日から2020年３月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年6月18日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT インデックスバランス・オープンの2019年10月22日から2020年4月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT インデックスバランス・オープンの2020年4月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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