【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4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】	ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）
【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】

ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）

（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】

ありません。

（6）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（7）【申込期間】

2020年 4月21日から2020年10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＞
当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
収益分配金の再投資の場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所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並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

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。

＜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。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

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。

＜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）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 （　）	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。

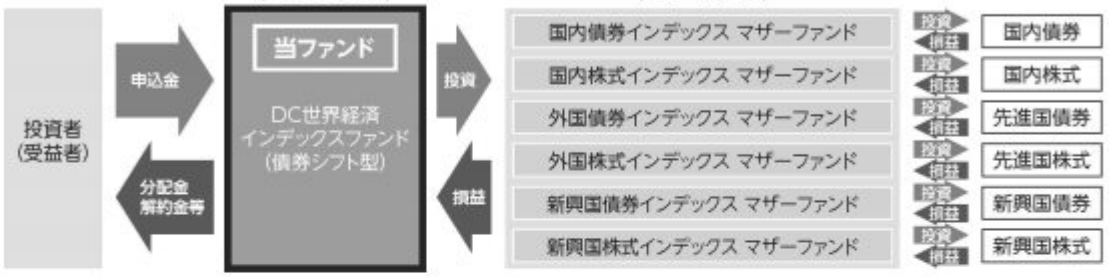
[特殊型]
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左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

1. 世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●世界の債券及び株式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

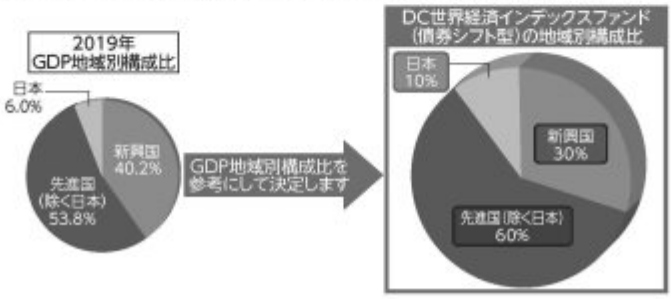


？ ファミリーファンド方式とは

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。

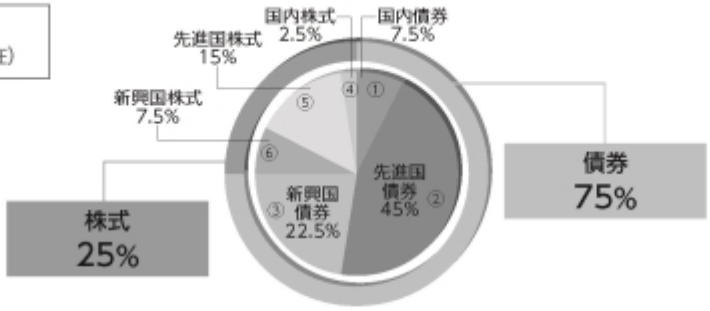
2. 世界経済全体の発展を享受します。

●基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。
※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回地域別構成比の見直しを行います。
※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。
※上記のファンドの地域別構成比は、2020年2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。

基本組入比率（2020年2月末現在）



●基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
●基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。また、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組入比率を調整する場合もあります。

資産	インデックス
①国内債券	NOMURA-BPI 総合※1
②先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）※2
③新興国債券	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）※3

④国内株式	TOPIX（東証株価指数）※4
⑤先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）※5
⑥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）※6

＊ 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「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。

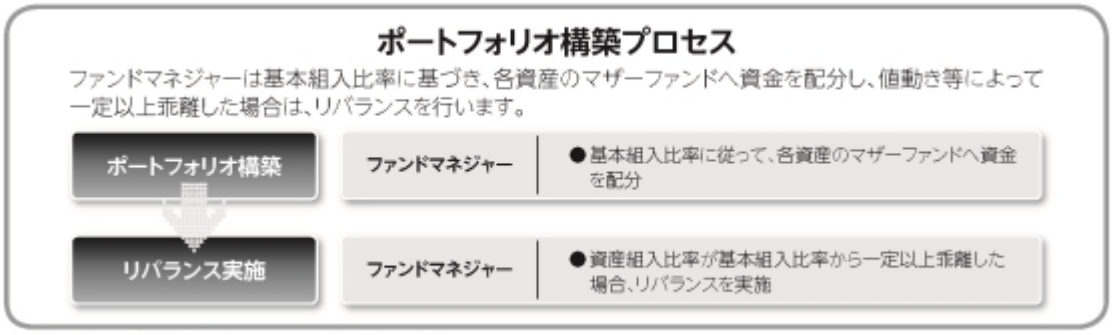
※2「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権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

※3「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」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。

※4「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。

※5「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。

※6「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。
「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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

●原則として、毎年1月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%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。

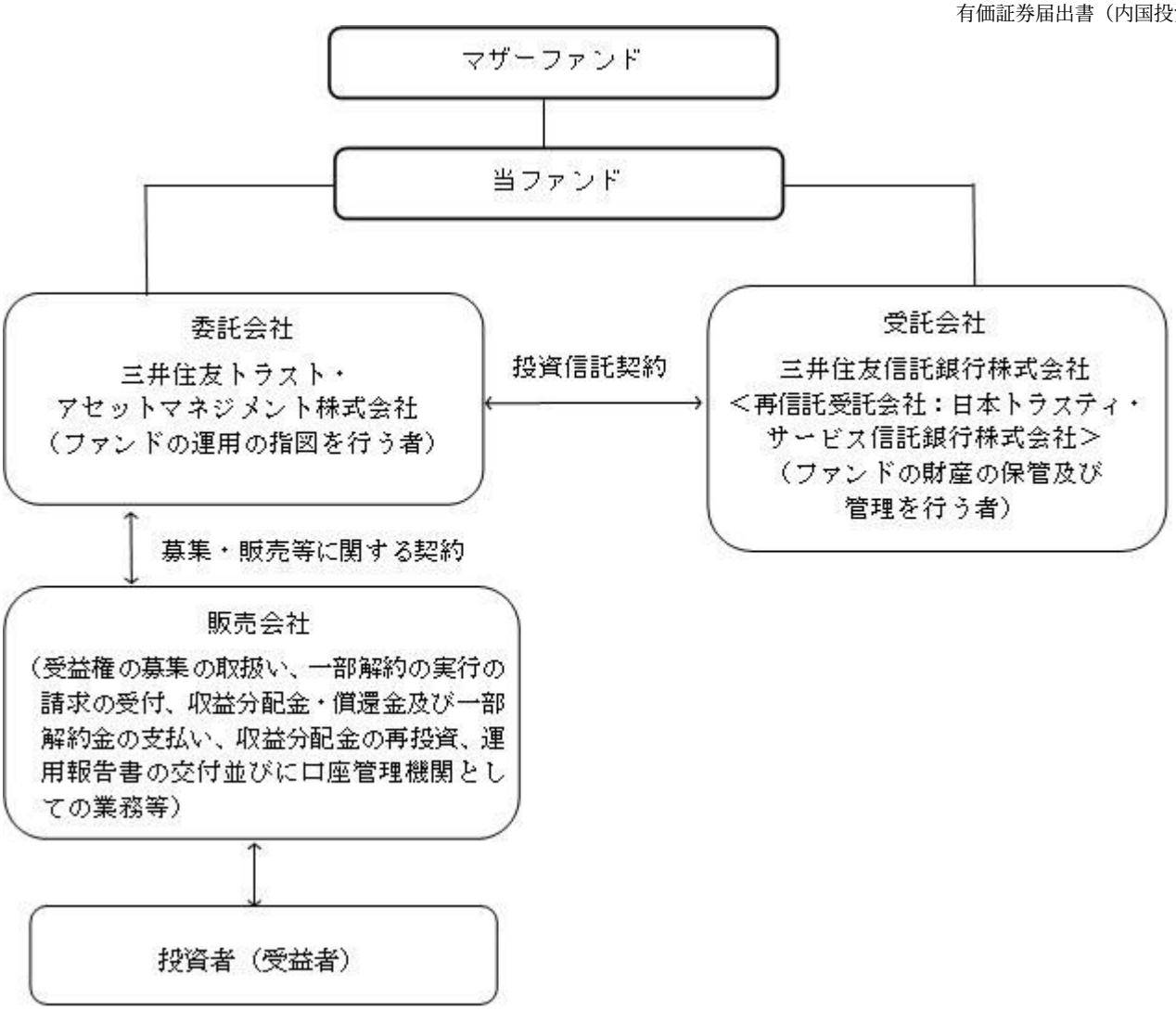
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2013年7月12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 2月28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、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

②投資対象

「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興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」（以下総称して、又はそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下総称して、又はそれぞれを「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

③投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

ロ．株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式25%、債券75%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する場合もあります。

ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各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．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。

ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

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

（2）【投資対象】

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21条、第22条及び第23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、次に掲げる第1号から第6号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに第7号から第28号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.国内債券インデックス マザーファンド
2.国内株式インデックス マザーファンド
3.外国債券インデックス マザーファンド
4.外国株式インデックス マザーファンド
5.新興国債券インデックス マザーファンド
6.新興国株式インデックス マザーファンド
7.株券又は新株引受権証書
8.国債証券
9.地方債証券
10.特別の法律により法人の発行する債券
11.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。）
12.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。）
13.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。）
14.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。）
15.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。）
16.コマーシャル・ペーパー
17.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
18.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、第7号から第17号の証券又は証書の性質を有するもの
19.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。）
20.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。）
21.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。）
22.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。）
23.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。）
24.外国法人が発行する譲渡性預金証書
25.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。）
26.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。）
27.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

28.外国の者に対する権利で第27号の有価証券の性質を有するもの

なお、第7号の証券又は証書、第18号ならびに第23号の証券又は証書のうち第7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8号から第12号までの証券及び第18号ならびに第23号の証券又は証書のうち第8号から第12号までの証券の性質を有するもの、及び第20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19号及び第20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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

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

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、並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。）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。

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

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券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並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。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

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並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、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並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る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並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。

「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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
⑤有価証券等の価格変動リスク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並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、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。
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並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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、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並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、並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株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債並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。

「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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、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並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、並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。

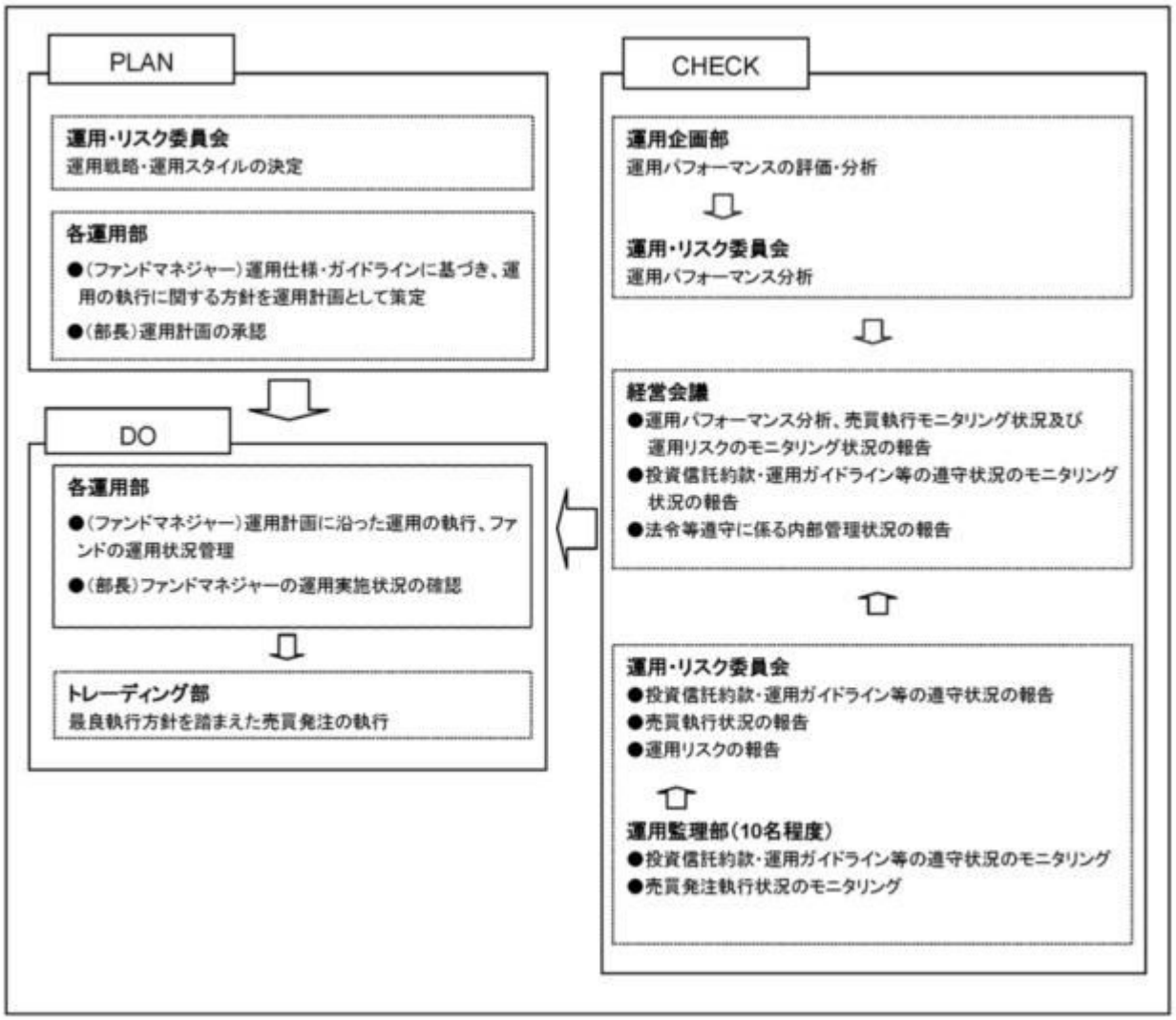
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう

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。

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年1月20日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

・分配対象額は、経費控除後の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。

・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式への投資割合

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

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

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、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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。前文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

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。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、なら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（第5号に定める

ものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うこと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。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引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。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク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。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、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、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。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ヲ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、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属す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。

ワ．資金の借入れ

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間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。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

カ．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。

ヨ．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。

＜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為替変動リスク

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

③金利変動リスク

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

④信用リスク

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

⑤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。

⑥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。

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

(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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。

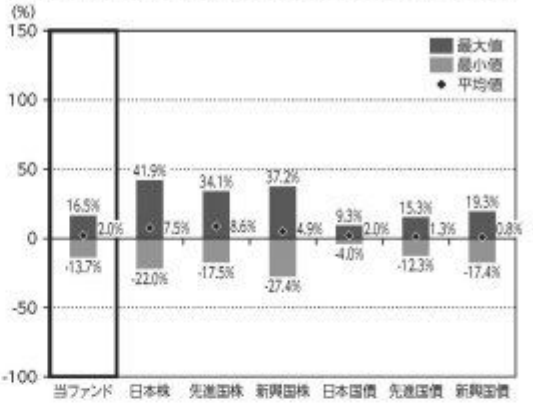
〔参考情報〕

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



*2015年3月～2020年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(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・サービスに関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、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】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス 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0.495%（税抜　0.45%）（※）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　0.2255%　（税抜　0.205%）	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　0.2255%　（税抜　0.205%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.044%　（税抜　0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。
受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。
※上記は、2020年 2月28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2月28日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

（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	18,962,568,619	99.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	144,097,019	0.75
合計(純資産総額)		19,106,665,638	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	外国債券インデックス　マザーファンド	2,947,825,899	2.8678	8,453,975,235	2.9142	8,590,554,234	44.96
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	2,462,256,455	1.8152	4,469,580,644	1.7440	4,294,175,257	22.47
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	1,120,114,684	2.9625	3,318,432,124	2.6575	2,976,704,772	15.58

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	494,773,604	3.1305	1,548,930,996	2.8000	1,385,366,091	7.25
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	894,851,637	1.4163	1,267,413,928	1.4380	1,286,796,654	6.73
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	304,515,945	1.6232	494,293,320	1.4087	428,971,611	2.25

(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	99.25
合計	99.25

(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　(2014年 1月20日)	1,070,781	1,070,781	10,708	10,708
第2期計算期間末　(2015年 1月20日)	1,511,892,680	1,511,892,680	11,996	11,996
第3期計算期間末　(2016年 1月20日)	3,769,356,945	3,769,356,945	10,806	10,806
第4期計算期間末　(2017年 1月20日)	5,951,230,510	5,951,230,510	11,445	11,445
第5期計算期間末　(2018年 1月22日)	10,598,819,384	10,598,819,384	12,729	12,729
第6期計算期間末　(2019年 1月21日)	14,352,111,502	14,352,111,502	11,903	11,903
第7期計算期間末　(2020年 1月20日)	19,297,710,395	19,297,710,395	13,136	13,136
2019年 2月末日	15,338,439,365	—	12,259	—
3月末日	15,730,109,078	—	12,286	—
4月末日	15,863,460,040	—	12,403	—
5月末日	15,708,472,749	—	12,052	—
6月末日	16,565,391,497	—	12,359	—
7月末日	16,942,028,688	—	12,475	—
8月末日	16,732,148,325	—	12,198	—

9月末日	17,146,270,662	—	12,400	—
10月末日	17,728,834,877	—	12,696	—
11月末日	17,993,029,060	—	12,745	—
12月末日	18,372,758,982	—	13,002	—
2020年 1月末日	19,308,826,483	—	12,953	—
2月末日	19,106,665,638	—	12,730	—

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	2013年 7月12日～2014年 1月20日	0
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	0
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2013年 7月12日～2014年 1月20日	7.1
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	12.0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	△9.9
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	5.9
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	11.2
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	△6.5
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	10.4

(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	2013年 7月12日～2014年 1月20日	1,000,000	—	1,000,000
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	1,264,200,461	4,819,258	1,260,381,203
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	2,314,726,589	86,743,414	3,488,364,378
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	1,917,237,311	205,920,631	5,199,681,058
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	3,590,828,070	463,827,028	8,326,682,100

第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	4,302,064,238	571,611,813	12,057,134,525
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	3,471,717,558	838,615,756	14,690,236,327

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

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	470,649,738,300	83.22
地方債証券	日本	30,852,699,445	5.46
特殊債券	日本	38,497,161,893	6.81
社債券	日本	21,369,434,970	3.78
	フランス	1,909,828,000	0.34
	オーストラリア	402,340,000	0.07
	アメリカ	208,332,000	0.04
	イギリス	100,479,000	0.02
	小計	23,990,413,970	4.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,586,247,404	0.28
合計(純資産総額)		565,576,261,012	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）	9,510,000,000	101.37	9,640,287,000	101.42	9,645,137,100	0.100	2023/12/20	1.71
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	7,420,000,000	101.98	7,566,960,600	101.58	7,537,829,600	0.100	2024/6/20	1.33
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	102.53	7,115,998,400	0.100	2026/9/20	1.26
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,770,000,000	101.59	6,877,841,000	101.32	6,859,837,900	0.100	2023/9/20	1.21
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	6,550,000,000	102.61	6,721,481,900	102.87	6,738,312,500	0.100	2028/3/20	1.19
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	6,460,000,000	102.39	6,614,812,400	102.33	6,611,034,800	0.100	2026/3/20	1.17
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	103.80	6,560,539,200	0.400	2025/9/20	1.16

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	101.68	6,121,256,400	0.100	2024/9/20	1.08
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	101.07	6,114,916,500	0.100	2022/12/20	1.08
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	5,890,000,000	103.97	6,124,268,300	103.63	6,103,865,900	0.400	2025/6/20	1.08
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	5,500,000,000	101.20	5,566,000,000	101.26	5,569,630,000	0.100	2023/6/20	0.98
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	5,120,000,000	103.04	5,275,648,000	102.69	5,258,086,400	0.100	2029/6/20	0.93
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,940,000,000	102.98	5,087,243,100	102.85	5,080,888,800	0.100	2027/9/20	0.90
日本	国債証券	第１３１回利付国債（５年）	5,040,000,000	100.81	5,080,824,000	100.75	5,077,900,800	0.100	2022/3/20	0.90
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	4,980,000,000	101.13	5,036,274,000	101.16	5,038,166,400	0.100	2023/3/20	0.89
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,790,000,000	102.43	4,906,663,000	102.83	4,925,748,600	0.100	2028/9/20	0.87
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	100.85	4,810,831,200	0.100	2022/6/20	0.85
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	4,640,000,000	101.50	4,709,628,600	101.51	4,710,249,600	0.100	2024/3/20	0.83
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	102.25	4,673,007,800	1.000	2021/12/20	0.83
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	4,580,000,000	101.42	4,645,229,000	101.77	4,661,295,000	0.100	2024/12/20	0.82
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,490,000,000	102.03	4,581,457,900	102.78	4,614,822,000	0.100	2028/12/20	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	100.97	4,422,792,600	0.100	2022/9/20	0.78
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	3,890,000,000	102.12	3,972,468,000	102.76	3,997,519,600	0.100	2029/3/20	0.71
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	3,290,000,000	120.55	3,966,265,300	121.36	3,992,908,500	1.500	2034/6/20	0.71
日本	国債証券	第４０３回利付国債（２年）	3,770,000,000	100.80	3,800,271,400	100.49	3,788,473,000	0.100	2021/8/1	0.67
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	3,620,000,000	103.72	3,754,953,600	103.54	3,748,473,800	0.500	2024/9/20	0.66
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	102.87	3,693,356,100	0.100	2028/6/20	0.65
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	3,540,000,000	102.29	3,621,295,200	102.73	3,636,712,800	0.100	2027/3/20	0.64
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	3,430,000,000	103.28	3,542,778,400	103.42	3,547,340,300	0.300	2025/12/20	0.63
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	102.67	3,490,916,000	0.600	2023/3/20	0.62

(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	83.22
地方債証券	5.46
特殊債券	6.81
社債券	4.24
合計	99.72

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	284,393,627,080	98.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,204,480,524	1.46
合計(純資産総額)		288,598,107,604	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	4,213,595,000	1.46

(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	1,490,800	6,669.70	9,943,202,620	7,127.00	10,624,931,600	3.68
日本	株式	ソニー	電気機器	844,900	5,453.05	4,607,289,417	6,611.00	5,585,633,900	1.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,040,300	5,175.27	5,383,837,602	5,013.00	5,215,023,900	1.81
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	9,013,800	510.35	4,600,192,830	531.90	4,794,440,220	1.66

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,752,600	2,475.66	4,338,844,415	2,529.50	4,433,201,700	1.54
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,111,600	3,839.12	4,267,573,724	3,763.00	4,182,950,800	1.45
日本	株式	キーエンス	電気機器	121,100	31,616.80	3,828,794,924	34,410.00	4,167,051,000	1.44
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	914,600	3,606.73	3,298,723,858	3,758.00	3,437,066,800	1.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	921,300	3,801.31	3,502,155,873	3,484.00	3,209,809,200	1.11
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	977,100	2,802.03	2,737,868,820	3,058.00	2,987,971,800	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	81,900	39,134.72	3,205,134,325	36,270.00	2,970,513,000	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,051,900	2,758.51	2,901,679,095	2,799.50	2,944,794,050	1.02
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	968,500	2,599.77	2,517,878,085	2,927.50	2,835,283,750	0.98
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	471,200	5,578.63	2,628,650,936	5,801.00	2,733,431,200	0.95
日本	株式	信越化学工業	化学	224,700	9,517.47	2,138,576,565	12,145.00	2,728,981,500	0.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,906,100	156.06	2,794,504,820	147.60	2,642,940,360	0.92
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	266,800	8,030.61	2,142,568,338	9,609.00	2,563,681,200	0.89
日本	株式	第一三共	医薬品	382,300	5,605.80	2,143,101,078	6,590.00	2,519,357,000	0.87
日本	株式	花王	化学	319,900	8,604.11	2,752,455,984	7,868.00	2,516,973,200	0.87
日本	株式	ダイキン工業	機械	170,200	13,832.62	2,354,313,005	14,725.00	2,506,195,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	923,400	2,831.43	2,614,548,664	2,690.00	2,483,946,000	0.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	642,000	3,834.67	2,461,861,044	3,637.00	2,334,954,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	127,000	18,527.86	2,353,038,345	17,970.00	2,282,190,000	0.79
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	920,400	2,033.00	1,871,178,796	2,461.50	2,265,564,600	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	392,600	4,734.78	1,858,876,410	5,721.00	2,246,064,600	0.78
日本	株式	三井物産	卸売業	1,156,600	1,691.10	1,955,934,874	1,783.50	2,062,796,100	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	160,800	13,810.12	2,220,668,500	12,780.00	2,055,024,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,175,200	1,546.40	1,817,338,378	1,699.00	1,996,664,800	0.69
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	89,100	15,456.81	1,377,202,420	22,325.00	1,989,157,500	0.69
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	111,100	22,613.83	2,512,396,965	17,780.00	1,975,358,000	0.68

(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	0.27
		建設業	2.74
		食料品	3.75
		繊維製品	0.56
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.07
		医薬品	6.03
		石油・石炭製品	0.48

		ゴム製品	0.66
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	0.67
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.57
		機械	4.97
		電気機器	14.24
		輸送用機器	7.74
		精密機器	2.45
		その他製品	2.17
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	4.04
		海運業	0.15
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	9.19
		卸売業	5.05
		小売業	4.41
		銀行業	5.67
		証券、商品先物取引業	0.80
		保険業	2.36
		その他金融業	1.22
		不動産業	2.38
		サービス業	4.95
		小計	98.54
合計			98.54

(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	281	円	4,674,038,300	4,213,595,000	1.46

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

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

外国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	199,739,830,943	48.18
	フランス	39,705,603,431	9.58
	イタリア	35,678,911,043	8.61
	イギリス	25,992,764,462	6.27
	ドイツ	24,841,614,930	5.99
	スペイン	22,581,497,406	5.45
	ベルギー	9,582,938,716	2.31
	カナダ	7,773,273,203	1.87
	オーストラリア	7,647,201,381	1.84
	オランダ	7,409,768,756	1.79
	オーストリア	5,637,655,400	1.36
	メキシコ	3,526,181,758	0.85
	アイルランド	2,877,295,790	0.69
	ポーランド	2,349,044,461	0.57
	南アフリカ	2,248,795,620	0.54
	フィンランド	2,218,197,072	0.54
	デンマーク	1,997,461,593	0.48
	マレーシア	1,931,959,593	0.47
	シンガポール	1,647,415,356	0.40
	スウェーデン	1,133,376,400	0.27
	ノルウェー	921,172,577	0.22
	小計	407,441,959,891	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,144,922,764	1.72
合計(純資産総額)		414,586,882,655	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,329,377,902	0.32
	買建	ドイツ	1,464,014,054	0.35

(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	—	2,839,194,800	0.68

(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 2.625% 02/15/29	20,000,000	11,522.62	2,304,524,671	12,205.71	2,441,143,933	2.625	2029/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/23	20,000,000	11,310.24	2,262,049,416	11,527.33	2,305,467,826	2.750	2023/5/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	18,760,000	10,087.25	1,892,369,488	11,989.42	2,249,216,013	2.250	2046/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,183.69	2,096,942,958	11,832.11	2,218,522,266	2.375	2027/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,424.53	2,057,558,656	11,991.13	2,159,603,272	2.375	2029/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,374.15	2,047,347,756	11,865.46	2,135,782,936	2.625	2026/1/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	18,900,000	11,085.04	2,095,072,586	11,253.33	2,126,880,635	1.625	2026/11/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	14,970,000	11,778.58	1,763,253,479	13,966.85	2,090,838,751	3.000	2049/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,524.08	1,736,474,565	12,537.42	2,068,675,842	2.500	2046/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	11,014.23	2,037,633,449	11,144.76	2,061,780,889	2.125	2021/12/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,517.24	1,682,759,825	12,551.96	2,008,314,075	2.500	2046/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,261.88	1,880,734,948	11,856.05	1,979,961,446	2.625	2025/12/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,506.39	1,831,817,856	12,375.84	1,970,235,171	2.875	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,813.47	1,892,358,879	11,176.39	1,955,868,902	1.750	2023/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	15,900,000	11,353.59	1,805,221,037	11,577.77	1,840,866,934	2.500	2024/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,745.77	1,691,391,123	12,630.61	1,818,808,672	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,498.27	1,724,740,768	12,045.84	1,806,877,383	3.000	2025/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,502.97	1,640,324,075	12,343.36	1,760,163,425	2.875	2028/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 3% 05/15/47	12,750,000	12,285.23	1,566,367,207	13,804.42	1,760,064,005	3.000	2047/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,962.66	1,606,030,167	11,777.40	1,725,389,649	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	11,130.12	1,669,518,795	11,459.80	1,718,970,037	2.250	2024/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	11,256.65	1,643,472,293	11,730.81	1,712,698,338	2.375	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	11,159.78	1,673,967,125	11,352.50	1,702,876,145	2.375	2023/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,060.97	1,659,146,883	11,224.69	1,683,704,518	2.500	2022/1/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	15,000,000	11,148.40	1,672,260,017	11,210.16	1,681,524,459	2.000	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,914.00	1,642,557,158	11,063.54	1,665,063,378	1.750	2021/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,941.74	1,433,008,830	13,865.97	1,663,917,353	3.125	2044/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	15,000,000	10,884.67	1,632,701,072	11,092.18	1,663,827,576	1.625	2022/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	11,950,000	11,780.98	1,407,828,169	13,913.85	1,662,705,502	3.000	2048/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	14,950,000	11,019.09	1,647,354,142	11,097.52	1,659,080,299	2.125	2021/8/15	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.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.28
合計	98.28

(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

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	38	アメリカドル	4,619,402.19	505,501,182	4,628,281.44	506,472,838	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカドル	3,325,717.13	363,933,225	3,333,203.25	364,752,431	0.09
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	25	アメリカドル	4,168,100	456,115,183	4,186,718.75	458,152,633	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	17	ユーロ	1,904,613	229,163,036	1,907,910	229,559,731	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	21	ユーロ	2,828,134	340,281,083	2,843,400	342,117,888	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	42	ユーロ	7,326,498	881,524,239	7,416,360	892,336,435	0.22

(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	13,490,000.00	1,485,401,276	1,474,726,800	0.36
	カナダドル	買建	1,400,000.00	115,972,260	114,226,000	0.03
	ユーロ	買建	8,750,000.00	1,050,334,098	1,052,800,000	0.25
	イギリスポンド	買建	1,400,000.00	199,683,011	197,442,000	0.05

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

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

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	232,040,771,244	61.87
	イギリス	20,395,206,963	5.44
	スイス	13,935,176,785	3.72
	カナダ	13,830,219,439	3.69
	フランス	13,360,410,517	3.56
	ドイツ	11,160,342,068	2.98
	オーストラリア	8,074,183,640	2.15
	オランダ	6,973,665,065	1.86
	アイルランド	6,702,428,011	1.79
	スペイン	3,742,251,070	1.00
	香港	3,257,395,204	0.87
	スウェーデン	3,249,864,075	0.87
	イタリア	2,616,416,318	0.70
	デンマーク	2,561,845,950	0.68
	シンガポール	1,532,010,778	0.41
	フィンランド	1,520,034,532	0.41
	バミューダ	1,365,435,482	0.36
	ベルギー	1,189,923,208	0.32
	ジャージー	909,214,230	0.24
	ケイマン	816,012,145	0.22
	イスラエル	793,391,274	0.21
	ノルウェー	771,459,252	0.21
	ニュージーランド	380,701,125	0.10
	キュラソー	361,328,064	0.10
	ルクセンブルク	340,109,849	0.09
	オーストリア	268,044,017	0.07
	ポルトガル	227,307,294	0.06
	リベリア	128,843,648	0.03
	パナマ	122,426,246	0.03
	マン島	48,745,038	0.01
	パプアニューギニア	48,536,197	0.01
	英ヴァージン諸島	31,134,813	0.01
	小計	352,754,833,541	94.06
投資信託受益証券	オーストラリア	189,434,149	0.05
	香港	86,720,236	0.02
	小計	276,154,385	0.07

投資証券	アメリカ	8,325,407,043	2.22
	オーストラリア	628,117,314	0.17
	フランス	385,028,487	0.10
	イギリス	242,229,433	0.06
	シンガポール	194,675,516	0.05
	香港	186,619,329	0.05
	カナダ	110,166,594	0.03
	小計	10,072,243,716	2.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	11,912,281,247	3.18
合計(純資産総額)		375,015,512,889	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	8,105,517,853	2.16
	買建	カナダ	486,992,496	0.13
	買建	ドイツ	1,858,766,527	0.50
	買建	イギリス	756,147,812	0.20
	買建	オーストラリア	464,056,164	0.12

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	781,343,860	0.21

(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	395,946	19,628.45	7,771,809,867	29,931.29	11,851,175,976	3.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	635,320	13,860.40	8,805,791,742	17,309.63	10,997,158,833	2.93
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,824	200,422.16	7,380,345,756	206,198.94	7,593,070,098	2.02
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	210,848	20,137.22	4,245,893,951	20,764.34	4,378,120,087	1.17
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,312	124,466.77	3,399,436,595	144,238.58	3,939,444,335	1.05
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	26,286	125,051.66	3,287,108,154	143,894.97	3,782,423,405	1.01
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	279,555	11,900.51	3,326,847,772	13,281.51	3,712,915,072	0.99
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	230,855	14,956.89	3,452,873,395	15,223.90	3,514,513,804	0.94
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	259,686	11,215.82	2,912,593,718	11,502.95	2,987,155,178	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	150,915	17,972.78	2,712,362,576	19,698.49	2,972,798,267	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	220,272	11,539.20	2,541,764,414	12,420.30	2,735,845,423	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	115,181	21,893.47	2,521,712,171	22,725.32	2,617,526,016	0.70
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	641,062	3,519.39	2,256,151,223	3,909.93	2,506,510,046	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	78,756	27,830.23	2,191,798,192	31,277.28	2,463,273,668	0.66
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	772,510	3,056.37	2,361,084,037	3,187.69	2,462,526,960	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	387,248	4,795.22	1,856,940,362	6,109.47	2,365,882,711	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	95,470	21,075.12	2,012,042,059	24,592.20	2,347,817,706	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	82,721	26,371.53	2,181,479,805	27,786.46	2,298,524,221	0.61
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	61,860	30,469.94	1,884,870,913	36,449.74	2,254,781,411	0.60
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	363,367	6,427.89	2,335,684,769	6,025.21	2,189,364,590	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	356,211	5,403.12	1,924,651,102	6,010.98	2,141,180,723	0.57
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	158,140	14,508.56	2,294,385,199	12,917.11	2,042,712,914	0.54
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	371,576	7,929.88	2,946,553,687	5,451.80	2,025,759,003	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	223,750	8,802.54	1,969,570,384	8,544.29	1,911,785,872	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	123,268	14,010.27	1,727,018,198	14,922.96	1,839,524,555	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	189,231	9,991.54	1,890,710,998	9,614.05	1,819,276,674	0.49

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	482,431	4,546.81	2,193,525,231	3,731.56	1,800,221,670	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	398,164	4,658.46	1,854,831,484	4,492.10	1,788,593,102	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	167,394	12,940.77	2,166,207,541	10,300.64	1,724,266,320	0.46
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	365,317	5,004.23	1,828,131,715	4,647.49	1,697,807,871	0.45

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	4.35
		素材	3.98
		資本財	6.70
		商業・専門サービス	1.24
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.08
		耐久消費財・アパレル	1.79
		消費者サービス	1.65
		メディア・娯楽	5.94
		小売	4.78
		食品・生活必需品小売り	1.47
		食品・飲料・タバコ	4.71
		家庭用品・パーソナル用品	2.03
		ヘルスケア機器・サービス	4.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.23
		銀行	7.18
		各種金融	4.31
		保険	3.71
		不動産	0.53
		ソフトウェア・サービス	9.98
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.61
		電気通信サービス	2.28
		公益事業	3.73
		半導体・半導体製造装置	3.26
		小計	94.06
投資信託受益証券	—	—	0.07
投資証券	—	—	2.69
合計			96.82

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	501	アメリカドル	81,711,414.5	8,941,680,088	74,070,345	8,105,517,853	2.16
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	30	カナダドル	6,204,835	506,810,923	5,962,200	486,992,496	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	42	スイスフラン	4,489,004	507,437,012	4,263,840	481,984,473	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	331	ユーロ	12,418,369.5	1,494,178,218	11,442,670	1,376,782,054	0.37
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	39	オーストラリアドル	6,652,123	478,553,729	6,450,600	464,056,164	0.12
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	79	イギリスポンド	5,890,726.25	831,240,380	5,358,570	756,147,812	0.20

(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	4,920,000.00	542,478,000	538,295,000	0.14
	カナダドル	買建	476,000.00	39,366,628	38,870,160	0.01
	ユーロ	買建	1,000,000.00	120,216,000	120,320,000	0.03
	イギリスポンド	買建	350,000.00	49,858,550	49,381,500	0.01
	スイスフラン	買建	305,000.00	34,511,360	34,477,200	0.01

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

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

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	5,763,967,613	9.77
	インドネシア	5,758,001,800	9.76
	ブラジル	5,737,299,509	9.73
	タイ	5,733,718,585	9.72
	ポーランド	5,324,004,026	9.03
	南アフリカ	5,262,066,497	8.92
	ロシア	5,038,921,715	8.54
	マレーシア	3,747,095,384	6.35
	コロンビア	3,461,803,176	5.87
	チェコ	2,467,072,548	4.18
	ペルー	2,202,002,915	3.73
	ハンガリー	2,147,753,784	3.64
	トルコ	1,865,934,099	3.16
	チリ	1,474,197,820	2.50
	フィリピン	111,811,878	0.19
	ドミニカ共和国	94,024,555	0.16
	ウルグアイ	88,841,219	0.15
	小計	56,278,517,123	95.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,698,933,318	4.58
合計(純資産総額)		58,977,450,441	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(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	66,300,000,000	3.91	2,598,420,383	3.95	2,620,234,609	9.850	2027/6/28	4.44
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	48,550,000	1,982.74	962,622,939	2,028.56	984,869,665	0.000	2023/7/1	1.67
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	35,100,000	2,726.39	956,963,313	2,723.59	955,981,570	10.000	2023/1/1	1.62
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	109,850,000	782.76	859,862,407	802.54	881,600,110	10.500	2026/12/21	1.49
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	422.67	744,337,657	449.54	791,646,464	3.400	2036/6/17	1.34
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.06	723,705,325	3.07	727,346,763	4.375	2023/3/21	1.23
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	24,450,000	2,824.33	690,548,758	2,816.08	688,532,603	10.000	2025/1/1	1.17
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	112,900,000	588.07	663,931,600	589.53	665,585,229	8.000	2023/12/7	1.13
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	22,150,000	2,900.66	642,498,116	2,888.24	639,746,196	10.000	2027/1/1	1.08
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	2,188.23	624,740,097	2,237.69	638,862,543	0.000	2022/1/1	1.08

ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	20,050,000	3,017.84	605,078,482	3,031.77	607,870,360	4.000	2023/10/25	1.03
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000	2,856.87	604,229,006	2,865.30	606,012,478	2.500	2023/1/25	1.03
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	416.72	570,500,516	438.17	599,865,299	3.650	2031/6/20	1.02
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000	2,126.70	585,907,798	2,171.51	598,253,511	0.000	2022/7/1	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	93,300,000	624.72	582,869,427	629.76	587,568,496	8.500	2037/1/31	1.00
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	83,400,000	653.41	544,944,968	668.49	557,523,788	8.000	2030/1/31	0.95
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	617.34	551,285,085	621.99	555,442,955	8.750	2048/2/28	0.94
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000	584.05	538,209,908	590.60	544,238,066	7.500	2027/6/3	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	116,000,000	444.67	515,819,317	463.59	537,774,770	4.875	2029/6/22	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	641.19	527,384,565	642.14	528,165,759	10.000	2024/12/5	0.90
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	22,550,000	2,260.75	509,799,606	2,299.55	518,549,764	0.000	2021/7/1	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	81,800,000	627.03	512,911,347	632.75	517,596,543	8.500	2029/5/31	0.88
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	111,800,000	426.48	476,808,536	453.11	506,583,766	3.300	2038/6/17	0.86
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	58,800,000,000	0.83	492,535,789	0.85	501,892,045	8.375	2024/3/15	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000	2,862.30	470,848,590	2,924.07	481,009,559	2.500	2026/7/25	0.82
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000	2,860.99	467,773,250	2,936.77	480,162,658	2.500	2027/7/25	0.81
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000	568.99	468,848,614	569.50	469,272,540	7.250	2021/12/9	0.80
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	69,400,000	657.73	456,469,884	666.06	462,249,186	8.875	2035/2/28	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	561.01	455,540,835	561.76	456,150,054	6.500	2022/6/9	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	79,150,000	560.98	444,022,319	561.60	444,513,848	6.500	2021/6/10	0.75

(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	95.42
合計	95.42

(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。

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	12,647,515,062	19.07
	中国	8,452,269,672	12.74
	台湾	7,431,411,031	11.21
	韓国	7,372,730,983	11.12
	インド	5,815,667,573	8.77
	ブラジル	3,996,559,215	6.03
	南アフリカ	2,598,233,400	3.92
	ロシア	2,388,394,493	3.60
	香港	1,891,891,346	2.85
	サウジアラビア	1,603,439,426	2.42
	タイ	1,473,015,267	2.22
	メキシコ	1,378,175,767	2.08
	インドネシア	1,171,130,524	1.77
	マレーシア	1,155,502,666	1.74
	カタール	583,239,198	0.88
	フィリピン	573,764,513	0.87
	バミューダ	562,238,943	0.85
	ポーランド	487,719,425	0.74
	チリ	421,473,325	0.64
	アラブ首長国連邦	397,115,761	0.60
	トルコ	301,871,051	0.46
	コロンビア	213,064,878	0.32
	アメリカ	198,076,031	0.30
	ハンガリー	181,475,581	0.27
	ギリシャ	154,470,861	0.23
	チェコ	91,517,922	0.14
	エジプト	82,844,548	0.12
	アルゼンチン	66,901,946	0.10
	ルクセンブルク	64,980,336	0.10
	ジャージー	48,772,060	0.07
	シンガポール	32,420,115	0.05
	マン島	26,507,643	0.04
	ペルー	22,843,173	0.03
	パキスタン	21,343,336	0.03
	スペイン	8,570,260	0.01
	小計	63,917,147,331	96.38

新株予約権証券	タイ	134,046	0.00
投資信託受益証券	ブラジル	165,626,406	0.25
	メキシコ	36,979,195	0.06
	小計	202,605,601	0.31
投資証券	南アフリカ	82,385,652	0.12
	メキシコ	50,800,326	0.08
	小計	133,185,978	0.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,068,093,643	3.12
合計(純資産総額)		66,321,166,599	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	2,055,097,588	3.10

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	―	373,510,632	0.56
	売建	―	55,555,819	△0.08

(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	175,717	20,844.95	3,662,812,425	22,436.43	3,942,462,680	5.94
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	579,300	4,658.44	2,698,635,140	5,604.76	3,246,842,102	4.90
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,490,389	1,109.45	2,762,965,371	1,140.76	2,840,936,156	4.28

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	482,085	4,742.52	2,286,299,485	5,047.76	2,433,454,200	3.67
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,664,620	90.97	879,246,076	90.41	873,851,745	1.32
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	44,706	15,329.52	685,321,815	17,791.19	795,373,387	1.20
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	573,000	1,324.15	758,743,138	1,240.43	710,768,682	1.07
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	287,855	2,227.00	641,055,851	2,134.82	614,520,050	0.93
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	165,864	3,447.45	571,808,559	3,499.18	580,389,318	0.88
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	620,000	903.44	560,138,938	890.13	551,884,320	0.83
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,600,515	82.17	542,427,491	76.65	505,984,919	0.76
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	55,172	7,507.89	414,225,704	8,379.83	462,332,532	0.70
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	44,045	10,373.56	456,903,776	9,958.13	438,605,836	0.66
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	269,966	1,652.50	446,121,184	1,616.82	436,488,655	0.66
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	343,971	1,095.82	376,932,160	1,197.88	412,039,077	0.62
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	565,091	895.44	506,007,955	714.35	403,677,863	0.61
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	479,851	767.40	368,238,389	793.63	380,828,468	0.57
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	500,681	877.79	439,496,754	756.86	378,948,025	0.57
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,289,200	46.42	384,860,299	44.36	367,761,963	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	28,000	13,693.15	383,408,228	13,121.75	367,409,036	0.55
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	1,265,248	327.01	413,750,635	289.88	366,773,886	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	84,303	3,894.00	328,276,671	4,293.76	361,977,271	0.55
ブラジル	株式	VALE SA	素材	318,878	1,199.48	382,488,342	1,083.28	345,437,094	0.52
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	74,199	3,654.83	271,184,864	4,202.11	311,792,508	0.47
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,422,040	85.63	293,054,550	86.94	297,516,949	0.45
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	405,653	834.53	338,532,766	730.06	296,154,761	0.45
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	89,479	3,284.86	293,926,701	3,242.46	290,132,973	0.44
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,764,000	178.64	315,132,942	156.96	276,890,141	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	422,640	727.99	307,678,223	616.30	260,476,413	0.39
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	448,872	580.83	260,720,325	563.50	252,941,347	0.38

(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	6.62
		素材	6.77

		資本財	3.04
		商業・専門サービス	0.30
		運輸	1.67
		自動車・自動車部品	2.07
		耐久消費財・アパレル	1.16
		消費者サービス	1.49
		メディア・娯楽	7.49
		小売	9.40
		食品・生活必需品小売り	1.46
		食品・飲料・タバコ	3.40
		家庭用品・パーソナル用品	1.13
		ヘルスケア機器・サービス	0.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.15
		銀行	16.36
		各種金融	2.41
		保険	3.69
		不動産	2.63
		ソフトウェア・サービス	1.89
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.73
		電気通信サービス	4.08
		公益事業	2.33
		半導体・半導体製造装置	6.18
		小計	96.38
新株予約権証券	—	—	0.00
投資信託受益証券	—	—	0.31
投資証券	—	—	0.20
合計			96.88

(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	371	アメリカドル	20,277,467	2,218,963,213	18,780,020	2,055,097,588	3.10

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

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

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	2,507,793.00	276,607,646	274,377,632	0.41
	メキシコペソ	買建	6,700,000.00	37,644,620	37,587,000	0.06
	チェココルナ	買建	900,000.00	4,280,940	4,266,000	0.01
	香港ドル	買建	500,000.00	7,017,400	7,015,000	0.01
	マレーシアリンギット	買建	1,500,000.00	39,049,500	38,985,000	0.06
	南アフリカランド	買建	1,600,000.00	11,294,400	11,280,000	0.02
	アメリカドル	売建	500,000.00	54,703,500	54,705,000	△0.08
	カタールリアル	売建	28,446.00	857,646	850,819	△0.00

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

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

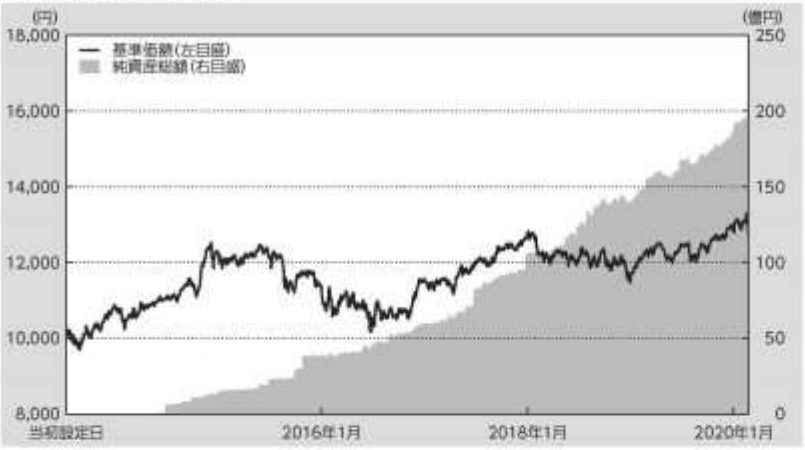
≪参考情報≫

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：2013年7月12日
作成基準日：2020年2月28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	12,730円
純資産総額	191.07億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2016年1月	0円
2017年1月	0円
2018年1月	0円
2019年1月	0円
2020年1月	0円
設定来分配金合計額	0円

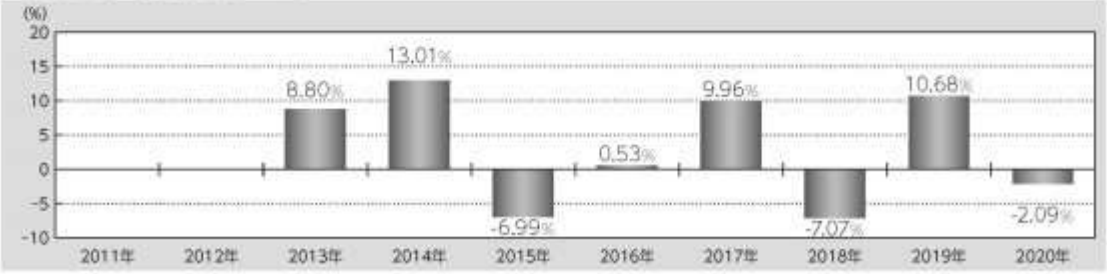
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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
外国債券インデックスマザーファンド	45.0%	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	0.3%
		T 2.75% 05/31/23	アメリカ	国債	-	2.750%	2023/05/31	0.3%
新興国債券インデックスマザーファンド	22.5%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	1.1%
		BLTN 0% 07/01/23	ブラジル	国債	-	0.000%	2023/07/01	0.4%
外国株式インデックスマザーファンド	15.6%	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	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	7.3%	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン諸島	株式	小売	-	-	0.4%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.4%
国内債券インデックスマザーファンド	6.7%	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	0.1%
国内株式インデックスマザーファンド	2.2%	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	-	-	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013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＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

＜申込受付の中止等＞
収益分配金を再投資する場合を除き、取引所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＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（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。

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

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、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

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、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

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

（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。（2013年 7月12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1月21日から翌年1月20日までとします。
ただし、第1計算期間は2013年7月12日から2014年1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5億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合
②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。
④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）①によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。
①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則とし

て取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

(1)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7期計算期間(2019年1月22日から2020年1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】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2019年 1月21日現在）	第7期 （2020年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	147,637,168	157,202,269
親投資信託受益証券	14,240,814,453	19,147,804,607
未収入金	1,030,000	58,000,000
流動資産合計	14,389,481,621	19,363,006,876
資産合計	14,389,481,621	19,363,006,876
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,340,918	21,755,488
未払受託者報酬	2,991,363	3,827,778
未払委託者報酬	30,661,452	39,234,741
未払利息	412	63
その他未払費用	375,974	478,411
流動負債合計	37,370,119	65,296,481
負債合計	37,370,119	65,296,481
純資産の部		
元本等		
元本	12,057,134,525	14,690,236,327
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,294,976,977	4,607,474,068
（分配準備積立金）	1,178,751,366	1,733,657,493
元本等合計	14,352,111,502	19,297,710,395
純資産合計	14,352,111,502	19,297,710,395
負債純資産合計	14,389,481,621	19,363,006,876

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自　2018年 1月23日 至　2019年 1月21日	第7期 自　2019年 1月22日 至　2020年 1月20日
営業収益		
受取利息	18	67
有価証券売買等損益	△717,275,336	1,746,930,154
営業収益合計	△717,275,318	1,746,930,221
営業費用		
支払利息	105,803	88,068
受託者報酬	5,388,713	7,182,314
委託者報酬	55,234,266	73,618,678
その他費用	682,005	898,554
営業費用合計	61,410,787	81,787,614
営業利益又は営業損失（△）	△778,686,105	1,665,142,607
経常利益又は経常損失（△）	△778,686,105	1,665,142,607
当期純利益又は当期純損失（△）	△778,686,105	1,665,142,607
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（△）	△29,520,935	38,079,338
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,272,137,284	2,294,976,977
剰余金増加額又は欠損金減少額	921,320,837	848,848,406
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	921,320,837	848,848,406
剰余金減少額又は欠損金増加額	149,315,974	163,414,584
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	149,315,974	163,414,584
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,294,976,977	4,607,474,068

（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1月21日から翌年1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7期計算期間は2019年 1月22日から2020年 1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6期 (2019年 1月21日現在)	第7期 (2020年 1月20日現在)
１． 計算期間の末日における受益権の総数	12,057,134,525口	14,690,236,327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 1.1903円 (1万口当たり純資産額) (11,903円)	1口当たり純資産額 1.3136円 (1万口当たり純資産額) (13,136円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期
自 2018年 1月23日
至 2019年 1月21日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	316,069,516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	2,228,306,329円
分配準備積立金額	D	862,681,850円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,407,057,695円
当ファンドの期末残存口数	F	12,057,134,525口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,825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

第7期
自 2019年 1月22日
至 2020年 1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	466,995,070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	159,793,502円
収益調整金額	C	3,049,085,615円
分配準備積立金額	D	1,106,868,921円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,782,743,108円
当ファンドの期末残存口数	F	14,690,236,327口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,255円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1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7期 (2020年 1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	第6期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月21日	第7期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,326,682,100円	12,057,134,525円
期中追加設定元本額	4,302,064,238円	3,471,717,558円
期中一部解約元本額	571,611,813円	838,615,756円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第6期 (2019年 1月21日現在)	第7期 (2020年 1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	△667,913,869	1,724,066,324
合計	△667,913,869	1,724,066,324

（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	新興国株式インデックス　マザーファンド	484,087,793	1,518,099,318	
	国内株式インデックス　マザーファンド	297,717,848	483,999,905	
	外国株式インデックス　マザーファンド	1,101,331,619	3,266,219,182	
	国内債券インデックス　マザーファンド	869,987,338	1,231,989,069	
	外国債券インデックス　マザーファンド	2,883,841,213	8,269,414,678	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	2,410,307,452	4,378,082,455	
合計		8,047,273,263	19,147,804,607	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	520,046,828
国債証券	460,280,221,050
地方債証券	29,707,477,943
特殊債券	38,039,161,885
社債券	22,805,175,540
未収入金	1,458,531,900
未収利息	925,754,050
前払費用	29,955,482
流動資産合計	553,766,324,678
資産合計	553,766,324,678
負債の部	
流動負債	
未払金	1,465,516,400
未払解約金	177,297,615

	2020年 1月20日現在
項目	金額（円）
未払利息	208
流動負債合計	1,642,814,223
負債合計	1,642,814,223
純資産の部	
元本等	
元本	389,894,814,663
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	162,228,695,792
元本等合計	552,123,510,455
純資産合計	552,123,510,455
負債純資産合計	553,766,324,678

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		389,894,814,663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	101,311,000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	1.4161円
	(1万口当たり純資産額)	(14,161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 1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。
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 1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。

	2020年 1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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	307,793,237,795円
期中追加設定元本額	97,749,611,981円
期中一部解約元本額	15,648,035,113円
期末元本額	389,894,814,663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）	3,839,285,767円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	12,650,875円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	17,332,710,246円
世界経済インデックスファンド	1,869,306,614円
ＤＣマイセレクション２５	21,252,199,623円
ＤＣマイセレクション５０	23,168,740,519円
ＤＣマイセレクション７５	6,371,777,295円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	459,542,355円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	88,509,223,009円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,916,948,989円
ＤＣマイセレクションＳ２５	8,655,291,479円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,475,068,222円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,838,727,821円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,112,558,453円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,346,065,005円

区分	2020年 1月20日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	453,822,866円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,486,762,850円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	68,546,638円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,496,023円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	44,435,718円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	14,180,873円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	936,306円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	161,716,625円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	231,587,330円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	61,254,888円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	117,574,514円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,111,739,738円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	930,509,324円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,513,182,848円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	820,044,231円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	95,005,916円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,211,878,840円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	27,776,710円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,383,977,068円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,776,688,251円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	161,330,595円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	6,620,204,076円
日本債券ファンド・シリーズ１	10,724,567,598円
分散投資コア戦略ファンドＡ	11,833,697,737円
分散投資コア戦略ファンドＳ	10,615,265,979円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	76,270,900円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	869,987,338円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,244,957円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,734,181円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	58,227,470円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	13,513,452円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	12,930,591円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	29,226,361円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,650,006円
グローバル経済コア	222,955,829円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,272,440円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,284,127円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	18,784円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	14,886円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	10,633円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	7,089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）	76,881,958,565円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 1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	△4,895,770,250
地方債証券	△168,689,356
特殊債券	△292,534,368
社債券	△78,522,670
合計	△5,435,516,644

(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３９７回利付国債（２年）	1,170,000,000	1,172,772,900	
	第３９８回利付国債（２年）	3,460,000,000	3,468,788,400	
	第３９９回利付国債（２年）	3,100,000,000	3,108,494,000	
	第４００回利付国債（２年）	630,000,000	631,845,900	
	第４０１回利付国債（２年）	3,060,000,000	3,069,577,800	
	第４０２回利付国債（２年）	620,000,000	622,058,400	
	第４０３回利付国債（２年）	3,770,000,000	3,783,232,700	
	第４０４回利付国債（２年）	360,000,000	361,335,600	
	第４０５回利付国債（２年）	160,000,000	160,624,000	
	第４０６回利付国債（２年）	780,000,000	783,190,200	
	第４０７回利付国債（２年）	140,000,000	140,599,200	
	第１２７回利付国債（５年）	4,780,000,000	4,792,714,800	
	第１２８回利付国債（５年）	1,610,000,000	1,615,232,500	

第１２９回利付国債（５年）	3,340,000,000	3,352,792,200	
第１３０回利付国債（５年）	3,160,000,000	3,173,904,000	
第１３１回利付国債（５年）	5,040,000,000	5,065,603,200	
第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	4,797,093,600	
第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,407,506,400	
第１３４回利付国債（５年）	6,050,000,000	6,090,656,000	
第１３５回利付国債（５年）	5,180,000,000	5,216,933,400	
第１３６回利付国債（５年）	5,500,000,000	5,542,350,000	
第１３７回利付国債（５年）	6,830,000,000	6,885,254,700	
第１３８回利付国債（５年）	9,710,000,000	9,791,952,400	
第１３９回利付国債（５年）	4,940,000,000	4,984,361,200	
第１４０回利付国債（５年）	7,340,000,000	7,408,262,000	
第１４１回利付国債（５年）	6,020,000,000	6,077,792,000	
第１４２回利付国債（５年）	560,000,000	565,527,200	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	607,072,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,667,665,300	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	817,531,000	
第４回利付国債（４０年）	1,000,000,000	1,500,780,000	
第５回利付国債（４０年）	890,000,000	1,293,899,800	
第６回利付国債（４０年）	1,620,000,000	2,324,586,600	
第７回利付国債（４０年）	830,000,000	1,147,367,100	
第８回利付国債（４０年）	800,000,000	1,035,416,000	
第９回利付国債（４０年）	1,170,000,000	1,135,906,200	
第１０回利付国債（４０年）	1,920,000,000	2,184,614,400	
第１１回利付国債（４０年）	1,940,000,000	2,143,661,200	
第１２回利付国債（４０年）	950,000,000	950,000,000	
第３１３回利付国債（１０年）	1,350,000,000	1,372,315,500	
第３１４回利付国債（１０年）	470,000,000	476,678,700	
第３１５回利付国債（１０年）	3,140,000,000	3,198,780,800	
第３１６回利付国債（１０年）	1,170,000,000	1,190,252,700	
第３１７回利付国債（１０年）	890,000,000	908,164,900	
第３１８回利付国債（１０年）	1,960,000,000	1,996,730,400	
第３１９回利付国債（１０年）	1,710,000,000	1,750,150,800	
第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	4,668,529,200	
第３２１回利付国債（１０年）	2,470,000,000	2,530,416,200	
第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	766,717,500	
第３２３回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,978,076,300	
第３２４回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,801,622,600	
第３２５回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,992,153,200	
第３２６回利付国債（１０年）	1,520,000,000	1,556,647,200	
第３２７回利付国債（１０年）	1,610,000,000	1,653,518,300	
第３２８回利付国債（１０年）	2,770,000,000	2,833,239,100	

第３２９回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,320,875,000	
第３３０回利付国債（１０年）	1,690,000,000	1,746,868,500	
第３３１回利付国債（１０年）	1,380,000,000	1,416,294,000	
第３３２回利付国債（１０年）	3,250,000,000	3,341,292,500	
第３３３回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,399,107,800	
第３３４回利付国債（１０年）	2,790,000,000	2,877,801,300	
第３３５回利付国債（１０年）	3,620,000,000	3,723,495,800	
第３３６回利付国債（１０年）	510,000,000	525,361,200	
第３３７回利付国債（１０年）	3,380,000,000	3,448,411,200	
第３３８回利付国債（１０年）	3,150,000,000	3,232,498,500	
第３３９回利付国債（１０年）	5,890,000,000	6,051,857,200	
第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	6,501,763,200	
第３４１回利付国債（１０年）	3,430,000,000	3,512,628,700	
第３４２回利付国債（１０年）	6,460,000,000	6,540,039,400	
第３４３回利付国債（１０年）	2,850,000,000	2,885,824,500	
第３４４回利付国債（１０年）	4,960,000,000	5,024,827,200	
第３４５回利付国債（１０年）	2,290,000,000	2,320,250,900	
第３４６回利付国債（１０年）	3,470,000,000	3,516,220,400	
第３４７回利付国債（１０年）	1,670,000,000	1,692,394,700	
第３４８回利付国債（１０年）	4,580,000,000	4,641,738,400	
第３４９回利付国債（１０年）	3,090,000,000	3,131,776,800	
第３５０回利付国債（１０年）	6,550,000,000	6,635,870,500	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	3,590,000,000	3,635,449,400	
第３５２回利付国債（１０年）	4,890,000,000	4,949,511,300	
第３５３回利付国債（１０年）	4,490,000,000	4,542,128,900	
第３５４回利付国債（１０年）	3,940,000,000	3,983,379,400	
第３５５回利付国債（１０年）	6,250,000,000	6,314,750,000	
第３５６回利付国債（１０年）	3,210,000,000	3,241,008,600	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	139,626,300	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	198,515,200	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	148,192,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	144,002,100	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	62,106,500	
第６回利付国債（３０年）	190,000,000	242,082,800	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	228,772,800	
第８回利付国債（３０年）	100,000,000	121,621,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	279,772,800	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	180,545,600	
第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	108,839,700	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	240,570,400	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	364,103,700	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	394,677,000	

第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	453,345,800	
第１６回利付国債（３０年）	370,000,000	495,104,400	
第１７回利付国債（３０年）	570,000,000	757,062,600	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	454,264,950	
第１９回利付国債（３０年）	380,000,000	501,926,800	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	650,131,200	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	663,970,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	545,288,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	588,080,900	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	520,934,400	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	469,469,000	
第２６回利付国債（３０年）	530,000,000	721,637,400	
第２７回利付国債（３０年）	1,010,000,000	1,400,334,700	
第２８回利付国債（３０年）	1,640,000,000	2,286,914,400	
第２９回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,936,704,000	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,428,953,300	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,494,999,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,700,000,000	2,355,265,000	
第３３回利付国債（３０年）	1,760,000,000	2,346,713,600	
第３４回利付国債（３０年）	1,555,000,000	2,144,951,450	
第３５回利付国債（３０年）	2,120,000,000	2,850,191,600	
第３６回利付国債（３０年）	1,980,000,000	2,673,811,800	
第３７回利付国債（３０年）	1,830,000,000	2,443,544,100	
第３８回利付国債（３０年）	1,250,000,000	1,647,100,000	
第３９回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,611,180,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,290,000,000	1,706,218,500	
第４１回利付国債（３０年）	980,000,000	1,276,146,200	
第４２回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,903,285,200	
第４３回利付国債（３０年）	930,000,000	1,213,715,100	
第４４回利付国債（３０年）	1,080,000,000	1,412,607,600	
第４５回利付国債（３０年）	1,210,000,000	1,527,092,600	
第４６回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,945,004,600	
第４７回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,933,020,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,710,000,000	2,122,794,000	
第４９回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,815,568,400	
第５０回利付国債（３０年）	1,070,000,000	1,172,741,400	
第５１回利付国債（３０年）	1,840,000,000	1,787,504,800	
第５２回利付国債（３０年）	1,600,000,000	1,632,640,000	
第５３回利付国債（３０年）	1,120,000,000	1,170,153,600	
第５４回利付国債（３０年）	1,850,000,000	2,026,305,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,139,944,000	
第５６回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,380,367,800	
第５７回利付国債（３０年）	1,360,000,000	1,489,104,800	

第５８回利付国債（３０年）	1,620,000,000	1,772,766,000	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	181,619,500	
第６０回利付国債（３０年）	2,530,000,000	2,837,040,800	
第６１回利付国債（３０年）	1,300,000,000	1,386,684,000	
第６２回利付国債（３０年）	280,000,000	283,606,400	
第６３回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,319,163,000	
第６４回利付国債（３０年）	1,570,000,000	1,543,388,500	
第４９回利付国債（２０年）	140,000,000	143,640,000	
第５０回利付国債（２０年）	220,000,000	225,207,400	
第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	103,016,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	114,094,200	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	83,420,000	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	208,932,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	146,463,800	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	157,726,500	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	251,781,600	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	316,230,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	210,668,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	365,599,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	248,522,400	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	330,080,000	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	213,150,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	343,718,400	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	237,373,400	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	354,763,200	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	140,887,500	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	208,293,200	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	425,919,000	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	444,400,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	220,428,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	695,091,600	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	397,418,400	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	221,774,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	144,830,400	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	298,001,700	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	321,578,100	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	188,496,000	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	300,844,800	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	246,329,600	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	436,644,000	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	675,174,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	327,943,600	

第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	528,698,300	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	329,434,200	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	241,157,700	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	628,193,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	484,881,600	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	401,810,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	726,950,700	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	522,265,500	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	1,013,689,600	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	471,401,600	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	705,745,600	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	717,963,900	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,847,707,200	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	469,952,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	513,559,200	
第９９回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,348,007,000	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	568,708,800	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	858,858,000	
第１０２回利付国債（２０年）	410,000,000	494,632,200	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	479,192,000	
第１０４回利付国債（２０年）	360,000,000	425,196,000	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,398,901,800	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	453,796,000	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	309,488,400	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	773,823,600	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	611,608,400	
第１１０回利付国債（２０年）	950,000,000	1,134,794,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,171,924,900	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	947,012,500	
第１１３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,744,234,000	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,813,614,800	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	852,222,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,560,000,000	1,905,742,800	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,308,409,200	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	795,352,800	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	627,684,300	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,826,757,800	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,797,180,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,116,250,000	
第１２３回利付国債（２０年）	830,000,000	1,015,762,300	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	739,899,500	
第１２５回利付国債（２０年）	820,000,000	1,015,635,600	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	887,964,700	

第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,229,395,800	
第１２８回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,523,604,600	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,066,104,300	
第１３０回利付国債（２０年）	1,115,000,000	1,338,925,450	
第１３１回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,224,927,500	
第１３２回利付国債（２０年）	840,000,000	1,001,750,400	
第１３３回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,433,200,300	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,364,859,200	
第１３５回利付国債（２０年）	590,000,000	705,516,100	
第１３６回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,740,097,800	
第１３７回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,342,140,800	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	727,743,600	
第１３９回利付国債（２０年）	550,000,000	652,333,000	
第１４０回利付国債（２０年）	1,840,000,000	2,210,888,800	
第１４１回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,901,543,600	
第１４２回利付国債（２０年）	540,000,000	657,023,400	
第１４３回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,348,395,100	
第１４４回利付国債（２０年）	1,780,000,000	2,100,916,200	
第１４５回利付国債（２０年）	2,155,000,000	2,606,106,150	
第１４６回利付国債（２０年）	2,440,000,000	2,958,231,600	
第１４７回利付国債（２０年）	2,390,000,000	2,870,079,300	
第１４８回利付国債（２０年）	2,680,000,000	3,188,235,200	
第１４９回利付国債（２０年）	3,270,000,000	3,895,452,900	
第１５０回利付国債（２０年）	2,270,000,000	2,675,172,300	
第１５１回利付国債（２０年）	1,395,000,000	1,606,300,650	
第１５２回利付国債（２０年）	2,750,000,000	3,168,577,500	
第１５３回利付国債（２０年）	2,650,000,000	3,097,373,000	
第１５４回利付国債（２０年）	1,980,000,000	2,285,910,000	
第１５５回利付国債（２０年）	2,160,000,000	2,428,336,800	
第１５６回利付国債（２０年）	1,960,000,000	2,018,192,400	
第１５７回利付国債（２０年）	2,910,000,000	2,900,775,300	
第１５８回利付国債（２０年）	2,110,000,000	2,203,177,600	
第１５９回利付国債（２０年）	2,070,000,000	2,194,676,100	
第１６０回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,508,687,700	
第１６１回利付国債（２０年）	1,750,000,000	1,853,740,000	
第１６２回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,169,535,500	
第１６３回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,550,237,900	
第１６４回利付国債（２０年）	1,720,000,000	1,788,473,200	
第１６５回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,704,648,800	
第１６６回利付国債（２０年）	900,000,000	967,041,000	
第１６７回利付国債（２０年）	2,450,000,000	2,542,242,500	
第１６８回利付国債（２０年）	1,780,000,000	1,812,235,800	

	第１６９回利付国債（２０年）	1,070,000,000	1,068,031,200	
	第１７０回利付国債（２０年）	1,900,000,000	1,894,718,000	
国債証券合計		422,250,000,000	460,280,221,050	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	109,374,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	110,206,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	137,028,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	135,332,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	130,740,000	
	第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	130,284,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	117,695,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	118,828,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	237,292,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	236,822,000	
	第６９５回東京都公募公債	100,000,000	101,383,000	
	第６９６回東京都公募公債	100,000,000	101,668,000	
	第７００回東京都公募公債	100,000,000	101,680,000	
	第７０２回東京都公募公債	200,000,000	203,960,000	
	第７１６回東京都公募公債	100,000,000	102,227,000	
	第７１７回東京都公募公債	100,000,000	101,972,000	
	第７２０回東京都公募公債	100,000,000	102,950,000	
	第７２８回東京都公募公債	100,000,000	102,521,000	
	第７５１回東京都公募公債	100,000,000	102,067,000	
	第７６４回東京都公募公債	150,000,000	151,809,000	
	第７６５回東京都公募公債	100,000,000	101,213,000	
	第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,997,000	
	第７８１回東京都公募公債	300,000,000	302,130,000	
	平成２３年度第６回北海道公募公債	200,000,000	203,542,000	
	平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	102,453,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	101,095,000	
	平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,236,000	
	平成２８年度第１４回北海道公募公債	300,000,000	303,816,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	140,101,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	118,234,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	115,987,000	
	第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	204,374,000	
	第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	101,033,000	
	第２２６回神奈川県公募公債	200,000,000	202,212,000	
	第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,997,000	
	第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	237,706,000	
	第３４９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,739,000	
	第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,226,000	
	第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,873,000	

第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,988,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,502,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	154,257,070	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,820,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,735,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,466,440	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,426,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	119,787,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	118,508,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	102,908,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,881,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	100,185,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	104,892,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	104,847,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	117,614,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	102,797,000	
第４回兵庫県公募公債（１２年）	200,000,000	208,938,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	109,030,000	
平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	400,000,000	407,648,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	102,910,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	102,216,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	103,840,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	300,216,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	124,255,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	107,410,000	
平成２３年度第３回静岡県公募公債	103,290,000	104,935,409	
平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,796,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	102,128,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	101,070,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,218,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	101,258,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	120,226,000	
平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,743,000	
平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,626,000	
平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,860,000	
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,015,000	
	100,000,000	102,816,000	

平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）			
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,133,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,448,000	
平成２８年度第１３回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,230,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,546,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	314,205,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,945,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	106,353,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	119,463,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	102,295,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	128,564,874	
平成２９年度第１回広島県公募公債	200,000,000	201,902,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,542,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,587,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	110,602,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	238,084,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	200,552,000	
平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	193,000,000	195,705,860	
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,362,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	102,539,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,711,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	102,659,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,333,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,479,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	101,072,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	117,602,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	117,341,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	109,619,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	120,507,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債	200,000,000	203,370,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	109,918,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	135,179,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,370,000	

平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,629,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	106,353,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,132,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	119,742,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,573,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	102,997,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	102,083,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	102,820,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,333,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	320,000,000	323,132,800	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	101,161,000	
第９５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,402,000	
第９７回共同発行市場公募地方債	356,000,000	362,137,440	
第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,576,000	
第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,574,000	
第１０５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,050,000	
第１０７回共同発行市場公募地方債	800,000,000	816,872,000	
第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,185,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,360,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,071,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,093,000	
第１１３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,964,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,085,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,916,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,925,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,535,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,513,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,052,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,190,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,727,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,569,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,417,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,056,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,682,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,077,982	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,780,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,460,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,300,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,672,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,194,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,820,000	

第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,068,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,979,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,451,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,072,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,710,618	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,236,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,709,000	
平成２３年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	101,759,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	204,390,000	
平成２９年度第１回熊本県公募公債（５年）	100,000,000	100,010,000	
平成２３年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	101,918,000	
平成２３年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,918,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,288,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	239,888,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	301,953,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	105,476,000	
平成２９年度第１回大阪市公募公債（５年）	100,000,000	100,009,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	133,424,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	139,322,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	117,518,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	129,387,000	
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	102,151,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,324,000	
平成２３年度第４回京都市公募公債	100,000,000	102,037,000	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	102,187,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	102,569,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	300,000,000	302,940,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	139,234,800	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	238,344,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	120,880,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	111,628,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	119,084,000	
平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	102,032,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,943,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	202,834,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	101,024,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	203,450,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	110,236,000	
	100,000,000	102,314,000	

	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）			
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,084,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	117,929,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,826,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,171,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,648,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	200,000,000	200,416,000	
	平成２８年度第４回北九州市公募公債	145,000,000	146,096,200	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	119,298,000	
	平成２３年度第６回福岡市公募公債	100,000,000	101,759,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	205,084,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,733,000	
	平成２２年度第６回広島市公募公債	100,000,000	101,636,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	154,077,000	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,218,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,906,150	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	172,259,300	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	200,000,000	203,892,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	203,114,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	116,634,000	
地方債証券合計		28,214,220,000	29,707,477,943	
特殊債券	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,576,000	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,183,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,595,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,690,000	
	第７５回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,799,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,961,000	
	第６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,172,000	
	第９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,644,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	105,523,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	104,444,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	132,020,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	269,034,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	273,262,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,431,000	

第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	158,403,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,165,000	
第４２回道路債券	100,000,000	111,093,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,785,000	
第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,953,000	
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,861,000	
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	150,184,000	
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	238,856,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,841,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,212,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,233,000	
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	135,290,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,649,000	
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	121,302,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,652,000	
第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,746,000	
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	101,784,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,239,000	
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	305,697,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,566,000	
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	306,655,790	
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	203,900,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	227,430,000	
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	204,370,000	
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	102,246,000	
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	102,158,000	
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	306,690,000	

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	118,563,000	
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	102,604,000	
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	307,833,000	
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	204,374,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	623,736,000	
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	203,702,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,351,000	
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	206,246,000	
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	152,515,480	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,909,000	
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	102,807,000	
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	234,208,000	
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	105,028,380	
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	102,970,000	
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	102,813,000	
第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,673,000	
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	102,400,000	
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	305,133,000	
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	113,253,000	
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	228,114,000	
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	204,164,000	
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	101,039,000	
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	97,515,000	
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	107,146,590	
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	318,082,440	
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	206,799,900	
	100,000,000	101,079,000	

第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,165,000	
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	101,179,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	527,363,200	
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	201,918,000	
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	315,300,000	
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	217,254,940	
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	101,103,000	
第２回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,181,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	385,812,000	
第３回政府保証公営企業債券（１５年）	300,000,000	309,075,000	
第３回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	101,019,000	
第３回公営企業債券（２０年）	110,000,000	113,570,600	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	109,325,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	402,600,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,124,000	
第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	135,119,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	43,732,400	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	132,943,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	238,046,000	
第１９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	115,740,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	237,672,000	
第２１回地方公共団体金融機構債券（５年）	400,000,000	400,044,000	
第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,577,620	
第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,709,930	
第２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,785,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	118,082,000	
第２９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,866,000	
第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,589,000	
第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	510,380,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,257,000	
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,586,000	
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,840,000	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,091,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,068,000	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,586,000	

	第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,049,000	
	第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,509,000	
	Ｆ７３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,411,000	
	Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	219,320,000	
	第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,354,000	
	第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,276,000	
	第８７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,328,000	
	第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,999,000	
	第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,690,000	
	第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,875,000	
	第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	253,632,990	
	第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,197,000	
	第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,172,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,551,000	
	第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,251,080	
	第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,514,000	
	Ｆ１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,989,000	
	Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,758,000	
	Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	212,412,000	
	Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,766,000	
	Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,101,000	
	第７回阪神高速道路債券	100,000,000	110,858,000	
	第１９回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,028,000	
	第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	121,486,000	
	第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,347,760	
	第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,199,000	
	第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,449,000	
	第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,724,590	
	第８１回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,983,000	
	第１２７回都市再生債券	400,000,000	399,864,000	
	第１５９回都市再生債券	200,000,000	179,182,000	
	第１６１回都市再生債券	100,000,000	98,669,000	
	第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	110,662,000	
	第３４４回東京交通債券	100,000,000	104,832,000	
	第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,700,800	
	第５９回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	510,070,000	
	第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	199,946,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,541,000	14,008,164	
	第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,989,000	14,538,907	
	第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,271,000	14,955,722	

第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	232,626,000	232,472,466	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	163,266,000	163,045,590	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,141,000	14,760,800	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,181,000	15,913,179	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	296,007,000	295,166,340	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,324,000	12,588,226	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	25,618,000	26,500,540	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,820,000	15,439,772	
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,360,000	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,452,000	13,961,830	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,720,000	16,578,626	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,412,000	13,941,505	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,650,000	16,451,436	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,066,000	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,439,000	13,637,762	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,746,000	13,946,554	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,798,000	22,296,911	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,128,000	22,708,374	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,793,000	25,749,498	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,783,000	27,606,373	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,151,000	30,265,703	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,066,000	31,178,807	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,226,000	66,736,140	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,695,000	14,190,074	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,588,000	32,450,503	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,817,000	14,330,439	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,640,000	14,303,313	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,372,000	35,545,518	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,603,000	13,069,437	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,116,000	35,299,006	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,140,000	33,157,560	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,652,000	15,417,273	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,020,000	66,738,180	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,098,000	36,121,375	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,209,000	14,859,061	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,837,000	47,397,192	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,537,000	44,953,526	

第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,725,000	45,196,641	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,058,000	95,949,635	
第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,411,000	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,878,000	102,279,573	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,872,000	52,056,892	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,843,000	52,450,785	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,632,000	53,350,938	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,405,000	46,598,162	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,410,000	46,268,558	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,155,000	52,882,930	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	180,876,000	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,904,000	140,518,704	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,084,000	190,707,617	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,486,000	53,571,183	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,053,000	55,243,558	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,955,000	56,031,188	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,802,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,238,000	176,766,627	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,165,000	60,158,896	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,118,000	124,485,080	
第９２回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	408,044,000	
第９３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,152,000	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,395,000	70,546,706	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,289,000	74,354,296	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,272,000	73,668,164	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,531,000	227,855,615	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,820,000	152,328,686	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,063,000	74,595,293	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,472,000	79,252,521	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,120,000	82,557,699	
第１１１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,310,000	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,249,000	86,934,679	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,456,000	86,956,580	
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,144,000	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,604,000	87,488,226	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,999,000	88,285,715	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,654,000	88,820,674	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,878,000	

第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,373,000	90,429,388	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,172,000	91,351,449	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,117,000	91,044,303	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,460,000	91,388,119	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,045,000	92,037,390	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,080,000	184,676,457	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,224,000	92,151,748	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,222,000	186,721,892	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,231,000	93,221,560	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,404,000	187,100,446	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,255,000	94,243,503	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,412,000	189,962,630	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,700,000	190,241,679	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	134,009,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,151,000	96,485,017	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,668,000	97,220,691	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,866,000	96,487,211	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,480,000	193,824,394	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,147,000	97,227,632	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,228,000	97,454,541	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,904,000	196,011,747	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,352,000	97,627,145	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,658,000	292,905,276	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,308,000	195,767,674	
第１６１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,547,000	
第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,542,000	
第１６９回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,464,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,191,000	

	第１９４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,932,000	
	第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	115,257,000	
	第５７回日本学生支援債券	100,000,000	99,992,000	
	第５８回日本学生支援債券	300,000,000	299,976,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	110,745,000	
	い第７９５号商工債	200,000,000	200,038,000	
	い第８００号商工債	200,000,000	200,120,000	
	い第８０２号商工債	100,000,000	100,088,000	
	い第８０４号商工債	300,000,000	300,282,000	
	い第７９５号農林債	100,000,000	99,967,000	
	い第７９６号農林債	200,000,000	199,932,000	
	第３１７回信金中金債（５年）	200,000,000	200,112,000	
	第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,278,000	
	第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,286,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,588,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,317,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,260,000	
	第２１８号商工債（３年）	300,000,000	300,360,000	
	第２２１号商工債（３年）	200,000,000	200,264,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,518,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	119,447,000	
	第３８回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,282,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,998,000	
	第３３回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	203,542,000	
	第５９回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,572,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,824,000	
	第３２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,535,000	
	第５３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,636,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,511,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,836,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,608,000	
特殊債券合計		36,193,834,000	38,039,161,885	
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	99,862,000	
	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,187,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	200,000,000	199,588,000	
	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	100,559,000	

第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,890,000	
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	100,451,000	
第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,863,000	
第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,010,000	
第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,714,000	
第９回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,772,000	
第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,964,000	
第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,878,000	
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	100,302,000	
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	208,286,000	
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	400,104,000	
第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,890,000	
第２１回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,525,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,610,000	
第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,873,000	
第７回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,206,000	
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	100,259,000	
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	102,089,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,248,000	
第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,601,000	
第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,985,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
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	99,997,000	
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	102,799,000	
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	100,015,000	
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	99,927,000	
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	101,161,000	
第１２回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,937,000	
第５７回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,504,000	
第９回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,498,000	

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	100,589,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,515,000	
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,470,000	
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	100,329,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,781,000	
第８回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,866,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,342,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,683,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,279,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,119,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,744,000	
第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,157,000	
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	99,747,000	
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	100,692,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第３６回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,224,000	
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,912,000	
第１５回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,270,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,472,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,474,000	
第１２回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,438,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,138,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,184,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,963,000	
第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,077,000	
第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,217,000	
第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,134,000	
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	100,071,000	
第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,769,000	
第１４回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,940,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,612,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,616,000	
第２７回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	99,935,000	
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	100,240,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,460,000	

第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,362,000	
第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,007,000	
第７６回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,632,000	
第５０回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,622,000	
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	99,767,000	
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	699,118,000	
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	122,330,000	
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	102,085,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	116,120,000	
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	102,266,000	
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	101,860,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,784,000	
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	306,453,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,680,000	
第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,253,000	
第２３回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第３７回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,992,000	
第２回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第６６回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	302,412,000	
第７３回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	300,852,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,495,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第１９３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,975,000	
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	199,956,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,792,000	
第４８回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,866,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,969,000	
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	99,335,000	
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	199,710,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,782,000	

第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,770,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,630,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,842,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,583,000	
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	102,860,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,335,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,869,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,074,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,376,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,010,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,754,000	
第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	102,477,000	
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,799,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,009,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	237,314,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,226,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,716,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,370,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,910,100	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,683,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,075,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,594,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,974,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	134,695,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,647,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,729,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	113,162,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,691,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	99,173,000	
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	198,030,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,081,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,169,000	
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	203,718,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	102,598,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,685,000	
第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	100,000,000	102,300,000	
第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,660,000	

	第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,019,000	
	第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,283,000	
	第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,775,000	
	第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,915,000	
	第４９６回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,182,000	
	第５０５回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,196,000	
	第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,245,000	
	第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,870,000	
	第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,776,000	
	第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,737,000	
	第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,916,000	
	第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,261,000	
	第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,283,000	
	第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,993,000	
	第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,507,000	
	第３３０回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,817,000	
	第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,907,700	
	第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,061,000	
	第４８７回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,036,000	
	第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,261,000	
	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,893,000	
	第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,592,000	
	第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,486,000	
	第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,122,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,540,000	
	第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,346,000	
	第３２０回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,756,740	
	第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,878,000	
	第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,919,000	
	第３４４回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,132,000	
	第３５１回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,947,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	109,591,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,159,000	
	第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,604,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,469,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,832,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,686,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
	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	101,062,000	
	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	201,626,000	

社債券合計	22,366,000,000	22,805,175,540	
合計		550,832,036,418	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,058,635,030
株式	326,748,299,106
派生商品評価勘定	40,089,400
未収入金	5,784,353
未収配当金	501,390,770
差入委託証拠金	96,862,600
流動資産合計	330,451,061,259
資産合計	330,451,061,259
負債の部	
流動負債	
前受金	40,101,500
未払解約金	382,011,601
未払利息	1,225
流動負債合計	422,114,326
負債合計	422,114,326
純資産の部	
元本等	
元本	203,008,903,193
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	127,020,043,740
元本等合計	330,028,946,933
純資産合計	330,028,946,933
負債純資産合計	330,451,061,259

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	203,008,903,193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 1.6257円 (1万口当たり純資産額) (16,257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 1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 1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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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 1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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	181,739,336,499円
期中追加設定元本額	51,251,961,477円
期中一部解約元本額	29,982,394,783円
期末元本額	203,008,903,193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）	559,063,044円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,997,301,248円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,277,177円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,057,166,177円
世界経済インデックスファンド	2,080,464,545円
日本株式インデックス・オープン	4,500,548,585円
ＤＣマイセレクション２５	6,748,996,395円
ＤＣマイセレクション５０	19,027,312,135円
ＤＣマイセレクション７５	17,415,606,000円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,618,766,223円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,695,869,350円
ＤＣマイセレクションＳ５０	7,744,694,552円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,072,799,228円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	6,653,644,108円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	393,934,872円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	716,156,764円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	473,266,215円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,766,417,382円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,034,612,598円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,194,356円

区分	2020年 1月20日現在
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	33,948,947円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	40,943,720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）	276,314,405円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,582,381円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	75,539,439円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	264,035,831円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	56,048,776円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	368,611,727円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,636,501,447円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	686,722,574円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,983,925,235円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	600,280,766円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	37,927,462円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	752,163,743円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	34,607,624円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	423,317,624円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	547,913,255円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	54,230,406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）	819,115,458円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	4,705,766,199円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,752,075,138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）	2,095,776,300円
分散投資コア戦略ファンドＡ	6,030,497,337円
分散投資コア戦略ファンドＳ	17,579,200,422円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	284,135,512円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	297,717,848円
コア投資戦略ファンド（切替型）	704,217,606円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,918,392円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,575,098円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	69,486,963円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	12,463,135,319円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	520,269,860円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	18,093,806円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	63,295,123円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	10,349,611円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,741,669円
グローバル経済コア	267,806,303円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,994,199円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	40,666,396円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	2,755,589円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	353,247,293円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	26,581,000円

区分	2020年 1月20日現在
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	17,365円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	19,408円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	21,791円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	23,834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）	46,634,776,372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）	556,954,250円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	14,172,784円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	37,589,090,122
合計	37,589,090,122

(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 1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	2,805,878,500	－	2,845,980,000	40,101,500
合計		2,805,878,500	－	2,845,980,000	40,101,500

(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	6,300	2,942.00	18,534,600	
日本水産	180,500	616.00	111,188,000	
マルハニチロ	26,100	2,758.00	71,983,800	
カネコ種苗	5,500	1,396.00	7,678,000	
サカタのタネ	21,500	3,565.00	76,647,500	
ホクト	13,800	1,953.00	26,951,400	
ホクリヨウ	2,800	712.00	1,993,600	
住石ホールディングス	36,500	142.00	5,183,000	
日鉄鉱業	4,100	4,975.00	20,397,500	
三井松島ホールディングス	7,000	1,212.00	8,484,000	
国際石油開発帝石	724,100	1,124.50	814,250,450	
石油資源開発	23,600	3,025.00	71,390,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,800	1,516.00	13,340,800	
ヒノキヤグループ	4,500	2,117.00	9,526,500	
ショーボンドホールディングス	25,800	4,740.00	122,292,000	
ミライト・ホールディングス	53,600	1,726.00	92,513,600	
タマホーム	8,500	1,426.00	12,121,000	
サンヨーホームズ	1,600	713.00	1,140,800	
日本アクア	7,200	600.00	4,320,000	
ファーストコーポレーション	5,500	596.00	3,278,000	
ベステラ	3,100	1,294.00	4,011,400	
ＴＡＴＥＲＵ	37,200	221.00	8,221,200	
スペースバリューホールディングス	22,000	579.00	12,738,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,500	1,185.00	4,147,500	
第一カッター興業	2,200	1,834.00	4,034,800	
明豊ファシリティワークス	4,300	799.00	3,435,700	
安藤・間	107,500	963.00	103,522,500	
東急建設	52,900	774.00	40,944,600	
コムシスホールディングス	64,000	3,265.00	208,960,000	
ビーアールホールディングス	19,700	492.00	9,692,400	
高松コンストラクショングループ	11,200	2,782.00	31,158,400	
東建コーポレーション	5,600	7,450.00	41,720,000	
ソネック	1,900	814.00	1,546,600	
ヤマウラ	7,800	935.00	7,293,000	
大成建設	139,000	4,590.00	638,010,000	
大林組	416,800	1,245.00	518,916,000	
清水建設	423,000	1,141.00	482,643,000	
飛島建設	12,000	1,465.00	17,580,000	
長谷工コーポレーション	161,400	1,468.00	236,935,200	
松井建設	16,400	787.00	12,906,800	
錢高組	1,800	4,140.00	7,452,000	
鹿島建設	327,200	1,444.00	472,476,800	

不動テトラ	10,900	1,701.00	18,540,900	
大末建設	4,800	986.00	4,732,800	
鉄建建設	9,100	2,903.00	26,417,300	
西松建設	32,100	2,501.00	80,282,100	
三井住友建設	100,700	635.00	63,944,500	
大豊建設	9,400	2,782.00	26,150,800	
前田建設工業	104,400	1,083.00	113,065,200	
佐田建設	9,000	481.00	4,329,000	
ナカノフドー建設	11,400	485.00	5,529,000	
奥村組	22,600	3,010.00	68,026,000	
東鉄工業	17,900	3,205.00	57,369,500	
イチケン	3,000	1,797.00	5,391,000	
富士ピー・エス	6,100	579.00	3,531,900	
淺沼組	4,700	4,945.00	23,241,500	
戸田建設	173,100	736.00	127,401,600	
熊谷組	19,300	3,305.00	63,786,500	
北野建設	2,500	2,606.00	6,515,000	
植木組	1,800	2,501.00	4,501,800	
矢作建設工業	18,400	826.00	15,198,400	
ピーエス三菱	13,700	727.00	9,959,900	
日本ハウスホールディングス	28,500	494.00	14,079,000	
大東建託	49,900	13,335.00	665,416,500	
新日本建設	17,700	909.00	16,089,300	
ＮＩＰＰＯ	34,500	2,625.00	90,562,500	
東亜道路工業	2,600	3,665.00	9,529,000	
前田道路	44,100	3,135.00	138,253,500	
日本道路	4,000	7,080.00	28,320,000	
東亜建設工業	13,000	1,700.00	22,100,000	
日本国土開発	24,300	621.00	15,090,300	
若築建設	7,500	1,734.00	13,005,000	
東洋建設	46,700	537.00	25,077,900	
五洋建設	165,200	690.00	113,988,000	
世紀東急工業	20,000	959.00	19,180,000	
福田組	4,800	4,955.00	23,784,000	
住友林業	105,600	1,606.00	169,593,600	
日本基礎技術	14,000	402.00	5,628,000	
巴コーポレーション	18,500	450.00	8,325,000	
大和ハウス工業	412,400	3,525.00	1,453,710,000	
ライト工業	23,900	1,559.00	37,260,100	
積水ハウス	456,000	2,422.50	1,104,660,000	
日特建設	10,900	863.00	9,406,700	
北陸電気工事	7,200	1,159.00	8,344,800	

ユアテック	23,800	696.00	16,564,800	
四電工	2,300	2,889.00	6,644,700	
中電工	16,800	2,500.00	42,000,000	
関電工	59,300	1,043.00	61,849,900	
きんでん	99,000	1,703.00	168,597,000	
東京エネシス	13,800	906.00	12,502,800	
トーエネック	4,200	3,820.00	16,044,000	
住友電設	11,800	2,804.00	33,087,200	
日本電設工業	22,900	2,239.00	51,273,100	
協和エクシオ	63,200	2,828.00	178,729,600	
新日本空調	11,000	2,115.00	23,265,000	
九電工	29,200	3,285.00	95,922,000	
三機工業	30,000	1,543.00	46,290,000	
日揮ホールディングス	128,300	1,688.00	216,570,400	
中外炉工業	4,500	1,800.00	8,100,000	
ヤマト	13,300	833.00	11,078,900	
太平電業	10,100	2,344.00	23,674,400	
高砂熱学工業	36,200	1,926.00	69,721,200	
三晃金属工業	1,800	2,665.00	4,797,000	
朝日工業社	2,800	3,490.00	9,772,000	
明星工業	27,000	939.00	25,353,000	
大氣社	20,300	3,740.00	75,922,000	
ダイダン	10,000	2,673.00	26,730,000	
日比谷総合設備	13,400	1,948.00	26,103,200	
ＯＳＪＢホールディングス	65,700	271.00	17,804,700	
東洋エンジニアリング	17,500	627.00	10,972,500	
レイズネクスト	22,400	1,368.00	30,643,200	
日本製粉	39,000	1,696.00	66,144,000	
日清製粉グループ本社	150,700	1,868.00	281,507,600	
日東富士製粉	1,000	6,250.00	6,250,000	
昭和産業	12,200	3,030.00	36,966,000	
鳥越製粉	11,800	856.00	10,100,800	
中部飼料	16,300	1,637.00	26,683,100	
フィード・ワン	89,600	183.00	16,396,800	
東洋精糖	2,300	1,203.00	2,766,900	
日本甜菜製糖	7,000	1,966.00	13,762,000	
三井製糖	11,700	2,216.00	25,927,200	
塩水港精糖	14,400	228.00	3,283,200	
日新製糖	6,300	2,006.00	12,637,800	
森永製菓	31,300	5,320.00	166,516,000	
中村屋	3,500	4,285.00	14,997,500	
江崎グリコ	39,600	4,820.00	190,872,000	

名糖産業	6,400	1,370.00	8,768,000	
井村屋グループ	5,700	1,921.00	10,949,700	
不二家	7,400	2,131.00	15,769,400	
山崎製パン	100,000	2,028.00	202,800,000	
第一屋製パン	2,300	956.00	2,198,800	
モロゾフ	2,300	5,130.00	11,799,000	
亀田製菓	7,600	4,940.00	37,544,000	
寿スピリッツ	12,800	8,760.00	112,128,000	
カルビー	60,800	3,645.00	221,616,000	
森永乳業	24,700	4,305.00	106,333,500	
六甲バター	8,900	1,705.00	15,174,500	
ヤクルト本社	91,800	6,030.00	553,554,000	
明治ホールディングス	88,200	7,510.00	662,382,000	
雪印メグミルク	32,100	2,509.00	80,538,900	
プリマハム	20,800	2,536.00	52,748,800	
日本ハム	51,000	4,725.00	240,975,000	
林兼産業	4,400	686.00	3,018,400	
丸大食品	14,200	2,159.00	30,657,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	10,700	2,932.00	31,372,400	
柿安本店	4,600	3,380.00	15,548,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	85,900	727.00	62,449,300	
サッポロホールディングス	45,500	2,616.00	119,028,000	
アサヒグループホールディングス	279,400	4,997.00	1,396,161,800	
キリンホールディングス	565,700	2,464.50	1,394,167,650	
宝ホールディングス	99,900	1,001.00	99,999,900	
オエノンホールディングス	35,200	400.00	14,080,000	
養命酒製造	4,100	1,999.00	8,195,900	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	93,600	2,845.00	266,292,000	
サントリー食品インターナショナル	89,300	4,620.00	412,566,000	
ダイドーグループホールディングス	6,800	4,385.00	29,818,000	
伊藤園	40,500	5,370.00	217,485,000	
キーコーヒー	13,100	2,266.00	29,684,600	
ユニカフェ	3,400	976.00	3,318,400	
ジャパンフーズ	1,900	1,290.00	2,451,000	
日清オイリオグループ	17,200	3,785.00	65,102,000	
不二製油グループ本社	32,500	2,980.00	96,850,000	
かどや製油	1,500	3,855.00	5,782,500	
Ｊ－オイルミルズ	6,900	4,265.00	29,428,500	
キッコーマン	96,000	5,400.00	518,400,000	
味の素	294,600	1,817.00	535,288,200	
キユーピー	74,300	2,390.00	177,577,000	
ハウス食品グループ本社	49,900	3,735.00	186,376,500	

カゴメ	50,600	2,602.00	131,661,200	
焼津水産化学工業	6,500	1,036.00	6,734,000	
アリアケジャパン	12,200	7,890.00	96,258,000	
ピエトロ	1,700	1,640.00	2,788,000	
エバラ食品工業	3,200	2,200.00	7,040,000	
やまみ	600	2,431.00	1,458,600	
ニチレイ	63,500	2,622.00	166,497,000	
東洋水産	68,600	4,570.00	313,502,000	
イートアンド	4,600	1,901.00	8,744,600	
大冷	1,700	1,935.00	3,289,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,300	1,044.00	7,621,200	
日清食品ホールディングス	56,700	8,330.00	472,311,000	
永谷園ホールディングス	6,500	2,167.00	14,085,500	
一正蒲鉾	5,200	1,000.00	5,200,000	
フジッコ	14,400	1,963.00	28,267,200	
ロック・フィールド	14,400	1,549.00	22,305,600	
日本たばこ産業	770,300	2,409.00	1,855,652,700	
ケンコーマヨネーズ	7,500	2,513.00	18,847,500	
わらべや日洋ホールディングス	8,700	1,849.00	16,086,300	
なとり	7,400	1,703.00	12,602,200	
イフジ産業	2,300	756.00	1,738,800	
ピックルスコーポレーション	2,900	2,611.00	7,571,900	
北の達人コーポレーション	46,600	680.00	31,688,000	
ユーグレナ	56,900	778.00	44,268,200	
ミヨシ油脂	5,100	1,204.00	6,140,400	
理研ビタミン	6,300	3,950.00	24,885,000	
片倉工業	19,200	1,310.00	25,152,000	
グンゼ	9,600	4,820.00	46,272,000	
東洋紡	51,700	1,601.00	82,771,700	
ユニチカ	39,500	360.00	14,220,000	
富士紡ホールディングス	6,400	3,620.00	23,168,000	
倉敷紡績	13,600	2,419.00	32,898,400	
シキボウ	6,800	1,234.00	8,391,200	
日本毛織	43,200	1,093.00	47,217,600	
トーア紡コーポレーション	5,200	521.00	2,709,200	
帝国繊維	14,800	2,302.00	34,069,600	
帝人	106,400	2,080.00	221,312,000	
東レ	943,200	763.10	719,755,920	
サカイオーベックス	3,700	1,889.00	6,989,300	
住江織物	3,800	2,520.00	9,576,000	
日本フエルト	8,300	498.00	4,133,400	
イチカワ	2,200	1,458.00	3,207,600	

日東製網	1,500	1,765.00	2,647,500	
アツギ	10,900	849.00	9,254,100	
ダイニック	4,900	831.00	4,071,900	
セーレン	32,300	1,508.00	48,708,400	
ソトー	5,300	972.00	5,151,600	
東海染工	1,900	1,134.00	2,154,600	
小松マテーレ	21,500	783.00	16,834,500	
ワコールホールディングス	34,000	3,015.00	102,510,000	
ホギメディカル	14,900	3,450.00	51,405,000	
レナウン	33,400	111.00	3,707,400	
クラウディアホールディングス	3,400	483.00	1,642,200	
ＴＳＩホールディングス	43,900	551.00	24,188,900	
マツオカコーポレーション	3,800	2,205.00	8,379,000	
ワールド	18,500	2,628.00	48,618,000	
三陽商会	6,900	1,320.00	9,108,000	
ナイガイ	5,000	456.00	2,280,000	
オンワードホールディングス	78,400	659.00	51,665,600	
ルックホールディングス	4,500	1,168.00	5,256,000	
ゴールドウイン	23,600	7,350.00	173,460,000	
デサント	25,400	2,030.00	51,562,000	
キング	6,300	558.00	3,515,400	
ヤマトインターナショナル	8,200	406.00	3,329,200	
特種東海製紙	8,300	4,020.00	33,366,000	
王子ホールディングス	544,200	592.00	322,166,400	
日本製紙	57,600	1,839.00	105,926,400	
三菱製紙	14,800	476.00	7,044,800	
北越コーポレーション	86,400	551.00	47,606,400	
中越パルプ工業	5,500	1,636.00	8,998,000	
巴川製紙所	3,900	869.00	3,389,100	
大王製紙	57,100	1,490.00	85,079,000	
阿波製紙	3,400	532.00	1,808,800	
レンゴー	123,000	829.00	101,967,000	
トーモク	8,000	1,793.00	14,344,000	
ザ・パック	9,900	4,000.00	39,600,000	
クラレ	205,000	1,363.00	279,415,000	
旭化成	862,800	1,205.50	1,040,105,400	
共和レザー	7,100	809.00	5,743,900	
昭和電工	92,700	2,798.00	259,374,600	
住友化学	956,400	489.00	467,679,600	
住友精化	5,800	3,320.00	19,256,000	
日産化学	72,800	4,735.00	344,708,000	
ラサ工業	4,600	1,536.00	7,065,600	

クレハ	11,200	6,680.00	74,816,000	
多木化学	3,800	4,505.00	17,119,000	
テイカ	9,500	2,018.00	19,171,000	
石原産業	23,300	1,052.00	24,511,600	
片倉コープアグリ	3,400	1,215.00	4,131,000	
日本曹達	19,300	3,095.00	59,733,500	
東ソー	201,200	1,719.00	345,862,800	
トクヤマ	37,500	2,878.00	107,925,000	
セントラル硝子	26,600	2,540.00	67,564,000	
東亞合成	81,700	1,253.00	102,370,100	
大阪ソーダ	13,200	2,981.00	39,349,200	
関東電化工業	30,900	985.00	30,436,500	
デンカ	47,500	3,205.00	152,237,500	
信越化学工業	223,500	12,600.00	2,816,100,000	
日本カーバイド工業	4,400	1,446.00	6,362,400	
堺化学工業	8,400	2,407.00	20,218,800	
第一稀元素化学工業	14,100	926.00	13,056,600	
エア・ウォーター	121,100	1,604.00	194,244,400	
大陽日酸	125,100	2,498.00	312,499,800	
日本化学工業	4,100	3,220.00	13,202,000	
東邦アセチレン	2,000	1,349.00	2,698,000	
日本パーカライジング	65,700	1,190.00	78,183,000	
高圧ガス工業	20,600	837.00	17,242,200	
チタン工業	1,600	2,543.00	4,068,800	
四国化成工業	20,100	1,326.00	26,652,600	
戸田工業	3,000	2,140.00	6,420,000	
ステラ　ケミファ	7,100	3,115.00	22,116,500	
保土谷化学工業	4,900	4,115.00	20,163,500	
日本触媒	20,200	6,780.00	136,956,000	
大日精化工業	11,500	3,010.00	34,615,000	
カネカ	33,700	3,575.00	120,477,500	
三菱瓦斯化学	122,900	1,766.00	217,041,400	
三井化学	118,200	2,655.00	313,821,000	
ＪＳＲ	121,300	2,073.00	251,454,900	
東京応化工業	22,300	4,650.00	103,695,000	
大阪有機化学工業	12,000	1,779.00	21,348,000	
三菱ケミカルホールディングス	870,200	830.60	722,788,120	
ＫＨネオケム	22,900	2,340.00	53,586,000	
ダイセル	178,100	1,065.00	189,676,500	
住友ベークライト	20,500	4,120.00	84,460,000	
積水化学工業	279,900	1,915.00	536,008,500	
日本ゼオン	117,400	1,343.00	157,668,200	

アイカ工業	39,000	3,615.00	140,985,000	
宇部興産	65,700	2,390.00	157,023,000	
積水樹脂	23,400	2,302.00	53,866,800	
タキロンシーアイ	28,200	716.00	20,191,200	
旭有機材	7,400	1,784.00	13,201,600	
日立化成	59,700	4,595.00	274,321,500	
ニチバン	6,800	1,837.00	12,491,600	
リケンテクノス	32,700	519.00	16,971,300	
大倉工業	6,100	1,866.00	11,382,600	
積水化成品工業	17,500	804.00	14,070,000	
群栄化学工業	3,000	2,639.00	7,917,000	
タイガースポリマー	6,800	606.00	4,120,800	
ミライアル	4,600	1,359.00	6,251,400	
ダイキアクシス	4,600	900.00	4,140,000	
ダイキョーニシカワ	27,400	840.00	23,016,000	
竹本容器	4,700	956.00	4,493,200	
森六ホールディングス	7,000	2,318.00	16,226,000	
日本化薬	80,600	1,346.00	108,487,600	
カーリットホールディングス	13,900	624.00	8,673,600	
日本精化	10,500	1,244.00	13,062,000	
扶桑化学工業	13,200	3,300.00	43,560,000	
トリケミカル研究所	2,900	10,400.00	30,160,000	
ＡＤＥＫＡ	59,900	1,615.00	96,738,500	
日油	49,000	3,570.00	174,930,000	
新日本理化	21,500	208.00	4,472,000	
ハリマ化成グループ	10,800	1,183.00	12,776,400	
花王	318,200	9,042.00	2,877,164,400	
第一工業製薬	4,800	4,450.00	21,360,000	
石原ケミカル	3,500	2,044.00	7,154,000	
日華化学	4,400	899.00	3,955,600	
ニイタカ	2,000	1,774.00	3,548,000	
三洋化成工業	7,800	5,420.00	42,276,000	
有機合成薬品工業	10,000	293.00	2,930,000	
大日本塗料	14,700	1,159.00	17,037,300	
日本ペイントホールディングス	107,400	5,680.00	610,032,000	
関西ペイント	146,200	2,754.00	402,634,800	
神東塗料	10,200	227.00	2,315,400	
中国塗料	37,100	1,053.00	39,066,300	
日本特殊塗料	9,700	1,415.00	13,725,500	
藤倉化成	17,600	576.00	10,137,600	
太陽ホールディングス	9,600	4,555.00	43,728,000	
ＤＩＣ	55,000	3,045.00	167,475,000	

サカタインクス	28,400	1,162.00	33,000,800	
東洋インキＳＣホールディングス	27,500	2,598.00	71,445,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	10,100	1,040.00	10,504,000	
富士フイルムホールディングス	254,800	5,747.00	1,464,335,600	
資生堂	264,100	7,802.00	2,060,508,200	
ライオン	172,800	2,059.00	355,795,200	
高砂香料工業	8,300	2,480.00	20,584,000	
マンダム	29,900	2,995.00	89,550,500	
ミルボン	17,800	6,230.00	110,894,000	
ファンケル	53,800	3,070.00	165,166,000	
コーセー	25,000	16,900.00	422,500,000	
コタ	7,000	1,617.00	11,319,000	
シーボン	1,700	2,524.00	4,290,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	56,700	2,589.00	146,796,300	
ノエビアホールディングス	12,700	5,800.00	73,660,000	
アジュバンコスメジャパン	3,000	981.00	2,943,000	
エステー	8,500	1,705.00	14,492,500	
アグロ　カネショウ	4,100	1,527.00	6,260,700	
コニシ	21,800	1,573.00	34,291,400	
長谷川香料	17,600	2,156.00	37,945,600	
星光ＰＭＣ	7,600	935.00	7,106,000	
小林製薬	37,200	9,290.00	345,588,000	
荒川化学工業	11,900	1,595.00	18,980,500	
メック	9,100	1,513.00	13,768,300	
日本高純度化学	3,600	2,635.00	9,486,000	
タカラバイオ	34,800	2,137.00	74,367,600	
ＪＣＵ	16,100	3,315.00	53,371,500	
新田ゼラチン	8,300	671.00	5,569,300	
ＯＡＴアグリオ	2,300	1,556.00	3,578,800	
デクセリアルズ	34,300	1,065.00	36,529,500	
アース製薬	10,000	5,690.00	56,900,000	
北興化学工業	13,600	637.00	8,663,200	
大成ラミック	4,400	2,875.00	12,650,000	
クミアイ化学工業	55,000	967.00	53,185,000	
日本農薬	23,700	591.00	14,006,700	
アキレス	9,200	1,795.00	16,514,000	
有沢製作所	21,000	1,068.00	22,428,000	
日東電工	91,700	6,330.00	580,461,000	
レック	14,200	1,253.00	17,792,600	
三光合成	15,200	371.00	5,639,200	
きもと	22,600	183.00	4,135,800	
藤森工業	11,900	3,550.00	42,245,000	

前澤化成工業	8,400	1,196.00	10,046,400	
未来工業	7,100	2,170.00	15,407,000	
ウェーブロックホールディングス	4,600	814.00	3,744,400	
ＪＳＰ	7,800	1,972.00	15,381,600	
エフピコ	14,600	6,530.00	95,338,000	
天馬	8,900	2,000.00	17,800,000	
信越ポリマー	23,900	1,044.00	24,951,600	
東リ	33,100	298.00	9,863,800	
ニフコ	48,800	2,964.00	144,643,200	
バルカー	10,800	2,597.00	28,047,600	
ユニ・チャーム	256,200	3,670.00	940,254,000	
ショーエイコーポレーション	1,500	807.00	1,210,500	
協和キリン	133,700	2,647.00	353,903,900	
武田薬品工業	1,105,800	4,437.00	4,906,434,600	
アステラス製薬	1,169,100	1,882.00	2,200,246,200	
大日本住友製薬	98,500	2,160.00	212,760,000	
塩野義製薬	169,900	7,059.00	1,199,324,100	
わかもと製薬	15,800	263.00	4,155,400	
あすか製薬	15,100	1,234.00	18,633,400	
日本新薬	34,800	10,040.00	349,392,000	
ビオフェルミン製薬	2,300	2,335.00	5,370,500	
中外製薬	138,600	10,675.00	1,479,555,000	
科研製薬	22,700	6,090.00	138,243,000	
エーザイ	159,100	8,351.00	1,328,644,100	
ロート製薬	68,200	3,380.00	230,516,000	
小野薬品工業	305,200	2,596.00	792,299,200	
久光製薬	35,100	6,000.00	210,600,000	
持田製薬	18,400	4,440.00	81,696,000	
参天製薬	247,500	2,148.00	531,630,000	
扶桑薬品工業	4,700	2,015.00	9,470,500	
日本ケミファ	1,800	3,060.00	5,508,000	
ツムラ	41,200	3,180.00	131,016,000	
日医工	37,600	1,324.00	49,782,400	
キッセイ薬品工業	23,500	3,095.00	72,732,500	
生化学工業	25,800	1,235.00	31,863,000	
栄研化学	23,400	2,163.00	50,614,200	
日水製薬	5,600	1,297.00	7,263,200	
鳥居薬品	8,300	3,290.00	27,307,000	
ＪＣＲファーマ	9,400	9,420.00	88,548,000	
東和薬品	17,000	2,780.00	47,260,000	
富士製薬工業	9,000	1,311.00	11,799,000	
沢井製薬	27,300	7,260.00	198,198,000	

ゼリア新薬工業	24,100	2,076.00	50,031,600	
第一三共	380,300	7,342.00	2,792,162,600	
キョーリン製薬ホールディングス	29,300	1,920.00	56,256,000	
大幸薬品	5,400	3,615.00	19,521,000	
ダイト	7,800	3,500.00	27,300,000	
大塚ホールディングス	253,200	4,939.00	1,250,554,800	
大正製薬ホールディングス	28,100	8,150.00	229,015,000	
ペプチドリーム	67,200	5,710.00	383,712,000	
日本コークス工業	112,300	79.00	8,871,700	
ニチレキ	15,700	1,335.00	20,959,500	
ユシロ化学工業	7,500	1,416.00	10,620,000	
ビーピー・カストロール	4,700	1,470.00	6,909,000	
富士石油	35,500	235.00	8,342,500	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,800	1,447.00	6,945,600	
出光興産	149,500	2,972.00	444,314,000	
ＪＸＴＧホールディングス	1,999,500	496.50	992,751,750	
コスモエネルギーホールディングス	38,500	2,436.00	93,786,000	
横浜ゴム	77,000	2,048.00	157,696,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	76,300	1,503.00	114,678,900	
ブリヂストン	408,500	4,021.00	1,642,578,500	
住友ゴム工業	119,400	1,305.00	155,817,000	
藤倉コンポジット	11,600	464.00	5,382,400	
オカモト	8,100	4,135.00	33,493,500	
フコク	5,800	736.00	4,268,800	
ニッタ	15,000	3,170.00	47,550,000	
住友理工	25,800	929.00	23,968,200	
三ツ星ベルト	17,500	2,047.00	35,822,500	
バンドー化学	23,400	904.00	21,153,600	
日東紡績	19,800	4,945.00	97,911,000	
ＡＧＣ	131,400	4,070.00	534,798,000	
日本板硝子	63,600	685.00	43,566,000	
石塚硝子	2,400	2,547.00	6,112,800	
日本山村硝子	5,500	1,288.00	7,084,000	
日本電気硝子	53,400	2,391.00	127,679,400	
オハラ	5,300	1,415.00	7,499,500	
住友大阪セメント	25,200	4,740.00	119,448,000	
太平洋セメント	84,000	3,155.00	265,020,000	
日本ヒューム	13,400	815.00	10,921,000	
日本コンクリート工業	28,700	292.00	8,380,400	
三谷セキサン	6,200	3,795.00	23,529,000	
アジアパイルホールディングス	18,900	579.00	10,943,100	
東海カーボン	139,300	1,044.00	145,429,200	

日本カーボン	6,800	4,020.00	27,336,000	
東洋炭素	7,800	2,304.00	17,971,200	
ノリタケカンパニーリミテド	7,400	4,685.00	34,669,000	
ＴＯＴＯ	94,900	4,810.00	456,469,000	
日本碍子	162,200	1,970.00	319,534,000	
日本特殊陶業	103,500	2,108.00	218,178,000	
ＭＡＲＵＷＡ	5,100	8,620.00	43,962,000	
品川リフラクトリーズ	3,500	3,285.00	11,497,500	
黒崎播磨	2,600	6,470.00	16,822,000	
ヨータイ	10,600	717.00	7,600,200	
イソライト工業	6,900	631.00	4,353,900	
東京窯業	17,000	333.00	5,661,000	
ニッカトー	6,100	750.00	4,575,000	
フジミインコーポレーテッド	11,900	3,110.00	37,009,000	
クニミネ工業	5,400	1,302.00	7,030,800	
エーアンドエーマテリアル	2,200	1,582.00	3,480,400	
ニチアス	36,400	2,786.00	101,410,400	
ニチハ	18,500	2,534.00	46,879,000	
日本製鉄	588,300	1,722.00	1,013,052,600	
神戸製鋼所	240,700	589.00	141,772,300	
中山製鋼所	18,400	533.00	9,807,200	
合同製鐵	7,100	2,703.00	19,191,300	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	355,000	1,517.00	538,535,000	
東京製鐵	64,100	798.00	51,151,800	
共英製鋼	14,900	2,045.00	30,470,500	
大和工業	28,000	2,715.00	76,020,000	
東京鐵鋼	5,500	1,482.00	8,151,000	
大阪製鐵	7,000	1,556.00	10,892,000	
淀川製鋼所	17,800	1,964.00	34,959,200	
丸一鋼管	42,700	3,150.00	134,505,000	
モリ工業	4,000	2,528.00	10,112,000	
大同特殊鋼	21,500	4,725.00	101,587,500	
日本高周波鋼業	5,000	431.00	2,155,000	
日本冶金工業	10,900	2,298.00	25,048,200	
山陽特殊製鋼	9,500	1,608.00	15,276,000	
愛知製鋼	7,400	3,760.00	27,824,000	
日立金属	141,600	1,728.00	244,684,800	
日本金属	3,000	916.00	2,748,000	
大平洋金属	8,900	2,475.00	22,027,500	
新日本電工	85,100	168.00	14,296,800	
栗本鐵工所	6,500	2,135.00	13,877,500	
虹技	2,000	1,455.00	2,910,000	

三菱製鋼	9,800	1,066.00	10,446,800	
日亜鋼業	19,400	369.00	7,158,600	
日本精線	2,200	3,550.00	7,810,000	
エンビプロ・ホールディングス	5,100	836.00	4,263,600	
シンニッタン	20,600	479.00	9,867,400	
新家工業	3,000	1,461.00	4,383,000	
大紀アルミニウム工業所	21,800	757.00	16,502,600	
日本軽金属ホールディングス	333,100	223.00	74,281,300	
三井金属鉱業	35,500	2,907.00	103,198,500	
東邦亜鉛	6,800	2,090.00	14,212,000	
三菱マテリアル	86,900	2,979.00	258,875,100	
住友金属鉱山	168,000	3,533.00	593,544,000	
ＤＯＷＡホールディングス	33,300	4,235.00	141,025,500	
古河機械金属	23,500	1,420.00	33,370,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,700	1,511.00	20,700,700	
東邦チタニウム	23,700	956.00	22,657,200	
ＵＡＣＪ	20,000	2,372.00	47,440,000	
ＣＫサンエツ	2,800	3,465.00	9,702,000	
古河電気工業	40,900	2,777.00	113,579,300	
住友電気工業	491,500	1,624.50	798,441,750	
フジクラ	159,000	448.00	71,232,000	
昭和電線ホールディングス	15,300	1,464.00	22,399,200	
東京特殊電線	2,000	2,381.00	4,762,000	
タツタ電線	26,300	628.00	16,516,400	
カナレ電気	2,200	1,815.00	3,993,000	
平河ヒューテック	5,000	1,613.00	8,065,000	
リョービ	16,200	1,957.00	31,703,400	
アーレスティ	17,400	554.00	9,639,600	
アサヒホールディングス	23,100	2,764.00	63,848,400	
稲葉製作所	7,400	1,407.00	10,411,800	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	1,996.00	7,984,000	
トーカロ	36,500	1,128.00	41,172,000	
アルファＣｏ	4,600	1,356.00	6,237,600	
ＳＵＭＣＯ	157,300	1,912.00	300,757,600	
川田テクノロジーズ	2,700	6,630.00	17,901,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,700	3,425.00	12,672,500	
信和	5,600	1,122.00	6,283,200	
東洋製罐グループホールディングス	83,700	1,987.00	166,311,900	
ホッカンホールディングス	7,200	2,054.00	14,788,800	
コロナ	7,300	1,043.00	7,613,900	
横河ブリッジホールディングス	24,400	1,925.00	46,970,000	
駒井ハルテック	2,500	1,916.00	4,790,000	

高田機工	1,200	2,669.00	3,202,800	
三和ホールディングス	126,100	1,240.00	156,364,000	
文化シヤッター	38,700	911.00	35,255,700	
三協立山	18,200	1,435.00	26,117,000	
アルインコ	9,600	1,269.00	12,182,400	
東洋シヤッター	3,200	750.00	2,400,000	
ＬＩＸＩＬグループ	193,900	1,945.00	377,135,500	
日本フイルコン	10,100	588.00	5,938,800	
ノーリツ	27,300	1,432.00	39,093,600	
長府製作所	13,400	2,368.00	31,731,200	
リンナイ	25,600	8,360.00	214,016,000	
ダイニチ工業	7,100	684.00	4,856,400	
日東精工	18,100	630.00	11,403,000	
三洋工業	1,700	2,006.00	3,410,200	
岡部	26,600	902.00	23,993,200	
ジーテクト	16,300	1,724.00	28,101,200	
東プレ	24,500	1,746.00	42,777,000	
高周波熱錬	25,300	908.00	22,972,400	
東京製綱	9,400	1,192.00	11,204,800	
サンコール	7,400	562.00	4,158,800	
モリテック　スチール	10,200	386.00	3,937,200	
パイオラックス	19,400	2,160.00	41,904,000	
エイチワン	12,900	793.00	10,229,700	
日本発條	141,000	988.00	139,308,000	
中央発條	1,600	3,030.00	4,848,000	
アドバネクス	1,900	1,677.00	3,186,300	
立川ブラインド工業	5,800	1,296.00	7,516,800	
三益半導体工業	11,700	2,262.00	26,465,400	
日本ドライケミカル	3,300	1,846.00	6,091,800	
日本製鋼所	39,900	2,198.00	87,700,200	
三浦工業	56,900	3,900.00	221,910,000	
タクマ	44,600	1,249.00	55,705,400	
ツガミ	27,400	1,207.00	33,071,800	
オークマ	15,300	5,620.00	85,986,000	
東芝機械	14,900	3,705.00	55,204,500	
アマダホールディングス	167,200	1,265.00	211,508,000	
アイダエンジニアリング	34,500	951.00	32,809,500	
滝澤鉄工所	4,200	1,396.00	5,863,200	
ＦＵＪＩ	56,600	1,978.00	111,954,800	
牧野フライス製作所	15,400	4,885.00	75,229,000	
オーエスジー	60,800	2,048.00	124,518,400	
ダイジェット工業	1,600	1,470.00	2,352,000	

旭ダイヤモンド工業	34,700	646.00	22,416,200	
DMG森精機	83,200	1,736.00	144,435,200	
ソディック	31,000	968.00	30,008,000	
ディスコ	17,800	26,400.00	469,920,000	
日東工器	7,300	2,350.00	17,155,000	
日進工具	3,900	2,870.00	11,193,000	
パンチ工業	12,200	524.00	6,392,800	
冨士ダイス	6,000	773.00	4,638,000	
豊和工業	7,400	871.00	6,445,400	
ＯＫＫ	5,600	651.00	3,645,600	
東洋機械金属	9,700	552.00	5,354,400	
津田駒工業	2,600	1,201.00	3,122,600	
エンシュウ	3,300	1,326.00	4,375,800	
島精機製作所	21,200	2,400.00	50,880,000	
オプトラン	14,700	3,185.00	46,819,500	
ＮＣホールディングス	4,200	669.00	2,809,800	
イワキポンプ	6,400	1,299.00	8,313,600	
フリュー	13,000	1,203.00	15,639,000	
ヤマシンフィルタ	28,700	826.00	23,706,200	
日阪製作所	16,400	936.00	15,350,400	
やまびこ	25,600	1,140.00	29,184,000	
平田機工	6,200	7,140.00	44,268,000	
ペガサスミシン製造	13,600	510.00	6,936,000	
マルマエ	5,500	934.00	5,137,000	
タツモ	6,200	1,389.00	8,611,800	
ナブテスコ	77,500	3,425.00	265,437,500	
三井海洋開発	14,000	2,605.00	36,470,000	
レオン自動機	13,000	1,570.00	20,410,000	
ＳＭＣ	41,700	52,930.00	2,207,181,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	11,700	564.00	6,598,800	
ホソカワミクロン	4,700	4,870.00	22,889,000	
ユニオンツール	4,900	3,300.00	16,170,000	
オイレス工業	17,100	1,638.00	28,009,800	
日精エー・エス・ビー機械	4,500	4,355.00	19,597,500	
サトーホールディングス	18,800	3,265.00	61,382,000	
技研製作所	11,600	4,735.00	54,926,000	
日本エアーテック	4,300	938.00	4,033,400	
カワタ	4,000	1,080.00	4,320,000	
日精樹脂工業	11,200	1,005.00	11,256,000	
オカダアイヨン	4,300	1,286.00	5,529,800	
ワイエイシイホールディングス	5,600	732.00	4,099,200	
小松製作所	602,100	2,659.00	1,600,983,900	

住友重機械工業	76,100	3,180.00	241,998,000	
日立建機	53,300	3,330.00	177,489,000	
日工	18,300	818.00	14,969,400	
巴工業	5,700	2,234.00	12,733,800	
井関農機	13,400	1,579.00	21,158,600	
ＴＯＷＡ	13,600	1,157.00	15,735,200	
丸山製作所	3,000	1,200.00	3,600,000	
北川鉄工所	6,000	2,338.00	14,028,000	
ローツェ	5,900	4,490.00	26,491,000	
タカキタ	4,900	632.00	3,096,800	
クボタ	705,200	1,755.50	1,237,978,600	
荏原実業	3,400	2,178.00	7,405,200	
三菱化工機	4,700	1,894.00	8,901,800	
月島機械	24,600	1,624.00	39,950,400	
帝国電機製作所	11,100	1,460.00	16,206,000	
新東工業	31,700	1,006.00	31,890,200	
澁谷工業	11,700	3,155.00	36,913,500	
アイチ　コーポレーション	23,200	781.00	18,119,200	
小森コーポレーション	33,800	1,116.00	37,720,800	
鶴見製作所	10,400	1,913.00	19,895,200	
住友精密工業	2,000	3,300.00	6,600,000	
日本ギア工業	4,400	402.00	1,768,800	
酒井重工業	2,500	2,723.00	6,807,500	
荏原製作所	55,000	3,295.00	181,225,000	
石井鐵工所	1,800	2,705.00	4,869,000	
西島製作所	13,600	925.00	12,580,000	
北越工業	13,800	1,340.00	18,492,000	
ダイキン工業	169,300	15,945.00	2,699,488,500	
オルガノ	4,800	7,430.00	35,664,000	
トーヨーカネツ	5,800	2,292.00	13,293,600	
栗田工業	72,000	3,295.00	237,240,000	
椿本チエイン	19,000	3,835.00	72,865,000	
大同工業	6,500	813.00	5,284,500	
木村化工機	11,300	669.00	7,559,700	
アネスト岩田	20,800	1,045.00	21,736,000	
ダイフク	67,900	7,240.00	491,596,000	
サムコ	3,700	2,122.00	7,851,400	
加藤製作所	7,400	1,663.00	12,306,200	
油研工業	2,300	1,752.00	4,029,600	
タダノ	64,300	990.00	63,657,000	
フジテック	48,400	1,781.00	86,200,400	
ＣＫＤ	37,000	1,966.00	72,742,000	

キトー	10,100	1,695.00	17,119,500	
平和	37,100	2,307.00	85,589,700	
理想科学工業	11,800	1,948.00	22,986,400	
ＳＡＮＫＹＯ	29,600	3,780.00	111,888,000	
日本金銭機械	14,900	899.00	13,395,100	
マースグループホールディングス	8,500	2,048.00	17,408,000	
フクシマガリレイ	8,200	4,120.00	33,784,000	
オーイズミ	5,800	568.00	3,294,400	
ダイコク電機	6,200	1,649.00	10,223,800	
竹内製作所	22,300	1,830.00	40,809,000	
アマノ	34,800	3,300.00	114,840,000	
ＪＵＫＩ	18,500	858.00	15,873,000	
蛇の目ミシン工業	12,500	410.00	5,125,000	
マックス	20,400	2,140.00	43,656,000	
グローリー	34,200	3,390.00	115,938,000	
新晃工業	12,400	1,850.00	22,940,000	
大和冷機工業	19,300	1,224.00	23,623,200	
セガサミーホールディングス	131,900	1,596.00	210,512,400	
日本ピストンリング	4,900	1,559.00	7,639,100	
リケン	6,200	4,075.00	25,265,000	
ＴＰＲ	18,000	2,030.00	36,540,000	
ツバキ・ナカシマ	27,200	1,490.00	40,528,000	
ホシザキ	38,900	10,040.00	390,556,000	
大豊工業	11,000	792.00	8,712,000	
日本精工	250,400	1,038.00	259,915,200	
ＮＴＮ	308,100	348.00	107,218,800	
ジェイテクト	127,600	1,305.00	166,518,000	
不二越	12,400	4,650.00	57,660,000	
日本トムソン	39,800	490.00	19,502,000	
ＴＨＫ	77,400	3,220.00	249,228,000	
ユーシン精機	10,400	1,028.00	10,691,200	
前澤給装工業	4,900	2,335.00	11,441,500	
イーグル工業	16,600	1,053.00	17,479,800	
前澤工業	9,200	402.00	3,698,400	
日本ピラー工業	13,500	1,584.00	21,384,000	
キッツ	54,100	752.00	40,683,200	
マキタ	173,400	4,050.00	702,270,000	
日立造船	105,700	421.00	44,499,700	
三菱重工業	222,800	4,296.00	957,148,800	
ＩＨＩ	95,800	2,835.00	271,593,000	
スター精密	20,600	1,546.00	31,847,600	
日清紡ホールディングス	88,700	1,038.00	92,070,600	

イビデン	81,700	2,693.00	220,018,100	
コニカミノルタ	291,500	732.00	213,378,000	
ブラザー工業	162,700	2,310.00	375,837,000	
ミネベアミツミ	247,100	2,406.00	594,522,600	
日立製作所	638,700	4,592.00	2,932,910,400	
三菱電機	1,329,200	1,563.00	2,077,539,600	
富士電機	80,100	3,625.00	290,362,500	
東洋電機製造	5,300	1,527.00	8,093,100	
安川電機	143,100	4,255.00	608,890,500	
シンフォニアテクノロジー	17,300	1,329.00	22,991,700	
明電舎	24,500	2,334.00	57,183,000	
オリジン	3,700	1,632.00	6,038,400	
山洋電気	6,600	5,630.00	37,158,000	
デンヨー	11,400	2,044.00	23,301,600	
東芝テック	16,700	4,575.00	76,402,500	
芝浦メカトロニクス	2,600	4,615.00	11,999,000	
マブチモーター	37,000	4,265.00	157,805,000	
日本電産	160,000	15,655.00	2,504,800,000	
トレックス・セミコンダクター	8,100	1,683.00	13,632,300	
東光高岳	8,100	1,193.00	9,663,300	
ダイヘン	14,600	3,460.00	50,516,000	
ヤーマン	20,400	775.00	15,810,000	
ＪＶＣケンウッド	111,200	274.00	30,468,800	
ミマキエンジニアリング	13,400	523.00	7,008,200	
第一精工	5,700	2,549.00	14,529,300	
日新電機	31,300	1,359.00	42,536,700	
大崎電気工業	26,700	693.00	18,503,100	
オムロン	119,200	6,530.00	778,376,000	
日東工業	19,600	2,503.00	49,058,800	
ＩＤＥＣ	19,300	2,202.00	42,498,600	
正興電機製作所	3,900	1,110.00	4,329,000	
不二電機工業	2,300	1,301.00	2,992,300	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	44,700	2,373.00	106,073,100	
サクサホールディングス	3,200	1,979.00	6,332,800	
メルコホールディングス	4,900	2,932.00	14,366,800	
テクノメディカ	3,400	2,060.00	7,004,000	
日本電気	161,300	4,935.00	796,015,500	
富士通	128,100	10,980.00	1,406,538,000	
沖電気工業	54,100	1,470.00	79,527,000	
岩崎通信機	5,800	831.00	4,819,800	
電気興業	6,400	3,510.00	22,464,000	
サンケン電気	14,500	3,430.00	49,735,000	

ナカヨ	2,700	1,652.00	4,460,400	
アイホン	7,600	1,754.00	13,330,400	
ルネサスエレクトロニクス	635,600	818.00	519,920,800	
セイコーエプソン	165,000	1,700.00	280,500,000	
ワコム	91,100	457.00	41,632,700	
アルバック	26,500	4,355.00	115,407,500	
アクセル	6,300	949.00	5,978,700	
ＥＩＺＯ	10,400	3,815.00	39,676,000	
日本信号	34,000	1,449.00	49,266,000	
京三製作所	31,400	622.00	19,530,800	
能美防災	17,900	2,444.00	43,747,600	
ホーチキ	10,100	1,650.00	16,665,000	
星和電機	7,900	590.00	4,661,000	
エレコム	14,600	4,675.00	68,255,000	
パナソニック	1,518,700	1,113.50	1,691,072,450	
シャープ	153,900	1,709.00	263,015,100	
アンリツ	85,600	2,197.00	188,063,200	
富士通ゼネラル	36,100	2,568.00	92,704,800	
ソニー	840,300	7,991.00	6,714,837,300	
ＴＤＫ	64,200	12,590.00	808,278,000	
帝国通信工業	6,500	1,226.00	7,969,000	
タムラ製作所	44,600	722.00	32,201,200	
アルプスアルパイン	117,900	2,535.00	298,876,500	
池上通信機	4,200	1,150.00	4,830,000	
鈴木	8,100	782.00	6,334,200	
日本トリム	2,000	4,725.00	9,450,000	
ローランド　ディー．ジー．	7,700	2,126.00	16,370,200	
フォスター電機	14,000	1,925.00	26,950,000	
ＳＭＫ	3,500	3,120.00	10,920,000	
ヨコオ	8,800	3,335.00	29,348,000	
ホシデン	36,900	1,366.00	50,405,400	
ヒロセ電機	20,600	14,450.00	297,670,000	
日本航空電子工業	30,500	2,259.00	68,899,500	
ＴＯＡ	14,400	1,172.00	16,876,800	
マクセルホールディングス	29,100	1,553.00	45,192,300	
古野電気	17,700	1,221.00	21,611,700	
ユニデンホールディングス	3,700	2,052.00	7,592,400	
スミダコーポレーション	10,800	1,217.00	13,143,600	
アイコム	7,400	2,623.00	19,410,200	
リオン	5,800	3,780.00	21,924,000	
本多通信工業	12,700	577.00	7,327,900	
横河電機	122,000	2,091.00	255,102,000	

新電元工業	4,700	3,720.00	17,484,000	
アズビル	83,900	3,070.00	257,573,000	
東亜ディーケーケー	7,300	1,012.00	7,387,600	
日本光電工業	55,200	3,105.00	171,396,000	
チノー	4,700	1,431.00	6,725,700	
共和電業	14,300	436.00	6,234,800	
日本電子材料	5,400	1,064.00	5,745,600	
堀場製作所	26,300	7,310.00	192,253,000	
アドバンテスト	98,800	6,170.00	609,596,000	
小野測器	7,000	568.00	3,976,000	
エスペック	12,100	2,289.00	27,696,900	
キーエンス	120,400	39,850.00	4,797,940,000	
日置電機	7,200	3,805.00	27,396,000	
シスメックス	95,100	7,843.00	745,869,300	
日本マイクロニクス	23,700	1,388.00	32,895,600	
メガチップス	12,800	1,880.00	24,064,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,100	3,710.00	26,341,000	
澤藤電機	1,900	2,329.00	4,425,100	
原田工業	7,100	1,008.00	7,156,800	
コーセル	16,900	1,253.00	21,175,700	
イリソ電子工業	11,300	4,660.00	52,658,000	
オプテックスグループ	22,300	1,672.00	37,285,600	
千代田インテグレ	6,500	2,178.00	14,157,000	
アイ・オー・データ機器	5,700	1,026.00	5,848,200	
レーザーテック	54,600	5,820.00	317,772,000	
スタンレー電気	93,700	3,145.00	294,686,500	
岩崎電気	5,700	1,491.00	8,498,700	
ウシオ電機	77,600	1,700.00	131,920,000	
岡谷電機産業	12,500	386.00	4,825,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	13,900	465.00	6,463,500	
エノモト	4,500	1,373.00	6,178,500	
日本セラミック	13,800	2,687.00	37,080,600	
遠藤照明	7,800	721.00	5,623,800	
古河電池	10,400	812.00	8,444,800	
双信電機	8,000	497.00	3,976,000	
山一電機	10,100	1,715.00	17,321,500	
図研	8,900	2,660.00	23,674,000	
日本電子	26,400	3,540.00	93,456,000	
カシオ計算機	117,600	2,258.00	265,540,800	
ファナック	126,300	20,965.00	2,647,879,500	
日本シイエムケイ	32,500	610.00	19,825,000	
エンプラス	7,000	3,435.00	24,045,000	

大真空	5,300	2,016.00	10,684,800	
ローム	59,100	9,170.00	541,947,000	
浜松ホトニクス	95,500	4,640.00	443,120,000	
三井ハイテック	15,100	1,695.00	25,594,500	
新光電気工業	45,200	1,369.00	61,878,800	
京セラ	187,100	7,707.00	1,441,979,700	
太陽誘電	59,300	3,530.00	209,329,000	
村田製作所	390,500	6,785.00	2,649,542,500	
双葉電子工業	21,600	1,345.00	29,052,000	
北陸電気工業	5,900	1,326.00	7,823,400	
ニチコン	45,800	1,078.00	49,372,400	
日本ケミコン	10,100	1,948.00	19,674,800	
ＫＯＡ	20,600	1,390.00	28,634,000	
市光工業	21,000	734.00	15,414,000	
小糸製作所	79,800	5,200.00	414,960,000	
ミツバ	25,600	713.00	18,252,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	23,100	7,940.00	183,414,000	
キヤノン電子	14,300	2,073.00	29,643,900	
キヤノン	715,500	3,095.00	2,214,472,500	
リコー	338,300	1,257.00	425,243,100	
象印マホービン	39,300	2,200.00	86,460,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,300	1,731.00	3,981,300	
東京エレクトロン	88,600	25,180.00	2,230,948,000	
トヨタ紡織	38,800	1,742.00	67,589,600	
芦森工業	2,800	1,392.00	3,897,600	
ユニプレス	25,800	1,556.00	40,144,800	
豊田自動織機	107,600	6,530.00	702,628,000	
モリタホールディングス	23,300	1,742.00	40,588,600	
三櫻工業	16,900	1,130.00	19,097,000	
デンソー	292,600	5,021.00	1,469,144,600	
東海理化電機製作所	35,000	2,100.00	73,500,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	48,000	983.00	47,184,000	
川崎重工業	103,400	2,415.00	249,711,000	
名村造船所	42,800	260.00	11,128,000	
日本車輌製造	4,800	3,085.00	14,808,000	
三菱ロジスネクスト	17,600	1,691.00	29,761,600	
近畿車輛	2,000	1,664.00	3,328,000	
日産自動車	1,567,500	637.50	999,281,250	
いすゞ自動車	385,100	1,216.00	468,281,600	
トヨタ自動車	1,483,006	7,780.00	11,537,786,680	
日野自動車	166,000	1,118.00	185,588,000	
三菱自動車工業	492,000	454.00	223,368,000	

エフテック	9,400	802.00	7,538,800	
レシップホールディングス	5,200	684.00	3,556,800	
ＧＭＢ	2,500	824.00	2,060,000	
ファルテック	2,400	1,127.00	2,704,800	
武蔵精密工業	29,600	1,447.00	42,831,200	
日産車体	26,000	1,062.00	27,612,000	
新明和工業	35,800	1,491.00	53,377,800	
極東開発工業	24,700	1,561.00	38,556,700	
日信工業	26,800	2,230.00	59,764,000	
トピー工業	11,000	1,942.00	21,362,000	
ティラド	4,900	1,948.00	9,545,200	
曙ブレーキ工業	73,000	238.00	17,374,000	
タチエス	21,900	1,396.00	30,572,400	
ＮＯＫ	71,500	1,626.00	116,259,000	
フタバ産業	37,100	753.00	27,936,300	
ＫＹＢ	14,900	3,165.00	47,158,500	
大同メタル工業	25,600	728.00	18,636,800	
プレス工業	66,000	410.00	27,060,000	
ミクニ	17,100	351.00	6,002,100	
太平洋工業	27,900	1,531.00	42,714,900	
ケーヒン	30,300	2,577.00	78,083,100	
河西工業	18,000	835.00	15,030,000	
アイシン精機	109,500	3,990.00	436,905,000	
マツダ	391,100	1,017.00	397,748,700	
今仙電機製作所	12,400	947.00	11,742,800	
本田技研工業	1,046,500	3,066.00	3,208,569,000	
スズキ	263,400	5,061.00	1,333,067,400	
ＳＵＢＡＲＵ	412,600	2,855.50	1,178,179,300	
安永	6,500	1,205.00	7,832,500	
ヤマハ発動機	173,300	2,209.00	382,819,700	
ショーワ	31,100	2,280.00	70,908,000	
ＴＢＫ	15,900	478.00	7,600,200	
エクセディ	18,100	2,421.00	43,820,100	
豊田合成	42,900	2,769.00	118,790,100	
愛三工業	20,900	758.00	15,842,200	
盟和産業	2,100	1,144.00	2,402,400	
日本プラスト	10,500	702.00	7,371,000	
ヨロズ	12,500	1,471.00	18,387,500	
エフ・シー・シー	21,800	2,411.00	52,559,800	
シマノ	49,700	17,480.00	868,756,000	
テイ・エス　テック	30,900	3,280.00	101,352,000	
ジャムコ	6,700	1,455.00	9,748,500	

テルモ	376,100	3,974.00	1,494,621,400	
クリエートメディック	4,400	1,060.00	4,664,000	
日機装	39,900	1,436.00	57,296,400	
日本エム・ディ・エム	7,700	2,574.00	19,819,800	
島津製作所	158,800	3,295.00	523,246,000	
ＪＭＳ	11,300	767.00	8,667,100	
長野計器	9,700	975.00	9,457,500	
ブイ・テクノロジー	6,200	5,350.00	33,170,000	
東京計器	8,500	1,075.00	9,137,500	
愛知時計電機	1,800	4,355.00	7,839,000	
インターアクション	7,100	2,676.00	18,999,600	
オーバル	12,100	259.00	3,133,900	
東京精密	24,100	4,215.00	101,581,500	
マニー	53,000	3,060.00	162,180,000	
ニコン	215,100	1,390.00	298,989,000	
トプコン	67,000	1,639.00	109,813,000	
オリンパス	735,400	1,762.50	1,296,142,500	
理研計器	11,700	2,191.00	25,634,700	
タムロン	10,700	2,542.00	27,199,400	
ＨＯＹＡ	265,400	10,730.00	2,847,742,000	
シード	5,700	1,079.00	6,150,300	
ノーリツ鋼機	9,000	1,534.00	13,806,000	
エー・アンド・デイ	12,200	1,006.00	12,273,200	
朝日インテック	112,800	3,155.00	355,884,000	
シチズン時計	155,700	585.00	91,084,500	
リズム時計工業	4,200	926.00	3,889,200	
大研医器	9,300	702.00	6,528,600	
メニコン	18,200	4,950.00	90,090,000	
シンシア	1,500	686.00	1,029,000	
松風	6,000	1,873.00	11,238,000	
セイコーホールディングス	18,800	2,910.00	54,708,000	
ニプロ	92,000	1,287.00	118,404,000	
中本パックス	3,400	1,653.00	5,620,200	
スノーピーク	6,300	1,096.00	6,904,800	
パラマウントベッドホールディングス	14,000	4,675.00	65,450,000	
トランザクション	8,500	1,106.00	9,401,000	
粧美堂	3,900	396.00	1,544,400	
ニホンフラッシュ	6,200	2,830.00	17,546,000	
前田工繊	14,600	2,238.00	32,674,800	
永大産業	17,400	350.00	6,090,000	
アートネイチャー	14,200	846.00	12,013,200	
バンダイナムコホールディングス	137,400	6,471.00	889,115,400	

アイフィスジャパン	3,400	768.00	2,611,200	
共立印刷	22,200	170.00	3,774,000	
ＳＨＯＥＩ	6,400	5,060.00	32,384,000	
フランスベッドホールディングス	18,800	970.00	18,236,000	
パイロットコーポレーション	21,700	4,530.00	98,301,000	
萩原工業	7,400	1,705.00	12,617,000	
トッパン・フォームズ	28,500	1,202.00	34,257,000	
フジシールインターナショナル	29,800	2,467.00	73,516,600	
タカラトミー	59,600	1,280.00	76,288,000	
廣済堂	9,300	821.00	7,635,300	
エステールホールディングス	3,500	700.00	2,450,000	
アーク	50,700	97.00	4,917,900	
タカノ	5,200	797.00	4,144,400	
プロネクサス	11,400	1,206.00	13,748,400	
ホクシン	8,200	160.00	1,312,000	
ウッドワン	4,500	1,230.00	5,535,000	
大建工業	8,900	1,942.00	17,283,800	
凸版印刷	187,600	2,252.00	422,475,200	
大日本印刷	173,900	3,000.00	521,700,000	
共同印刷	4,100	2,945.00	12,074,500	
ＮＩＳＳＨＡ	27,300	1,086.00	29,647,800	
光村印刷	1,200	1,730.00	2,076,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	6,400	1,713.00	10,963,200	
アシックス	109,700	1,691.00	185,502,700	
ツツミ	4,100	2,146.00	8,798,600	
小松ウオール工業	4,000	2,169.00	8,676,000	
ヤマハ	79,000	6,110.00	482,690,000	
河合楽器製作所	4,100	3,805.00	15,600,500	
クリナップ	12,400	717.00	8,890,800	
ピジョン	80,300	4,215.00	338,464,500	
オリバー	2,800	3,530.00	9,884,000	
兼松サステック	900	1,826.00	1,643,400	
キングジム	11,100	867.00	9,623,700	
リンテック	31,600	2,443.00	77,198,800	
イトーキ	28,300	511.00	14,461,300	
任天堂	81,500	42,990.00	3,503,685,000	
三菱鉛筆	21,900	1,668.00	36,529,200	
タカラスタンダード	27,500	1,953.00	53,707,500	
コクヨ	63,800	1,673.00	106,737,400	
ナカバヤシ	13,100	621.00	8,135,100	
グローブライド	5,900	2,526.00	14,903,400	
オカムラ	46,400	1,109.00	51,457,600	

美津濃	12,100	2,687.00	32,512,700	
東京電力ホールディングス	1,061,000	438.00	464,718,000	
中部電力	406,600	1,458.50	593,026,100	
関西電力	503,600	1,233.50	621,190,600	
中国電力	183,700	1,422.00	261,221,400	
北陸電力	121,500	789.00	95,863,500	
東北電力	332,000	1,023.00	339,636,000	
四国電力	119,700	952.00	113,954,400	
九州電力	273,900	905.00	247,879,500	
北海道電力	124,400	516.00	64,190,400	
沖縄電力	24,600	1,989.00	48,929,400	
電源開発	105,800	2,573.00	272,223,400	
エフオン	6,300	825.00	5,197,500	
イーレックス	18,900	1,736.00	32,810,400	
レノバ	22,000	1,158.00	25,476,000	
東京瓦斯	255,600	2,562.00	654,847,200	
大阪瓦斯	257,900	1,988.00	512,705,200	
東邦瓦斯	65,400	4,305.00	281,547,000	
北海道瓦斯	7,100	1,662.00	11,800,200	
広島ガス	27,400	354.00	9,699,600	
西部瓦斯	15,000	2,421.00	36,315,000	
静岡ガス	37,700	924.00	34,834,800	
メタウォーター	6,400	4,335.00	27,744,000	
ＳＢＳホールディングス	11,500	1,869.00	21,493,500	
東武鉄道	140,200	3,970.00	556,594,000	
相鉄ホールディングス	42,500	2,955.00	125,587,500	
東急	335,200	1,977.00	662,690,400	
京浜急行電鉄	170,700	2,071.00	353,519,700	
小田急電鉄	197,700	2,519.00	498,006,300	
京王電鉄	69,000	6,500.00	448,500,000	
京成電鉄	92,500	4,325.00	400,062,500	
富士急行	18,100	4,090.00	74,029,000	
新京成電鉄	3,400	2,384.00	8,105,600	
東日本旅客鉄道	233,900	9,991.00	2,336,894,900	
西日本旅客鉄道	118,400	9,437.00	1,117,340,800	
東海旅客鉄道	110,500	22,150.00	2,447,575,000	
西武ホールディングス	178,300	1,825.00	325,397,500	
鴻池運輸	21,200	1,634.00	34,640,800	
西日本鉄道	36,800	2,526.00	92,956,800	
ハマキョウレックス	10,200	3,570.00	36,414,000	
サカイ引越センター	7,000	6,590.00	46,130,000	
近鉄グループホールディングス	125,900	5,940.00	747,846,000	

阪急阪神ホールディングス	167,900	4,640.00	779,056,000	
南海電気鉄道	59,700	2,982.00	178,025,400	
京阪ホールディングス	56,000	5,230.00	292,880,000	
神戸電鉄	3,000	3,980.00	11,940,000	
名古屋鉄道	103,500	3,410.00	352,935,000	
山陽電気鉄道	9,000	2,161.00	19,449,000	
日本通運	44,500	6,570.00	292,365,000	
ヤマトホールディングス	220,700	1,944.00	429,040,800	
山九	35,000	5,580.00	195,300,000	
丸運	7,200	343.00	2,469,600	
丸全昭和運輸	10,200	3,145.00	32,079,000	
センコーグループホールディングス	69,400	912.00	63,292,800	
トナミホールディングス	3,000	5,100.00	15,300,000	
ニッコンホールディングス	45,100	2,696.00	121,589,600	
日本石油輸送	1,400	2,924.00	4,093,600	
福山通運	16,100	3,925.00	63,192,500	
セイノーホールディングス	94,300	1,461.00	137,772,300	
エスライン	3,800	1,030.00	3,914,000	
神奈川中央交通	3,100	4,055.00	12,570,500	
日立物流	23,100	3,220.00	74,382,000	
丸和運輸機関	13,300	2,419.00	32,172,700	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	12,700	1,392.00	17,678,400	
九州旅客鉄道	112,200	3,635.00	407,847,000	
ＳＧホールディングス	132,100	2,490.00	328,929,000	
日本郵船	105,800	1,935.00	204,723,000	
商船三井	80,000	2,964.00	237,120,000	
川崎汽船	38,800	1,669.00	64,757,200	
ＮＳユナイテッド海運	7,400	2,168.00	16,043,200	
飯野海運	62,400	368.00	22,963,200	
共栄タンカー	3,200	995.00	3,184,000	
乾汽船	7,300	1,160.00	8,468,000	
日本航空	226,600	3,404.00	771,346,400	
ＡＮＡホールディングス	230,100	3,656.00	841,245,600	
パスコ	2,400	2,191.00	5,258,400	
トランコム	3,500	8,060.00	28,210,000	
日新	10,900	1,824.00	19,881,600	
三菱倉庫	39,900	2,852.00	113,794,800	
三井倉庫ホールディングス	14,400	1,967.00	28,324,800	
住友倉庫	46,300	1,506.00	69,727,800	
澁澤倉庫	6,900	2,346.00	16,187,400	
東陽倉庫	22,700	328.00	7,445,600	
日本トランスシティ	27,700	512.00	14,182,400	

ケイヒン	2,400	1,329.00	3,189,600	
中央倉庫	7,700	1,175.00	9,047,500	
川西倉庫	2,300	1,045.00	2,403,500	
安田倉庫	10,300	1,068.00	11,000,400	
ファイズホールディングス	2,700	533.00	1,439,100	
東洋埠頭	3,800	1,418.00	5,388,400	
宇徳	10,800	604.00	6,523,200	
上組	72,100	2,414.00	174,049,400	
サンリツ	3,000	737.00	2,211,000	
キムラユニティー	3,400	1,153.00	3,920,200	
キユーソー流通システム	3,100	1,895.00	5,874,500	
近鉄エクスプレス	26,700	1,969.00	52,572,300	
東海運	7,200	289.00	2,080,800	
エーアイテイー	8,900	1,054.00	9,380,600	
内外トランスライン	4,400	1,361.00	5,988,400	
日本コンセプト	4,000	1,530.00	6,120,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	12,400	4,095.00	50,778,000	
クロスキャット	3,700	1,380.00	5,106,000	
システナ	46,700	1,926.00	89,944,200	
デジタルアーツ	6,500	5,870.00	38,155,000	
日鉄ソリューションズ	19,600	3,795.00	74,382,000	
キューブシステム	7,300	831.00	6,066,300	
エイジア	2,600	1,452.00	3,775,200	
コア	5,700	1,588.00	9,051,600	
ソリトンシステムズ	5,900	1,311.00	7,734,900	
ソフトクリエイトホールディングス	5,900	1,743.00	10,283,700	
ＴＩＳ	43,500	6,690.00	291,015,000	
ネオス	5,200	796.00	4,139,200	
電算システム	5,100	3,035.00	15,478,500	
グリー	90,600	475.00	43,035,000	
コーエーテクモホールディングス	26,800	2,907.00	77,907,600	
三菱総合研究所	5,700	4,375.00	24,937,500	
電算	1,600	2,280.00	3,648,000	
ＡＧＳ	7,800	861.00	6,715,800	
ファインデックス	11,200	1,271.00	14,235,200	
ブレインパッド	2,700	6,090.00	16,443,000	
ＫＬａｂ	25,200	831.00	20,941,200	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,100	950.00	15,295,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	2,015.00	4,030,000	
ネクソン	371,500	1,575.00	585,112,500	
アイスタイル	34,200	593.00	20,280,600	
エムアップ	3,900	2,754.00	10,740,600	

エイチーム	9,300	1,099.00	10,220,700	
エニグモ	9,600	915.00	8,784,000	
テクノスジャパン	10,800	504.00	5,443,200	
コロプラ	43,000	1,178.00	50,654,000	
ブロードリーフ	65,100	670.00	43,617,000	
クロス・マーケティンググループ	6,600	404.00	2,666,400	
デジタルハーツホールディングス	7,200	1,078.00	7,761,600	
システム情報	6,900	1,144.00	7,893,600	
メディアドゥホールディングス	4,200	3,480.00	14,616,000	
じげん	32,900	536.00	17,634,400	
エンカレッジ・テクノロジ	2,500	922.00	2,305,000	
サイバーリンクス	2,300	1,286.00	2,957,800	
フィックスターズ	14,100	1,642.00	23,152,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,600	1,139.00	7,517,400	
オプティム	3,500	4,095.00	14,332,500	
セレス	4,500	1,371.00	6,169,500	
ＳＨＩＦＴ	3,400	8,630.00	29,342,000	
ティーガイア	11,700	2,697.00	31,554,900	
セック	2,000	3,915.00	7,830,000	
日本アジアグループ	13,700	381.00	5,219,700	
豆蔵ホールディングス	9,100	1,564.00	14,232,400	
テクマトリックス	9,300	2,638.00	24,533,400	
プロシップ	4,000	1,614.00	6,456,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,600	2,269.00	71,700,400	
GMOペイメントゲートウェイ	21,500	7,720.00	165,980,000	
ザッパラス	7,600	418.00	3,176,800	
システムリサーチ	3,600	1,923.00	6,922,800	
インターネットイニシアティブ	19,400	2,998.00	58,161,200	
さくらインターネット	14,400	731.00	10,526,400	
ヴィンクス	3,900	1,220.00	4,758,000	
GMOクラウド	2,500	2,571.00	6,427,500	
ＳＲＡホールディングス	7,000	2,606.00	18,242,000	
システムインテグレータ	4,500	1,020.00	4,590,000	
朝日ネット	9,800	647.00	6,340,600	
ｅＢＡＳＥ	8,000	1,486.00	11,888,000	
アバント	9,600	1,153.00	11,068,800	
アドソル日進	4,700	2,368.00	11,129,600	
フリービット	8,100	987.00	7,994,700	
コムチュア	14,800	2,479.00	36,689,200	
サイバーコム	2,500	2,309.00	5,772,500	
アステリア	8,500	591.00	5,023,500	
アイル	4,800	2,189.00	10,507,200	

マークラインズ	6,700	2,063.00	13,822,100	
メディカル・データ・ビジョン	10,300	878.00	9,043,400	
ショーケース	3,500	729.00	2,551,500	
モバイルファクトリー	3,200	1,414.00	4,524,800	
テラスカイ	4,800	3,075.00	14,760,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,854.00	10,938,600	
ＰＣＩホールディングス	2,800	2,266.00	6,344,800	
パイプドＨＤ	1,800	2,007.00	3,612,600	
アイビーシー	2,600	1,467.00	3,814,200	
ネオジャパン	2,700	1,202.00	3,245,400	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,200	2,554.00	3,064,800	
ランドコンピュータ	2,300	1,217.00	2,799,100	
ダブルスタンダード	1,700	4,785.00	8,134,500	
オープンドア	6,700	1,534.00	10,277,800	
マイネット	4,200	701.00	2,944,200	
アカツキ	4,700	5,670.00	26,649,000	
ベネフィットジャパン	1,100	1,872.00	2,059,200	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,100	1,410.00	4,371,000	
ＬＩＮＥ	29,600	5,370.00	158,952,000	
カナミックネットワーク	8,300	824.00	6,839,200	
ノムラシステムコーポレーション	3,400	532.00	1,808,800	
チェンジ	2,700	3,220.00	8,694,000	
シンクロ・フード	6,100	582.00	3,550,200	
オークネット	8,300	1,268.00	10,524,400	
セグエグループ	2,500	940.00	2,350,000	
エイトレッド	1,800	1,765.00	3,177,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	13,600	739.00	10,050,400	
マクロミル	23,600	1,124.00	26,526,400	
ビーグリー	2,800	1,261.00	3,530,800	
オロ	3,500	3,810.00	13,335,000	
ユーザーローカル	800	3,450.00	2,760,000	
テモナ	2,300	557.00	1,281,100	
ニーズウェル	2,000	819.00	1,638,000	
サインポスト	2,200	2,045.00	4,499,000	
ソルクシーズ	5,900	1,080.00	6,372,000	
フェイス	5,000	789.00	3,945,000	
プロトコーポレーション	11,900	1,268.00	15,089,200	
ハイマックス	1,700	2,066.00	3,512,200	
野村総合研究所	218,100	2,370.00	516,897,000	
サイバネットシステム	9,600	941.00	9,033,600	
ＣＥホールディングス	8,100	510.00	4,131,000	
日本システム技術	2,300	1,446.00	3,325,800	

インテージホールディングス	16,600	911.00	15,122,600	
東邦システムサイエンス	3,800	928.00	3,526,400	
ソースネクスト	62,400	572.00	35,692,800	
インフォコム	14,400	2,808.00	40,435,200	
ラクスル	7,000	3,905.00	27,335,000	
ＦＩＧ	15,200	304.00	4,620,800	
システムサポート	1,200	2,289.00	2,746,800	
イーソル	4,800	2,302.00	11,049,600	
アルテリア・ネットワークス	14,600	1,886.00	27,535,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,200	1,622.00	5,190,400	
フォーカスシステムズ	8,400	1,005.00	8,442,000	
クレスコ	4,000	4,010.00	16,040,000	
フジ・メディア・ホールディングス	125,800	1,560.00	196,248,000	
オービック	45,200	15,430.00	697,436,000	
ジャストシステム	21,300	6,470.00	137,811,000	
ＴＤＣソフト	11,700	1,126.00	13,174,200	
Ｚホールディングス	1,791,700	452.00	809,848,400	
トレンドマイクロ	58,000	5,870.00	340,460,000	
ＩＤホールディングス	5,200	1,646.00	8,559,200	
日本オラクル	26,500	10,040.00	266,060,000	
アルファシステムズ	4,200	2,887.00	12,125,400	
フューチャー	15,900	2,019.00	32,102,100	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,700	1,551.00	13,493,700	
ＳＢテクノロジー	4,800	2,297.00	11,025,600	
トーセ	3,900	929.00	3,623,100	
オービックビジネスコンサルタント	13,400	5,060.00	67,804,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	59,500	3,330.00	198,135,000	
アイティフォー	16,200	928.00	15,033,600	
東計電算	2,000	3,685.00	7,370,000	
エックスネット	2,400	983.00	2,359,200	
大塚商会	70,600	4,620.00	326,172,000	
サイボウズ	15,400	1,773.00	27,304,200	
ソフトブレーン	8,200	663.00	5,436,600	
電通国際情報サービス	8,100	4,615.00	37,381,500	
デジタルガレージ	23,500	4,370.00	102,695,000	
ＥＭシステムズ	18,600	990.00	18,414,000	
ウェザーニューズ	4,500	3,785.00	17,032,500	
ＣＩＪ	10,000	917.00	9,170,000	
ビジネスエンジニアリング	1,600	3,505.00	5,608,000	
日本エンタープライズ	14,500	253.00	3,668,500	
WOWOW	6,400	2,671.00	17,094,400	
スカラ	9,600	804.00	7,718,400	

インテリジェント　ウェイブ	5,300	841.00	4,457,300	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	11,600	575.00	6,670,000	
ネットワンシステムズ	49,800	2,950.00	146,910,000	
システムソフト	34,000	110.00	3,740,000	
アルゴグラフィックス	11,200	3,400.00	38,080,000	
マーベラス	20,400	724.00	14,769,600	
エイベックス	22,700	1,269.00	28,806,300	
日本ユニシス	40,800	3,550.00	144,840,000	
兼松エレクトロニクス	7,200	3,575.00	25,740,000	
東京放送ホールディングス	79,500	1,905.00	151,447,500	
日本テレビホールディングス	109,100	1,477.00	161,140,700	
朝日放送グループホールディングス	13,400	761.00	10,197,400	
テレビ朝日ホールディングス	36,000	2,105.00	75,780,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	86,500	473.00	40,914,500	
テレビ東京ホールディングス	10,800	2,418.00	26,114,400	
日本ＢＳ放送	4,700	1,195.00	5,616,500	
ビジョン	12,300	1,735.00	21,340,500	
スマートバリュー	4,200	793.00	3,330,600	
ワイヤレスゲート	6,600	770.00	5,082,000	
コネクシオ	7,600	1,744.00	13,254,400	
クロップス	2,800	762.00	2,133,600	
日本電信電話	1,743,500	2,847.50	4,964,616,250	
ＫＤＤＩ	972,000	3,326.00	3,232,872,000	
ソフトバンク	1,185,500	1,468.00	1,740,314,000	
光通信	13,500	27,430.00	370,305,000	
ＮＴＴドコモ	963,500	3,106.00	2,992,631,000	
エムティーアイ	13,100	718.00	9,405,800	
GMOインターネット	51,500	2,162.00	111,343,000	
ファイバーゲート	2,700	1,401.00	3,782,700	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,400	704.00	3,097,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	35,300	2,013.00	71,058,900	
学研ホールディングス	4,400	7,500.00	33,000,000	
ゼンリン	26,200	1,745.00	45,719,000	
昭文社	6,800	391.00	2,658,800	
インプレスホールディングス	10,800	182.00	1,965,600	
アイネット	6,900	1,620.00	11,178,000	
松竹	8,600	15,340.00	131,924,000	
東宝	78,100	4,315.00	337,001,500	
東映	4,900	15,730.00	77,077,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	347,500	1,569.00	545,227,500	
ピー・シー・エー	1,700	5,690.00	9,673,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,546.00	6,110,400	

ＤＴＳ	29,300	2,568.00	75,242,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,700	5,560.00	309,692,000	
シーイーシー	14,100	2,297.00	32,387,700	
カプコン	61,600	2,912.00	179,379,200	
アイ・エス・ビー	2,700	2,100.00	5,670,000	
ジャステック	8,600	1,153.00	9,915,800	
ＳＣＳＫ	30,100	6,000.00	180,600,000	
日本システムウエア	4,400	2,667.00	11,734,800	
アイネス	13,100	1,435.00	18,798,500	
ＴＫＣ	11,100	5,270.00	58,497,000	
富士ソフト	16,800	4,440.00	74,592,000	
ＮＳＤ	43,000	1,783.00	76,669,000	
コナミホールディングス	47,400	4,590.00	217,566,000	
福井コンピュータホールディングス	5,200	3,680.00	19,136,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,000	2,102.00	18,918,000	
ミロク情報サービス	11,600	3,275.00	37,990,000	
ソフトバンクグループ	1,034,900	4,866.00	5,035,823,400	
ホウスイ	1,100	903.00	993,300	
高千穂交易	5,100	1,223.00	6,237,300	
伊藤忠食品	3,200	5,330.00	17,056,000	
エレマテック	12,200	1,178.00	14,371,600	
ＪＡＬＵＸ	3,700	2,490.00	9,213,000	
あらた	10,400	4,535.00	47,164,000	
トーメンデバイス	2,000	3,980.00	7,960,000	
東京エレクトロン　デバイス	4,800	2,829.00	13,579,200	
フィールズ	10,000	596.00	5,960,000	
双日	723,000	355.00	256,665,000	
アルフレッサ　ホールディングス	145,500	2,274.00	330,867,000	
横浜冷凍	36,700	977.00	35,855,900	
ラサ商事	7,000	1,040.00	7,280,000	
ラクーンホールディングス	6,300	872.00	5,493,600	
アルコニックス	13,900	1,420.00	19,738,000	
神戸物産	45,200	4,270.00	193,004,000	
あい　ホールディングス	18,700	1,971.00	36,857,700	
ディーブイエックス	4,700	928.00	4,361,600	
ダイワボウホールディングス	11,100	6,890.00	76,479,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	31,200	1,834.00	57,220,800	
ラクト・ジャパン	4,900	3,835.00	18,791,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,700	1,044.00	25,786,800	
八洲電機	10,100	915.00	9,241,500	
メディアスホールディングス	7,500	876.00	6,570,000	
レスターホールディングス	13,700	2,089.00	28,619,300	

ジューテックホールディングス	3,000	1,193.00	3,579,000	
大光	5,600	665.00	3,724,000	
ＯＣＨＩホールディングス	3,800	1,475.00	5,605,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	69,200	1,074.00	74,320,800	
黒谷	3,000	520.00	1,560,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,300	831.00	1,911,300	
三洋貿易	6,600	2,761.00	18,222,600	
ビューティガレージ	2,100	2,411.00	5,063,100	
ウイン・パートナーズ	9,500	1,292.00	12,274,000	
ミタチ産業	4,000	749.00	2,996,000	
シップヘルスケアホールディングス	21,000	5,070.00	106,470,000	
明治電機工業	4,100	1,600.00	6,560,000	
デリカフーズホールディングス	4,600	730.00	3,358,000	
スターティアホールディングス	3,000	827.00	2,481,000	
コメダホールディングス	28,500	2,239.00	63,811,500	
アセンテック	1,100	2,204.00	2,424,400	
富士興産	4,000	655.00	2,620,000	
協栄産業	1,500	1,467.00	2,200,500	
小野建	11,800	1,385.00	16,343,000	
南陽	2,900	1,923.00	5,576,700	
佐鳥電機	9,700	896.00	8,691,200	
エコートレーディング	3,000	575.00	1,725,000	
伯東	8,000	1,343.00	10,744,000	
コンドーテック	10,200	1,155.00	11,781,000	
中山福	7,600	557.00	4,233,200	
ナガイレーベン	18,900	2,356.00	44,528,400	
三菱食品	14,400	3,115.00	44,856,000	
松田産業	9,600	1,581.00	15,177,600	
第一興商	19,500	5,550.00	108,225,000	
メディパルホールディングス	141,300	2,425.00	342,652,500	
ＳＰＫ	2,800	2,835.00	7,938,000	
萩原電気ホールディングス	4,900	2,746.00	13,455,400	
アズワン	8,500	10,200.00	86,700,000	
スズデン	4,600	1,454.00	6,688,400	
尾家産業	3,800	1,409.00	5,354,200	
シモジマ	8,000	1,181.00	9,448,000	
ドウシシャ	12,400	1,718.00	21,303,200	
小津産業	2,900	1,764.00	5,115,600	
高速	7,800	1,230.00	9,594,000	
たけびし	4,600	1,491.00	6,858,600	
リックス	3,000	1,761.00	5,283,000	
丸文	11,600	627.00	7,273,200	

ハピネット	10,900	1,353.00	14,747,700	
橋本総業ホールディングス	2,700	1,910.00	5,157,000	
日本ライフライン	38,800	1,459.00	56,609,200	
タカショー	6,400	492.00	3,148,800	
エクセル	3,700	1,596.00	5,905,200	
マルカ	4,600	2,155.00	9,913,000	
ＩＤＯＭ	35,300	586.00	20,685,800	
進和	7,700	2,277.00	17,532,900	
エスケイジャパン	2,900	477.00	1,383,300	
ダイトロン	5,500	1,938.00	10,659,000	
シークス	16,700	1,475.00	24,632,500	
田中商事	4,100	759.00	3,111,900	
オーハシテクニカ	7,400	1,573.00	11,640,200	
白銅	4,700	1,499.00	7,045,300	
伊藤忠商事	915,600	2,603.00	2,383,306,800	
丸紅	1,362,600	828.60	1,129,050,360	
高島	2,100	2,008.00	4,216,800	
長瀬産業	73,600	1,602.00	117,907,200	
蝶理	8,400	2,124.00	17,841,600	
豊田通商	146,100	3,920.00	572,712,000	
三共生興	19,900	595.00	11,840,500	
兼松	48,800	1,473.00	71,882,400	
ツカモトコーポレーション	2,400	1,128.00	2,707,200	
三井物産	1,150,600	1,987.50	2,286,817,500	
日本紙パルプ商事	7,400	4,090.00	30,266,000	
日立ハイテクノロジーズ	45,500	7,890.00	358,995,000	
カメイ	17,100	1,219.00	20,844,900	
東都水産	1,700	2,716.00	4,617,200	
ＯＵＧホールディングス	2,100	2,669.00	5,604,900	
スターゼン	4,800	4,320.00	20,736,000	
山善	51,200	1,076.00	55,091,200	
椿本興業	2,400	4,230.00	10,152,000	
住友商事	826,000	1,660.00	1,371,160,000	
内田洋行	5,600	7,610.00	42,616,000	
三菱商事	918,600	2,913.00	2,675,881,800	
第一実業	6,400	3,645.00	23,328,000	
キヤノンマーケティングジャパン	37,400	2,594.00	97,015,600	
西華産業	7,400	1,345.00	9,953,000	
佐藤商事	10,800	991.00	10,702,800	
菱洋エレクトロ	13,300	2,116.00	28,142,800	
東京産業	11,900	684.00	8,139,600	
ユアサ商事	12,400	3,650.00	45,260,000	

神鋼商事	3,300	2,742.00	9,048,600	
小林産業	7,900	287.00	2,267,300	
阪和興業	24,500	2,782.00	68,159,000	
正栄食品工業	8,500	3,970.00	33,745,000	
カナデン	10,600	1,347.00	14,278,200	
菱電商事	9,400	1,633.00	15,350,200	
フルサト工業	7,200	1,735.00	12,492,000	
岩谷産業	29,100	3,740.00	108,834,000	
すてきナイスグループ	5,500	1,305.00	7,177,500	
昭光通商	4,200	734.00	3,082,800	
ニチモウ	2,000	2,031.00	4,062,000	
極東貿易	3,800	2,172.00	8,253,600	
イワキ	17,200	485.00	8,342,000	
三愛石油	32,300	1,135.00	36,660,500	
稲畑産業	28,800	1,589.00	45,763,200	
ＧＳＩクレオス	3,200	1,342.00	4,294,400	
明和産業	12,100	609.00	7,368,900	
クワザワ	4,700	690.00	3,243,000	
ワキタ	27,900	1,101.00	30,717,900	
東邦ホールディングス	42,000	2,433.00	102,186,000	
サンゲツ	36,000	2,042.00	73,512,000	
ミツウロコグループホールディングス	19,300	1,150.00	22,195,000	
シナネンホールディングス	5,400	1,997.00	10,783,800	
伊藤忠エネクス	29,000	913.00	26,477,000	
サンリオ	36,800	2,181.00	80,260,800	
サンワテクノス	9,300	1,098.00	10,211,400	
リョーサン	14,500	2,732.00	39,614,000	
新光商事	20,600	889.00	18,313,400	
トーホー	5,900	1,920.00	11,328,000	
三信電気	7,000	1,779.00	12,453,000	
東陽テクニカ	15,100	1,300.00	19,630,000	
モスフードサービス	17,200	3,045.00	52,374,000	
加賀電子	13,000	2,515.00	32,695,000	
ソーダニッカ	13,600	646.00	8,785,600	
立花エレテック	9,700	1,835.00	17,799,500	
フォーバル	5,800	1,178.00	6,832,400	
ＰＡＬＴＡＣ	21,000	5,390.00	113,190,000	
三谷産業	17,300	342.00	5,916,600	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,400	3,575.00	8,580,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	2,487.00	2,735,700	
国際紙パルプ商事	31,100	295.00	9,174,500	
ヤマタネ	6,600	1,581.00	10,434,600	

丸紅建材リース	1,300	1,873.00	2,434,900	
日鉄物産	9,300	5,200.00	48,360,000	
泉州電業	4,000	3,320.00	13,280,000	
トラスコ中山	27,300	2,734.00	74,638,200	
オートバックスセブン	48,600	1,651.00	80,238,600	
モリト	9,600	778.00	7,468,800	
加藤産業	20,500	3,395.00	69,597,500	
北恵	2,500	912.00	2,280,000	
イノテック	7,800	1,230.00	9,594,000	
イエローハット	24,700	1,854.00	45,793,800	
ＪＫホールディングス	11,900	746.00	8,877,400	
日伝	11,900	2,089.00	24,859,100	
北沢産業	10,000	286.00	2,860,000	
杉本商事	7,100	2,031.00	14,420,100	
因幡電機産業	37,300	2,753.00	102,686,900	
東テク	4,300	2,791.00	12,001,300	
ミスミグループ本社	164,000	3,040.00	498,560,000	
アルテック	10,500	249.00	2,614,500	
タキヒヨー	4,000	1,914.00	7,656,000	
蔵王産業	2,500	1,484.00	3,710,000	
スズケン	55,400	4,420.00	244,868,000	
ジェコス	9,100	1,130.00	10,283,000	
グローセル	13,200	465.00	6,138,000	
ローソン	33,100	6,340.00	209,854,000	
サンエー	10,900	4,650.00	50,685,000	
カワチ薬品	10,300	2,161.00	22,258,300	
エービーシー・マート	20,500	7,150.00	146,575,000	
ハードオフコーポレーション	5,500	828.00	4,554,000	
アスクル	13,800	3,295.00	45,471,000	
ゲオホールディングス	23,800	1,290.00	30,702,000	
アダストリア	18,200	2,267.00	41,259,400	
ジーフット	8,300	619.00	5,137,700	
くら寿司	6,900	5,360.00	36,984,000	
キャンドゥ	6,400	1,619.00	10,361,600	
パルグループホールディングス	6,800	3,595.00	24,446,000	
エディオン	60,300	1,195.00	72,058,500	
サーラコーポレーション	27,000	641.00	17,307,000	
ワッツ	6,200	629.00	3,899,800	
ハローズ	5,000	2,636.00	13,180,000	
フジオフードシステム	11,200	1,834.00	20,540,800	
あみやき亭	2,900	3,695.00	10,715,500	
ひらまつ	25,000	276.00	6,900,000	

大黒天物産	3,200	3,645.00	11,664,000	
ハニーズホールディングス	11,700	1,486.00	17,386,200	
ファーマライズホールディングス	3,400	636.00	2,162,400	
アルペン	10,200	1,746.00	17,809,200	
ハブ	4,000	1,094.00	4,376,000	
クオールホールディングス	19,400	1,448.00	28,091,200	
ジンズホールディングス	7,000	7,760.00	54,320,000	
ビックカメラ	77,800	1,298.00	100,984,400	
ＤＣＭホールディングス	70,900	1,047.00	74,232,300	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	93,200	2,723.00	253,783,600	
東京一番フーズ	3,700	642.00	2,375,400	
ＤＤホールディングス	5,200	1,672.00	8,694,400	
きちりホールディングス	3,800	784.00	2,979,200	
アークランドサービスホールディングス	9,700	2,049.00	19,875,300	
Ｊ．フロント　リテイリング	156,500	1,499.00	234,593,500	
ドトール・日レスホールディングス	21,000	2,126.00	44,646,000	
マツモトキヨシホールディングス	54,200	4,480.00	242,816,000	
ブロンコビリー	6,900	2,814.00	19,416,600	
ＺＯＺＯ	90,100	1,938.00	174,613,800	
トレジャー・ファクトリー	4,100	967.00	3,964,700	
物語コーポレーション	3,300	9,130.00	30,129,000	
ココカラファイン	13,700	6,810.00	93,297,000	
三越伊勢丹ホールディングス	229,000	965.00	220,985,000	
Ｈａｍｅｅ	4,100	1,525.00	6,252,500	
ウエルシアホールディングス	39,000	6,590.00	257,010,000	
クリエイトＳＤホールディングス	19,400	2,923.00	56,706,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	15,300	366.00	5,599,800	
ティーライフ	2,000	894.00	1,788,000	
エー・ピーカンパニー	2,900	650.00	1,885,000	
チムニー	4,100	2,357.00	9,663,700	
シュッピン	9,100	1,218.00	11,083,800	
ネクステージ	18,900	1,162.00	21,961,800	
ジョイフル本田	38,500	1,316.00	50,666,000	
鳥貴族	4,400	2,525.00	11,110,000	
キリン堂ホールディングス	5,300	1,923.00	10,191,900	
ホットランド	8,900	1,336.00	11,890,400	
すかいらーくホールディングス	146,800	2,177.00	319,583,600	
ＳＦＰホールディングス	5,700	2,470.00	14,079,000	
綿半ホールディングス	5,000	1,820.00	9,100,000	
ヨシックス	2,200	2,955.00	6,501,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,300	980.00	37,534,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,400	677.00	4,332,800	

ＢＥＥＮＯＳ	5,122	1,288.00	6,597,136	
あさひ	9,900	1,338.00	13,246,200	
日本調剤	4,000	3,845.00	15,380,000	
コスモス薬品	5,800	24,700.00	143,260,000	
トーエル	6,600	788.00	5,200,800	
オンリー	2,500	810.00	2,025,000	
セブン&アイ・ホールディングス	512,200	4,285.00	2,194,777,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,300	2,307.00	81,437,100	
ツルハホールディングス	28,500	13,600.00	387,600,000	
サンマルクホールディングス	10,400	2,352.00	24,460,800	
フェリシモ	3,100	1,026.00	3,180,600	
トリドールホールディングス	16,300	2,790.00	45,477,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	12,200	563.00	6,868,600	
ウイルプラスホールディングス	2,300	917.00	2,109,100	
ジャパンミート	6,700	2,289.00	15,336,300	
サツドラホールディングス	2,100	1,865.00	3,916,500	
アレンザホールディングス	6,800	1,035.00	7,038,000	
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,384.00	5,006,400	
バロックジャパンリミテッド	9,300	1,098.00	10,211,400	
クスリのアオキホールディングス	13,000	6,970.00	90,610,000	
力の源ホールディングス	6,100	1,131.00	6,899,100	
スシローグローバルホールディングス	14,400	9,930.00	142,992,000	
ＬＩＸＩＬビバ	13,000	1,991.00	25,883,000	
メディカルシステムネットワーク	13,100	545.00	7,139,500	
はるやまホールディングス	6,400	873.00	5,587,200	
ノジマ	23,400	2,267.00	53,047,800	
カッパ・クリエイト	18,400	1,515.00	27,876,000	
ライトオン	9,800	621.00	6,085,800	
良品計画	173,900	2,077.00	361,190,300	
三城ホールディングス	14,700	311.00	4,571,700	
アドヴァン	20,200	1,198.00	24,199,600	
アルビス	5,100	2,260.00	11,526,000	
コナカ	16,000	415.00	6,640,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,800	1,696.00	3,052,800	
Ｇ－７ホールディングス	7,800	2,510.00	19,578,000	
イオン北海道	13,400	793.00	10,626,200	
コジマ	23,000	520.00	11,960,000	
ヒマラヤ	4,900	845.00	4,140,500	
コーナン商事	18,700	2,444.00	45,702,800	
エコス	5,000	1,720.00	8,600,000	
ワタミ	15,700	1,305.00	20,488,500	
マルシェ	3,800	787.00	2,990,600	

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	313,900	1,864.00	585,109,600	
西松屋チェーン	29,000	937.00	27,173,000	
ゼンショーホールディングス	62,800	2,459.00	154,425,200	
幸楽苑ホールディングス	8,400	2,163.00	18,169,200	
ハークスレイ	2,900	1,301.00	3,772,900	
サイゼリヤ	21,700	2,756.00	59,805,200	
ＶＴホールディングス	54,700	464.00	25,380,800	
魚力	3,800	1,586.00	6,026,800	
フジ・コーポレーション	3,600	2,200.00	7,920,000	
ユナイテッドアローズ	13,800	2,906.00	40,102,800	
ハイデイ日高	19,000	2,040.00	38,760,000	
京都きもの友禅	9,000	346.00	3,114,000	
コロワイド	43,600	2,327.00	101,457,200	
ピーシーデポコーポレーション	17,800	586.00	10,430,800	
壱番屋	9,300	5,930.00	55,149,000	
ＰＬＡＮＴ	3,700	616.00	2,279,200	
スギホールディングス	26,200	5,690.00	149,078,000	
薬王堂ホールディングス	5,800	2,272.00	13,177,600	
スクロール	20,800	388.00	8,070,400	
ヨンドシーホールディングス	13,400	2,481.00	33,245,400	
ファミリーマート	104,600	2,556.00	267,357,600	
木曽路	17,200	2,982.00	51,290,400	
ＳＲＳホールディングス	15,700	1,056.00	16,579,200	
タカキュー	11,400	186.00	2,120,400	
ケーヨー	27,200	559.00	15,204,800	
上新電機	15,500	2,464.00	38,192,000	
日本瓦斯	20,800	3,345.00	69,576,000	
ロイヤルホールディングス	23,000	2,483.00	57,109,000	
いなげや	16,300	1,475.00	24,042,500	
島忠	24,700	3,180.00	78,546,000	
チヨダ	13,900	1,542.00	21,433,800	
ライフコーポレーション	10,000	2,489.00	24,890,000	
リンガーハット	16,200	2,469.00	39,997,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	18,500	484.00	8,954,000	
テンアライド	12,100	442.00	5,348,200	
ＡＯＫＩホールディングス	26,400	1,067.00	28,168,800	
オークワ	20,700	1,444.00	29,890,800	
コメリ	20,300	2,233.00	45,329,900	
青山商事	27,200	1,509.00	41,044,800	
しまむら	15,300	8,080.00	123,624,000	
はせがわ	7,600	400.00	3,040,000	
高島屋	95,500	1,226.00	117,083,000	

松屋	26,600	830.00	22,078,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	62,100	1,194.00	74,147,400	
近鉄百貨店	5,100	3,765.00	19,201,500	
パルコ	12,700	1,848.00	23,469,600	
丸井グループ	120,000	2,671.00	320,520,000	
アクシアル　リテイリング	10,900	3,685.00	40,166,500	
イオン	503,800	2,341.00	1,179,395,800	
イズミ	26,700	3,840.00	102,528,000	
平和堂	26,700	2,023.00	54,014,100	
フジ	15,900	1,846.00	29,351,400	
ヤオコー	14,900	5,560.00	82,844,000	
ゼビオホールディングス	16,000	1,244.00	19,904,000	
ケーズホールディングス	126,500	1,394.00	176,341,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,200	635.00	4,572,000	
日産東京販売ホールディングス	20,100	282.00	5,668,200	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,500	2,256.00	14,664,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,305.00	3,132,000	
総合メディカルホールディングス	11,500	2,151.00	24,736,500	
ブックオフグループホールディングス	7,600	1,016.00	7,721,600	
アインホールディングス	17,600	6,460.00	113,696,000	
元気寿司	3,400	3,265.00	11,101,000	
ヤマダ電機	399,300	568.00	226,802,400	
アークランドサカモト	20,700	1,244.00	25,750,800	
ニトリホールディングス	56,700	17,125.00	970,987,500	
グルメ杵屋	9,500	1,226.00	11,647,000	
愛眼	10,400	251.00	2,610,400	
ケーユーホールディングス	7,100	918.00	6,517,800	
吉野家ホールディングス	43,100	2,633.00	113,482,300	
松屋フーズホールディングス	6,300	5,020.00	31,626,000	
サガミホールディングス	17,700	1,373.00	24,302,100	
関西スーパーマーケット	11,100	1,036.00	11,499,600	
王将フードサービス	9,600	6,700.00	64,320,000	
プレナス	14,800	1,947.00	28,815,600	
ミニストップ	9,800	1,547.00	15,160,600	
アークス	26,900	2,039.00	54,849,100	
バローホールディングス	29,100	2,013.00	58,578,300	
ベルク	6,500	5,800.00	37,700,000	
大庄	7,200	1,662.00	11,966,400	
ファーストリテイリング	17,500	64,200.00	1,123,500,000	
サンドラッグ	49,300	3,980.00	196,214,000	
サックスバー　ホールディングス	11,400	893.00	10,180,200	
ヤマザワ	3,200	1,678.00	5,369,600	

やまや	2,800	2,248.00	6,294,400	
ベルーナ	28,500	687.00	19,579,500	
島根銀行	2,600	657.00	1,708,200	
じもとホールディングス	88,600	111.00	9,834,600	
めぶきフィナンシャルグループ	681,200	258.00	175,749,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,700	1,410.00	24,957,000	
九州フィナンシャルグループ	215,100	469.00	100,881,900	
ゆうちょ銀行	371,400	1,035.00	384,399,000	
富山第一銀行	31,200	329.00	10,264,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	771,000	435.00	335,385,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	89,400	786.00	70,268,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	76,900	662.00	50,907,800	
三十三フィナンシャルグループ	12,100	1,642.00	19,868,200	
第四北越フィナンシャルグループ	22,800	2,908.00	66,302,400	
新生銀行	96,200	1,693.00	162,866,600	
あおぞら銀行	78,100	2,921.00	228,130,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,024,000	583.10	5,261,894,400	
りそなホールディングス	1,438,600	465.40	669,524,440	
三井住友トラスト・ホールディングス	247,800	4,186.00	1,037,290,800	
三井住友フィナンシャルグループ	906,600	3,978.00	3,606,454,800	
千葉銀行	450,900	630.00	284,067,000	
群馬銀行	257,600	369.00	95,054,400	
武蔵野銀行	19,500	1,784.00	34,788,000	
千葉興業銀行	35,900	367.00	13,175,300	
筑波銀行	54,500	224.00	12,208,000	
七十七銀行	44,300	1,695.00	75,088,500	
青森銀行	10,200	2,774.00	28,294,800	
秋田銀行	8,400	2,099.00	17,631,600	
山形銀行	14,700	1,520.00	22,344,000	
岩手銀行	8,600	2,707.00	23,280,200	
東邦銀行	117,200	256.00	30,003,200	
東北銀行	6,300	1,024.00	6,451,200	
みちのく銀行	8,400	1,471.00	12,356,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	110,400	2,010.00	221,904,000	
静岡銀行	324,600	788.00	255,784,800	
十六銀行	16,400	2,365.00	38,786,000	
スルガ銀行	134,100	454.00	60,881,400	
八十二銀行	316,400	445.00	140,798,000	
山梨中央銀行	15,200	1,092.00	16,598,400	
大垣共立銀行	25,900	2,284.00	59,155,600	
福井銀行	11,200	1,736.00	19,443,200	
北國銀行	13,500	3,265.00	44,077,500	

清水銀行	5,400	2,119.00	11,442,600	
富山銀行	2,500	2,294.00	5,735,000	
滋賀銀行	26,300	2,670.00	70,221,000	
南都銀行	21,800	2,658.00	57,944,400	
百五銀行	118,000	333.00	39,294,000	
京都銀行	46,900	4,570.00	214,333,000	
紀陽銀行	46,400	1,607.00	74,564,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	87,300	1,105.00	96,466,500	
広島銀行	193,500	511.00	98,878,500	
山陰合同銀行	77,700	626.00	48,640,200	
中国銀行	112,800	1,038.00	117,086,400	
鳥取銀行	4,500	1,357.00	6,106,500	
伊予銀行	187,000	592.00	110,704,000	
百十四銀行	13,900	2,007.00	27,897,300	
四国銀行	19,900	976.00	19,422,400	
阿波銀行	21,400	2,342.00	50,118,800	
大分銀行	7,500	2,668.00	20,010,000	
宮崎銀行	8,700	2,533.00	22,037,100	
佐賀銀行	8,000	1,620.00	12,960,000	
沖縄銀行	12,000	3,480.00	41,760,000	
琉球銀行	30,200	1,119.00	33,793,800	
セブン銀行	437,900	337.00	147,572,300	
みずほフィナンシャルグループ	17,813,000	166.00	2,956,958,000	
高知銀行	4,800	875.00	4,200,000	
山口フィナンシャルグループ	163,600	698.00	114,192,800	
長野銀行	4,300	1,619.00	6,961,700	
名古屋銀行	10,600	3,255.00	34,503,000	
北洋銀行	197,600	225.00	44,460,000	
愛知銀行	4,700	3,555.00	16,708,500	
中京銀行	5,400	2,210.00	11,934,000	
大光銀行	4,500	1,673.00	7,528,500	
愛媛銀行	18,300	1,146.00	20,971,800	
トマト銀行	5,100	1,066.00	5,436,600	
京葉銀行	55,900	606.00	33,875,400	
栃木銀行	63,300	216.00	13,672,800	
北日本銀行	4,100	2,150.00	8,815,000	
東和銀行	23,000	829.00	19,067,000	
福島銀行	12,300	257.00	3,161,100	
大東銀行	6,800	644.00	4,379,200	
トモニホールディングス	101,300	388.00	39,304,400	
フィデアホールディングス	127,300	128.00	16,294,400	
池田泉州ホールディングス	150,700	205.00	30,893,500	

ＦＰＧ	40,600	1,033.00	41,939,800	
マーキュリアインベストメント	6,100	739.00	4,507,900	
ＳＢＩホールディングス	146,500	2,458.00	360,097,000	
ジャフコ	20,200	4,110.00	83,022,000	
大和証券グループ本社	1,052,200	574.50	604,488,900	
野村ホールディングス	2,306,900	571.00	1,317,239,900	
岡三証券グループ	112,200	384.00	43,084,800	
丸三証券	39,300	493.00	19,374,900	
東洋証券	48,100	150.00	7,215,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	151,100	344.00	51,978,400	
光世証券	3,400	635.00	2,159,000	
水戸証券	38,800	223.00	8,652,400	
いちよし証券	24,800	651.00	16,144,800	
松井証券	75,100	882.00	66,238,200	
だいこう証券ビジネス	6,600	670.00	4,422,000	
マネックスグループ	99,600	288.00	28,684,800	
極東証券	17,800	754.00	13,421,200	
岩井コスモホールディングス	12,500	1,302.00	16,275,000	
藍澤證券	23,800	731.00	17,397,800	
マネーパートナーズグループ	14,700	245.00	3,601,500	
スパークス・グループ	46,100	278.00	12,815,800	
かんぽ生命保険	46,400	1,973.00	91,547,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	246,500	4,281.00	1,055,266,500	
アニコム　ホールディングス	10,800	3,825.00	41,310,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	342,800	3,685.00	1,263,218,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	107,700	2,573.00	277,112,100	
第一生命ホールディングス	741,800	1,741.50	1,291,844,700	
東京海上ホールディングス	468,800	6,109.00	2,863,899,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	391,800	1,300.00	509,340,000	
アドバンスクリエイト	3,100	1,866.00	5,784,600	
全国保証	36,900	4,735.00	174,721,500	
ジェイリース	3,600	445.00	1,602,000	
イントラスト	4,600	866.00	3,983,600	
日本モーゲージサービス	2,700	2,026.00	5,470,200	
Ｃａｓａ	4,500	1,501.00	6,754,500	
アルヒ	20,800	2,304.00	47,923,200	
プレミアグループ	7,100	2,148.00	15,250,800	
クレディセゾン	91,800	1,916.00	175,888,800	
芙蓉総合リース	13,700	7,230.00	99,051,000	
みずほリース	20,200	3,485.00	70,397,000	
東京センチュリー	26,400	5,820.00	153,648,000	
日本証券金融	57,800	521.00	30,113,800	

アイフル	200,000	298.00	59,600,000	
リコーリース	10,300	4,430.00	45,629,000	
イオンフィナンシャルサービス	80,200	1,726.00	138,425,200	
アコム	263,500	513.00	135,175,500	
ジャックス	14,500	2,709.00	39,280,500	
オリエントコーポレーション	354,600	173.00	61,345,800	
日立キャピタル	30,900	2,987.00	92,298,300	
アプラスフィナンシャル	62,900	99.00	6,227,100	
オリックス	819,900	1,878.00	1,539,772,200	
三菱ＵＦＪリース	332,700	703.00	233,888,100	
九州リースサービス	6,400	599.00	3,833,600	
日本取引所グループ	376,300	1,990.00	748,837,000	
イー・ギャランティ	14,000	1,323.00	18,522,000	
アサックス	6,800	742.00	5,045,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,300	2,659.00	14,092,700	
いちご	171,400	470.00	80,558,000	
日本駐車場開発	157,500	149.00	23,467,500	
スター・マイカ・ホールディングス	7,900	1,736.00	13,714,400	
ヒューリック	281,500	1,328.00	373,832,000	
三栄建築設計	6,500	1,502.00	9,763,000	
野村不動産ホールディングス	80,300	2,787.00	223,796,100	
三重交通グループホールディングス	29,900	610.00	18,239,000	
サムティ	19,600	1,894.00	37,122,400	
ディア・ライフ	20,300	611.00	12,403,300	
エー・ディー・ワークス	243,200	29.00	7,052,800	
日本商業開発	9,500	1,717.00	16,311,500	
ユニゾホールディングス	20,000	5,180.00	103,600,000	
ハウスコム	2,900	1,564.00	4,535,600	
日本管理センター	10,300	1,292.00	13,307,600	
サンセイランディック	6,100	903.00	5,508,300	
エストラスト	1,800	848.00	1,526,400	
フージャースホールディングス	26,100	708.00	18,478,800	
オープンハウス	38,700	3,000.00	116,100,000	
東急不動産ホールディングス	359,300	766.00	275,223,800	
飯田グループホールディングス	110,400	1,933.00	213,403,200	
イーグランド	4,400	853.00	3,753,200	
ムゲンエステート	11,600	763.00	8,850,800	
ハウスドゥ	7,200	1,431.00	10,303,200	
シーアールイー	5,000	1,180.00	5,900,000	
ケイアイスター不動産	5,100	2,060.00	10,506,000	
グッドコムアセット	4,100	2,085.00	8,548,500	
ジェイ・エス・ビー	1,800	5,740.00	10,332,000	

テンポイノベーション	4,900	939.00	4,601,100	
パーク２４	71,100	2,780.00	197,658,000	
パラカ	4,300	2,016.00	8,668,800	
三井不動産	647,300	2,757.50	1,784,929,750	
三菱地所	919,500	2,107.00	1,937,386,500	
平和不動産	24,700	3,125.00	77,187,500	
東京建物	144,500	1,733.00	250,418,500	
ダイビル	35,400	1,314.00	46,515,600	
京阪神ビルディング	22,700	1,435.00	32,574,500	
住友不動産	295,200	3,848.00	1,135,929,600	
テーオーシー	28,000	902.00	25,256,000	
東京楽天地	2,500	6,170.00	15,425,000	
スターツコーポレーション	18,600	2,721.00	50,610,600	
フジ住宅	18,100	690.00	12,489,000	
空港施設	16,800	570.00	9,576,000	
明和地所	10,400	624.00	6,489,600	
ゴールドクレスト	11,300	2,116.00	23,910,800	
エスリード	6,100	2,105.00	12,840,500	
日神グループホールディングス	23,100	562.00	12,982,200	
日本エスコン	26,000	939.00	24,414,000	
タカラレーベン	64,100	494.00	31,665,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	9,400	1,011.00	9,503,400	
イオンモール	66,800	2,035.00	135,938,000	
毎日コムネット	5,000	953.00	4,765,000	
ファースト住建	7,200	1,232.00	8,870,400	
カチタス	16,700	4,690.00	78,323,000	
トーセイ	19,500	1,511.00	29,464,500	
穴吹興産	4,000	1,724.00	6,896,000	
サンフロンティア不動産	19,700	1,317.00	25,944,900	
エフ・ジェー・ネクスト	13,300	1,165.00	15,494,500	
インテリックス	6,300	751.00	4,731,300	
ランドビジネス	5,500	725.00	3,987,500	
日本社宅サービス	5,100	1,126.00	5,742,600	
グランディハウス	14,300	499.00	7,135,700	
日本空港ビルデング	42,200	5,540.00	233,788,000	
日本工営	8,600	3,540.00	30,444,000	
ＬＩＦＵＬＬ	44,600	544.00	24,262,400	
ジェイエイシーリクルートメント	8,600	1,858.00	15,978,800	
日本M&Aセンター	96,000	4,030.00	386,880,000	
メンバーズ	3,800	2,121.00	8,059,800	
中広	1,600	548.00	876,800	
ＵＴグループ	15,000	3,190.00	47,850,000	

アイティメディア	4,000	913.00	3,652,000	
タケエイ	12,300	1,202.00	14,784,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,700	1,883.00	3,201,100	
ビーネックスグループ	14,100	1,321.00	18,626,100	
コシダカホールディングス	30,700	1,724.00	52,926,800	
アルトナー	3,300	929.00	3,065,700	
パソナグループ	15,600	1,596.00	24,897,600	
ＣＤＳ	3,200	1,615.00	5,168,000	
リンクアンドモチベーション	28,200	621.00	17,512,200	
ＧＣＡ	15,400	954.00	14,691,600	
エス・エム・エス	39,600	3,000.00	118,800,000	
サニーサイドアップグループ	3,000	1,164.00	3,492,000	
パーソルホールディングス	127,100	2,069.00	262,969,900	
リニカル	6,300	1,177.00	7,415,100	
クックパッド	44,800	340.00	15,232,000	
エスクリ	4,100	825.00	3,382,500	
アイ・ケイ・ケイ	6,400	742.00	4,748,800	
学情	4,600	2,430.00	11,178,000	
スタジオアリス	6,500	1,983.00	12,889,500	
シミックホールディングス	7,100	1,835.00	13,028,500	
エプコ	2,100	1,435.00	3,013,500	
ＮＪＳ	2,900	1,841.00	5,338,900	
綜合警備保障	50,600	5,960.00	301,576,000	
カカクコム	95,100	2,964.00	281,876,400	
アイロムグループ	4,500	1,445.00	6,502,500	
セントケア・ホールディング	8,500	485.00	4,122,500	
サイネックス	2,300	693.00	1,593,900	
ルネサンス	7,100	1,752.00	12,439,200	
ディップ	18,000	3,445.00	62,010,000	
オプトホールディング	7,000	1,595.00	11,165,000	
ツクイ	30,100	600.00	18,060,000	
キャリアデザインセンター	3,300	1,390.00	4,587,000	
ベネフィット・ワン	34,700	2,282.00	79,185,400	
エムスリー	280,000	3,310.00	926,800,000	
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	590.00	4,897,000	
ブラス	1,600	827.00	1,323,200	
アウトソーシング	72,800	1,093.00	79,570,400	
ウェルネット	12,200	710.00	8,662,000	
ワールドホールディングス	4,300	1,802.00	7,748,600	
ディー・エヌ・エー	62,300	1,816.00	113,136,800	
博報堂ＤＹホールディングス	176,700	1,701.00	300,566,700	
ぐるなび	22,200	979.00	21,733,800	

タカミヤ	13,700	672.00	9,206,400	
ジャパンベストレスキューシステム	8,600	1,140.00	9,804,000	
ファンコミュニケーションズ	35,200	474.00	16,684,800	
ライク	5,100	1,603.00	8,175,300	
ビジネス・ブレークスルー	5,700	417.00	2,376,900	
エスプール	24,600	901.00	22,164,600	
ＷＤＢホールディングス	5,800	2,780.00	16,124,000	
ティア	7,600	597.00	4,537,200	
ＣＤＧ	1,500	1,440.00	2,160,000	
バリューコマース	7,200	2,508.00	18,057,600	
インフォマート	139,300	1,000.00	139,300,000	
ＪＰホールディングス	40,300	332.00	13,379,600	
エコナックホールディングス	24,000	145.00	3,480,000	
ＥＰＳホールディングス	19,200	1,391.00	26,707,200	
レッグス	3,200	1,647.00	5,270,400	
プレステージ・インターナショナル	47,700	980.00	46,746,000	
アミューズ	7,000	3,015.00	21,105,000	
ドリームインキュベータ	3,900	1,579.00	6,158,100	
クイック	8,000	1,554.00	12,432,000	
ＴＡＣ	8,300	225.00	1,867,500	
ケネディクス	121,100	567.00	68,663,700	
電通グループ	131,000	3,805.00	498,455,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	1,130.00	5,650,000	
ぴあ	3,700	4,630.00	17,131,000	
イオンファンタジー	4,900	2,525.00	12,372,500	
シーティーエス	14,500	729.00	10,570,500	
ネクシィーズグループ	4,500	1,811.00	8,149,500	
みらかホールディングス	35,600	2,733.00	97,294,800	
アルプス技研	11,300	1,948.00	22,012,400	
ダイオーズ	2,600	1,388.00	3,608,800	
日本空調サービス	13,500	805.00	10,867,500	
オリエンタルランド	135,100	15,685.00	2,119,043,500	
ダスキン	32,700	3,035.00	99,244,500	
明光ネットワークジャパン	15,100	1,001.00	15,115,100	
ファルコホールディングス	7,100	1,847.00	13,113,700	
ラウンドワン	35,600	1,076.00	38,305,600	
リゾートトラスト	58,300	1,812.00	105,639,600	
ビー・エム・エル	16,400	3,055.00	50,102,000	
ワタベウェディング	2,300	558.00	1,283,400	
りらいあコミュニケーションズ	23,000	1,460.00	33,580,000	
リソー教育	58,400	374.00	21,841,600	
早稲田アカデミー	4,300	1,195.00	5,138,500	

ユー・エス・エス	142,300	2,015.00	286,734,500	
東京個別指導学院	4,700	701.00	3,294,700	
サイバーエージェント	73,100	3,800.00	277,780,000	
楽天	592,100	935.00	553,613,500	
クリーク・アンド・リバー社	6,700	1,171.00	7,845,700	
テー・オー・ダブリュー	11,300	1,094.00	12,362,200	
山田コンサルティンググループ	6,200	1,607.00	9,963,400	
セントラルスポーツ	4,800	3,185.00	15,288,000	
フルキャストホールディングス	12,800	2,469.00	31,603,200	
エン・ジャパン	22,600	4,795.00	108,367,000	
リソルホールディングス	1,400	4,155.00	5,817,000	
テクノプロ・ホールディングス	25,500	7,510.00	191,505,000	
アトラ	3,300	340.00	1,122,000	
インターワークス	2,700	559.00	1,509,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,200	5,400.00	28,080,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,800	1,332.00	6,393,600	
ファーストロジック	3,200	614.00	1,964,800	
三機サービス	2,800	1,032.00	2,889,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	9,000	1,233.00	11,097,000	
デザインワン・ジャパン	3,000	344.00	1,032,000	
イー・ガーディアン	6,500	2,124.00	13,806,000	
リブセンス	8,600	291.00	2,502,600	
ジャパンマテリアル	39,100	1,797.00	70,262,700	
ベクトル	16,000	1,138.00	18,208,000	
ウチヤマホールディングス	6,500	546.00	3,549,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	9,400	961.00	9,033,400	
ライクキッズ	3,200	777.00	2,486,400	
キャリアリンク	4,400	635.00	2,794,000	
ＩＢＪ	8,800	1,323.00	11,642,400	
アサンテ	5,200	2,048.00	10,649,600	
Ｎ・フィールド	8,900	654.00	5,820,600	
バリューＨＲ	2,500	3,295.00	8,237,500	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	9,000	4,650.00	41,850,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,900	2,122.00	10,397,800	
ＥＲＩホールディングス	3,800	762.00	2,895,600	
アビスト	2,000	2,769.00	5,538,000	
シグマクシス	8,700	2,237.00	19,461,900	
ウィルグループ	8,400	1,238.00	10,399,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,100	225.00	4,072,500	
リクルートホールディングス	909,800	4,206.00	3,826,618,800	
エラン	7,600	1,717.00	13,049,200	
土木管理総合試験所	5,800	457.00	2,650,600	

ネットマーケティング	4,700	1,016.00	4,775,200	
日本郵政	1,041,100	1,028.50	1,070,771,350	
ベルシステム２４ホールディングス	21,400	1,613.00	34,518,200	
鎌倉新書	9,500	1,696.00	16,112,000	
ＳＭＮ	2,200	905.00	1,991,000	
一蔵	1,500	789.00	1,183,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,400	2,589.00	11,391,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,100	771.00	1,619,100	
エアトリ	5,700	1,923.00	10,961,100	
アトラエ	3,300	3,995.00	13,183,500	
ストライク	4,800	5,310.00	25,488,000	
ソラスト	35,100	1,228.00	43,102,800	
セラク	4,100	1,243.00	5,096,300	
インソース	6,200	3,685.00	22,847,000	
ベイカレント・コンサルティング	7,700	7,870.00	60,599,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,600	1,418.00	3,686,800	
アイモバイル	4,200	765.00	3,213,000	
キャリアインデックス	5,600	421.00	2,357,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,200	1,539.00	6,463,800	
船場	2,200	1,087.00	2,391,400	
グレイステクノロジー	5,800	2,995.00	17,371,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13,400	2,741.00	36,729,400	
フルテック	1,900	1,364.00	2,591,600	
グリーンズ	4,900	1,050.00	5,145,000	
ツナググループ・ホールディングス	1,700	817.00	1,388,900	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	3,000	772.00	2,316,000	
ソウルドアウト	2,000	2,005.00	4,010,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,900	1,063.00	2,019,700	
日総工産	8,500	1,171.00	9,953,500	
キュービーネットホールディングス	7,800	2,438.00	19,016,400	
ＲＰＡホールディングス	7,300	1,102.00	8,044,600	
スプリックス	4,400	1,140.00	5,016,000	
マネジメントソリューションズ	1,400	3,155.00	4,417,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,500	1,004.00	6,526,000	
リログループ	69,500	3,050.00	211,975,000	
東祥	8,000	2,331.00	18,648,000	
エイチ・アイ・エス	19,800	2,929.00	57,994,200	
ラックランド	3,000	2,227.00	6,681,000	
共立メンテナンス	21,100	4,860.00	102,546,000	
イチネンホールディングス	14,300	1,635.00	23,380,500	
建設技術研究所	8,800	2,369.00	20,847,200	
スペース	8,300	1,268.00	10,524,400	

長大	4,800	1,335.00	6,408,000	
燦ホールディングス	5,600	1,449.00	8,114,400	
スバル興業	800	10,030.00	8,024,000	
東京テアトル	5,100	1,383.00	7,053,300	
タナベ経営	2,600	1,297.00	3,372,200	
ナガワ	4,100	7,460.00	30,586,000	
よみうりランド	2,800	4,505.00	12,614,000	
東京都競馬	8,400	3,300.00	27,720,000	
カナモト	20,800	2,777.00	57,761,600	
東京ドーム	51,600	1,061.00	54,747,600	
西尾レントオール	12,900	3,105.00	40,054,500	
トランス・コスモス	12,100	2,873.00	34,763,300	
乃村工藝社	54,500	1,322.00	72,049,000	
藤田観光	5,600	2,796.00	15,657,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	7,900	1,467.00	11,589,300	
日本管財	13,700	1,965.00	26,920,500	
トーカイ	12,300	2,629.00	32,336,700	
白洋舎	1,500	2,839.00	4,258,500	
セコム	134,800	9,690.00	1,306,212,000	
セントラル警備保障	6,100	5,940.00	36,234,000	
丹青社	24,100	1,319.00	31,787,900	
メイテック	15,700	6,270.00	98,439,000	
応用地質	13,800	1,440.00	19,872,000	
船井総研ホールディングス	26,300	2,722.00	71,588,600	
進学会ホールディングス	5,200	526.00	2,735,200	
オオバ	10,100	855.00	8,635,500	
いであ	2,400	2,918.00	7,003,200	
学究社	3,800	1,435.00	5,453,000	
ベネッセホールディングス	42,400	3,070.00	130,168,000	
イオンディライト	15,700	3,800.00	59,660,000	
ナック	7,200	1,008.00	7,257,600	
ニチイ学館	18,200	1,589.00	28,919,800	
ダイセキ	21,300	3,050.00	64,965,000	
ステップ	4,700	1,607.00	7,552,900	
合　計	155,710,528		326,748,299,106	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	282,711,583
コール・ローン	5,354,536,108
国債証券	397,747,228,001
派生商品評価勘定	26,745,488
未収入金	2,464,688
未収利息	2,885,253,641
前払費用	140,130,502
差入委託証拠金	211,464,564
流動資産合計	406,650,534,575
資産合計	406,650,534,575
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,858,500
前受金	959,619
未払金	5,687
未払解約金	373,344,823
未払利息	2,146
流動負債合計	377,170,775
負債合計	377,170,775
純資産の部	
元本等	
元本	141,679,824,519
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	264,593,539,281
元本等合計	406,273,363,800
純資産合計	406,273,363,800
負債純資産合計	406,650,534,575

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1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

	2020年 1月20日現在
	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。
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 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	141,679,824,519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 2.8675円 (1万口当たり純資産額) (28,675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 1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。
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 1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 1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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	91,483,392,692円
期中追加設定元本額	62,509,950,196円
期中一部解約元本額	12,313,518,369円
期末元本額	141,679,824,519円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,689,881,349円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	688,322,638円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,006,398,968円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,897,036円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,455,214,801円
世界経済インデックスファンド	6,689,763,647円
ＤＣマイセレクション２５	1,702,076,585円
ＤＣマイセレクション５０	1,294,867,794円
ＤＣマイセレクション７５	831,946,004円

区分	2020年 1月20日現在
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	1,938,284,715円
ＤＣマイセレクションＳ２５	685,327,844円
ＤＣマイセレクションＳ５０	531,262,675円
ＤＣマイセレクションＳ７５	242,427,942円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	48,697,997円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	68,339,372円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	32,632,956円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,958,987,619円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	611,484,286円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	31,987,808円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,747,312円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,138,242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）	46,626,802円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	92,073,128円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	137,813,524円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	152,774,848円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	335,226,966円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,014,527,437円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	597,425,357円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,127,720,248円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	852,112,883円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	75,409,913円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	601,562,557円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	34,983,381円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	222,572,323円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	290,769,644円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	931,346,094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）	2,056,785,309円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	890,520,865円
外国債券ファンド・シリーズ１	562,059,470円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,211,955,403円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,086,483,704円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,715,712,713円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,523,939,020円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	297,020,210円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,883,841,213円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,032,487,587円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	219,103,308円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,746,791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）	1,059,216,372円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	213,956,806円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	22,717,047,812円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	88,253,627円

区分	2020年 1月20日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	101,928,734円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	156,226,291円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,527,427円
グローバル経済コア	914,811,661円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	7,254,290円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	156,326円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	232,287,581円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	18,294,857円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	16,800円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	22,219円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	27,638円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	32,515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）	727,589,870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）	10,919,668,331円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	347,583,061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）	40,080,369,134円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 1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	8,107,142,982
合計	8,107,142,982

(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 1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	3,884,320,824	－	3,885,280,443	959,619
合計		3,884,320,824	－	3,885,280,443	959,619

(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 1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	5,111,000,931	－	5,133,928,300	22,927,369
	アメリカドル	2,610,838,371	－	2,625,315,800	14,477,429
	カナダドル	201,018,556	－	202,104,000	1,085,444
	ユーロ	1,950,032,592	－	1,957,222,500	7,189,908
	イギリスポンド	349,111,412	－	349,286,000	174,588
合計		5,111,000,931	－	5,133,928,300	22,927,369

(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% 02/28/21	6,500,000.00	6,465,722.64	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,734,347.64	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,964,160.15	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,778,125.00	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,485,302.73	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,497,390.62	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,941,796.90	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,975,293.01	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,473,466.78	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,676,689.48	

		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,965,234.40	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,481,152.35	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,937,187.52	
		T 1.375% 10/15/22	13,000,000.00	12,929,921.94	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,493,847.64	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,781,414.08	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,990,625.00	
		T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	13,017,468.81	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,451,523.48	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,065,511.73	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,504,921.87	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,228,650.00	
		T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,007,617.20	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,504,101.57	
		T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	14,399,347.72	
		T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	15,021,679.65	
		T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	9,009,843.75	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,250,382.84	
		T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,167,085.93	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,588,929.68	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,509,472.65	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,588,050.82	
		T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,246,812.52	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,815,882.82	
		T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,593,652.30	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,590,662.08	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,031,445.33	
		T 1.75% 06/30/24	12,600,000.00	12,668,906.25	
		T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,378,795.27	
		T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,198,371.14	
		T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,096,737.32	
		T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,210,570.29	
		T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,069,843.72	
		T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,515,527.35	
		T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,535,878.92	
		T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,521,435.57	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,068,554.71	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,240,278.12	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,031,406.24	
		T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,770,748.08	
		T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,429,953.15	
		T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,016,113.27	

		T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,285,199.19	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,552,625.00	
		T 2.125% 05/15/22	10,000,000.00	10,125,781.30	
		T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,286,875.00	
		T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	8,813,992.16	
		T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,557,275.40	
		T 2.125% 06/30/22	11,600,000.00	11,757,234.40	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,904,625.02	
		T 2.125% 08/15/21	14,950,000.00	15,071,468.75	
		T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,390,527.31	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,179,062.48	
		T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	12,928,151.53	
		T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,691,503.86	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,404,164.04	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,100,156.24	
		T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,370,781.28	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,254,160.20	
		T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,073,172.86	
		T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,148,828.10	
		T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,528,164.08	
		T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,389,648.40	
		T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,029,589.84	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,849,918.01	
		T 2.25% 08/15/46	18,760,000.00	18,560,675.00	
		T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	10,120,312.50	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,480,140.62	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,439,037.08	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,537,843.77	
		T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,167,328.12	
		T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,783,007.87	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,645,109.39	
		T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,350,976.60	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,933,924.98	
		T 2.375% 03/15/21	10,000,000.00	10,088,085.90	
		T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,607,138.71	
		T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,181,148.47	
		T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	19,561,523.43	
		T 2.375% 05/15/29	18,010,000.00	18,869,696.18	
		T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,911,621.12	
		T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,077,988.24	
		T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,268,652.40	
		T 2.5% 01/31/21	10,000,000.00	10,091,210.90	
		T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,517,792.95	

		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,208,398.45	
		T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,945,640.66	
		T 2.5% 02/15/45	11,110,000.00	11,520,549.26	
		T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	17,136,796.87	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,165,804.68	
		T 2.5% 05/15/24	15,900,000.00	16,481,343.75	
		T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	16,625,000.00	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,692,898.43	
		T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,082,812.50	
		T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	18,959,062.50	
		T 2.625% 02/15/29	20,000,000.00	21,360,937.60	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,444,187.50	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,601,738.31	
		T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,720,722.25	
		T 2.625% 06/15/21	10,000,000.00	10,141,210.90	
		T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,415,304.67	
		T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,400,380.85	
		T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	11,946,074.19	
		T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,580,011.67	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,134,296.89	
		T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,161,312.55	
		T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,881,734.35	
		T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	20,757,031.20	
		T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,092,675.75	
		T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,237,187.50	
		T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,195,507.84	
		T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,250,781.25	
		T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	10,882,812.50	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,297,558.61	
		T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,225,000.00	
		T 2.75% 11/15/23	13,900,000.00	14,487,492.25	
		T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,549,453.14	
		T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	9,901,972.70	
		T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,616,406.30	
		T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,459,845.38	
		T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	12,712,890.62	
		T 2.875% 05/15/49	3,800,000.00	4,279,750.00	
		T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,410,203.17	
		T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,062,335.98	
		T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,283,150.00	
		T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	12,107,515.62	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,966,718.75	

		T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,517,729.50	
		T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,510,898.41	
		T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,542,278.28	
		T 2.875% 11/30/23	8,020,000.00	8,399,696.87	
		T 2% 01/15/21	8,000,000.00	8,031,875.04	
		T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,521,679.70	
		T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,151,875.00	
		T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,545,687.50	
		T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,017,265.64	
		T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,157,812.50	
		T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,820,410.14	
		T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,127,812.48	
		T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,669,394.50	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,032,226.57	
		T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,515,730.43	
		T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,844,093.78	
		T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,690,609.37	
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,418,375.00	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,394,857.86	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,023,750.00	
		T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,217,531.25	
		T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,703,417.98	
		T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,751,562.50	
		T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,403,929.71	
		T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,518,828.12	
		T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	13,861,875.00	
		T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	15,949,125.07	
		T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,737,246.11	
		T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	7,941,295.31	
		T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	10,220,671.87	
		T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	4,776,178.12	
		T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,336,091.78	
		T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	9,353,320.35	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,488,125.00	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,515,781.26	
		T 3.75% 11/15/43	8,500,000.00	10,784,375.00	
		T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	4,022,894.54	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,103,593.75	
		T 3% 02/15/49	14,970,000.00	17,249,416.48	
		T 3% 05/15/42	6,130,000.00	6,914,927.36	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,968,945.33	
		T 3% 05/15/47	12,750,000.00	14,592,773.43	
		T 3% 08/15/48	11,950,000.00	13,734,097.71	

		T 3% 09/30/25	15,000,000.00	16,075,781.25	
		T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,723,828.10	
		T 3% 11/15/44	6,050,000.00	6,849,734.37	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,201,007.81	
		T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	5,832,058.61	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,347,500.00	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,584,593.75	
		T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,617,250.00	
		T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,664,617.20	
		T 4.5% 02/15/36	3,840,000.00	5,147,100.01	
		T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,189,250.00	
		T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,340,687.50	
		T 4.625% 02/15/40	8,700,000.00	12,188,835.98	
		T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,215,734.37	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,575,148.44	
		T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,611,230.47	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,667,046.87	
		T 5.375% 02/15/31	3,300,000.00	4,464,281.25	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,554,937.50	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,124,203.12	
		T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,915,359.37	
		T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,691,023.44	
		T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,915,740.23	
		T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,894,337.89	
	アメリカドル 小計		1,663,740,000.00	1,740,657,815.23 (191,803,084,660)	
	カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,026,731.50	
		CAN 0.75% 03/01/21	5,690,000.00	5,629,970.50	
		CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,660,728.50	
		CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	445,861.90	
		CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,866,492.20	
		CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,206,503.10	
		CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,188,672.00	
		CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,289,374.00	
		CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	597,894.00	
		CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,016,120.00	
		CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,701,674.00	
		CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,891,534.90	
		CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,475,857.50	
		CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,360,053.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	3,932,259.00	
		CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,030,098.50	

	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,736,358.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,035,990.60	
	CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,569,476.40	
	CAN 2.75% 12/01/64	1,150,000.00	1,545,002.00	
	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,211,786.30	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,139,329.00	
	CAN 2% 12/01/51	1,490,000.00	1,612,440.75	
	CAN 3.25% 06/01/21	8,130,000.00	8,298,738.15	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,589,472.60	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	3,857,353.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	2,948,791.30	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,690,000.00	4,022,572.20	
	CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,482,343.20	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,669,966.25	
カナダドル 小計		82,720,000.00	91,039,444.85 (7,678,266,778)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,928,638.75	
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,130,202.20	
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	36,193,910.40	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,467,667.50	
	MBONO 6.5% 06/10/21	77,190,000.00	76,960,745.70	
	MBONO 6.75% 03/09/23	10,400,000.00	10,400,364.00	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	30,460,070.40	
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	56,284,166.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,918,232.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	38,572,282.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	21,130,517.20	
	MBONO 8.5% 05/31/29	44,000,000.00	49,121,820.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	30,870,000.00	35,401,407.30	
	MBONO 8% 09/05/24	26,970,000.00	28,305,015.00	
	MBONO 8% 11/07/47	26,770,000.00	29,588,613.30	
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,613,687.50	
メキシコペソ 小計		575,930,000.00	608,477,340.25 (3,596,101,080)	
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,255,099.00	
	BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,363,648.85	
	BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,287,875.50	
	BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,327,451.20	
	BGB 0.8% 06/22/28	3,910,000.00	4,194,081.05	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,590,000.00	2,804,076.45	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	959,786.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	980,000.00	1,132,135.20	
	BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,709,943.40	

		BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,524,881.25	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,610,000.00	1,990,088.80	
		BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,162,685.95	
		BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,631,550.00	
		BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,410,265.00	
		BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,914,043.30	
		BGB 2.25% 06/22/57	920,000.00	1,287,885.00	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,767,484.60	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,720,408.00	
		BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,060,791.70	
		BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	5,780,881.15	
		BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,543,040.75	
		BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,718,867.95	
		BGB 4.5% 03/28/26	2,020,000.00	2,620,192.50	
		BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,412,836.50	
		BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,309,162.10	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,062,997.80	
		BGB 5% 03/28/35	3,770,000.00	6,344,042.90	
		BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	2,980,083.60	
		BKO 0% 06/11/21	2,640,000.00	2,661,634.80	
		BTPS 0.05% 04/15/21	4,910,000.00	4,924,189.90	
		BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,596,873.20	
		BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,411,424.00	
		BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,254,341.30	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,240,197.40	
		BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,571,277.50	
		BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,634,290.00	
		BTPS 1.2% 04/01/22	4,010,000.00	4,108,204.90	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,988,736.75	
		BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,979,837.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,382,409.00	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,085,306.25	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,492,892.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	4,210,000.00	4,372,169.20	
		BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,757,896.00	
		BTPS 1.65% 03/01/32	6,650,000.00	6,735,718.50	
		BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,204,400.00	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,111,860.00	
		BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,676,446.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,119,981.25	
		BTPS 2.1% 07/15/26	5,170,000.00	5,545,807.30	
		BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,601,775.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	6,810,867.00	

		BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,785,640.25	
		BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,808,378.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,728,375.00	
		BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,254,307.20	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,225,707.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,962,240.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,229,545.00	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	1,960,264.90	
		BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,459,040.50	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,254,680.00	
		BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,762,587.75	
		BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,359,333.25	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,231,687.70	
		BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,147,727.50	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,740,000.00	3,279,656.70	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,840,000.00	3,476,003.80	
		BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	7,719,215.00	
		BTPS 3.75% 03/01/21	2,450,000.00	2,558,988.25	
		BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,748,839.15	
		BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,458,413.75	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,455,676.25	
		BTPS 3.85% 09/01/49	2,960,000.00	3,851,788.80	
		BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,422,056.00	
		BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,403,276.75	
		BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,489,666.80	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,429,795.50	
		BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,846,548.00	
		BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,256,243.50	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,686,547.80	
		BTPS 4.75% 09/01/44	3,650,000.00	5,312,118.75	
		BTPS 4% 02/01/37	5,220,000.00	6,744,553.20	
		BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,278,623.50	
		BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,466,388.60	
		BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,873,654.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,954,786.75	
		BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	5,799,992.25	
		BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,290,360.00	
		BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	6,866,162.50	
		BTPS 5% 08/01/34	4,620,000.00	6,507,662.70	
		BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	5,874,526.50	
		BTPS 6.5% 11/01/27	7,520,000.00	10,544,957.60	
		BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,050,672.00	

		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,975,659.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,057,712.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	5,690,000.00	5,959,364.60	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,685,710.60	
		DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,369,040.00	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	3,986,852.60	
		DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,296,650.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,228,593.10	
		DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	4,966,781.25	
		DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,103,294.40	
		DBR 0% 08/15/29	4,660,000.00	4,774,729.20	
		DBR 0% 08/15/50	900,000.00	821,479.50	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,370,000.00	4,280,472.90	
		DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,613,077.00	
		DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,156,514.75	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,495,115.30	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,955,652.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,806,840.75	
		DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,507,591.75	
		DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,427,424.00	
		DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,333,526.00	
		DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,040,441.00	
		DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	2,987,884.50	
		DBR 2.5% 07/04/44	5,550,000.00	8,602,389.00	
		DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	8,232,770.00	
		DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,471,616.50	
		DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,208,916.25	
		DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,762,168.50	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,840,000.00	4,785,059.20	
		DBR 4.0% 01/04/37	4,360,000.00	7,305,572.40	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	4,878,022.50	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,661,379.25	
		DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,038,655.75	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,960,000.00	5,753,751.60	
		DBR 5.5% 01/04/31	3,340,000.00	5,460,549.30	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,649,520.70	
		DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,547,320.00	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,072,562.50	
		DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	988,318.50	
		FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,034,947.75	
		FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,201,979.20	
		FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	10,896,756.00	
		FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,328,580.00	

		FRTR 0.75% 05/25/28	9,010,000.00	9,646,421.35	
		FRTR 0.75% 11/25/28	6,360,000.00	6,810,510.60	
		FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,037,650.00	
		FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,023,900.00	
		FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,182,490.00	
		FRTR 0% 03/25/24	11,150,000.00	11,358,393.50	
		FRTR 0% 03/25/25	6,090,000.00	6,196,879.50	
		FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,132,123.50	
		FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,622,732.75	
		FRTR 0% 11/25/29	3,660,000.00	3,645,103.80	
		FRTR 1.25% 05/25/34	4,650,000.00	5,257,824.75	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,950,000.00	6,713,474.25	
		FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,179,779.40	
		FRTR 1.5% 05/25/50	4,850,000.00	5,662,035.50	
		FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,939,872.75	
		FRTR 1.75% 05/25/66	2,290,000.00	2,913,154.80	
		FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	4,938,839.40	
		FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,619,672.40	
		FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,223,529.25	
		FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,748,028.00	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,583,390.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,186,945.10	
		FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	9,963,731.00	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,630,000.00	6,910,796.85	
		FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,291,201.40	
		FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,025,810.00	
		FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,587,149.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	7,550,000.00	9,346,711.25	
		FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	11,994,497.25	
		FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,212,079.60	
		FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,375,968.75	
		FRTR 4.5% 04/25/41	6,860,000.00	12,222,016.10	
		FRTR 4.75% 04/25/35	5,600,000.00	9,276,316.00	
		FRTR 4% 04/25/55	3,480,000.00	6,702,862.80	
		FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	4,933,822.25	
		FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	7,948,934.40	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,150,000.00	7,805,314.25	
		FRTR 5.75% 10/25/32	6,340,000.00	10,798,890.30	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,595,542.50	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,297,960.00	
		IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	842,828.80	
		IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,842,798.60	

		IRISH 0% 10/18/22	1,510,000.00	1,529,479.00	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,330,000.00	1,460,047.40	
		IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	877,211.40	
		IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	1,002,375.85	
		IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	1,011,309.75	
		IRISH 1.7% 05/15/37	1,050,000.00	1,251,080.25	
		IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,191,765.80	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,990,000.00	2,452,416.30	
		IRISH 2% 02/18/45	1,560,000.00	2,010,949.20	
		IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,701,914.55	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,468,432.80	
		IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,066,377.10	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	2,984,025.60	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,657,536.00	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,341,734.40	
		NETHER 0.5% 07/15/26	3,070,000.00	3,240,139.40	
		NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	4,876,318.50	
		NETHER 0.75% 07/15/28	3,090,000.00	3,342,514.80	
		NETHER 0% 01/15/22	3,970,000.00	4,016,389.45	
		NETHER 0% 01/15/24	2,830,000.00	2,887,024.50	
		NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,189,023.75	
		NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,778,665.10	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,670,000.00	3,529,192.65	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,920,000.00	4,779,587.40	
		NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,347,541.40	
		NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,098,387.10	
		NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,584,097.10	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,095,619.00	
		NETHER 4% 01/15/37	3,000,000.00	4,943,850.00	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,380,000.00	2,018,332.80	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	248,908.00	
		OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,036,968.50	
		OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,686,106.25	
		OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,482,129.00	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,262,501.90	
		OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,547,288.35	
		OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,626,702.00	
		OBL 0% 10/13/23	3,710,000.00	3,790,191.65	
		OBL 0% 10/18/24	3,320,000.00	3,402,784.20	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,190,000.00	1,249,166.80	
		RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,206,900.50	
		RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,073,712.60	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,000,000.00	2,135,660.00	

		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,526,587.50	
		RAGB 0% 07/15/24	880,000.00	896,099.60	
		RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,116,571.50	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,861,164.00	
		RAGB 1.5% 02/20/47	1,300,000.00	1,603,868.50	
		RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	825,004.80	
		RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,054,185.65	
		RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,527,339.35	
		RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	1,642,575.00	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,490,000.00	1,946,021.95	
		RAGB 3.15% 06/20/44	1,270,000.00	2,052,732.75	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,838,558.00	
		RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,317,657.65	
		RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,531,147.85	
		RAGB 3.8% 01/26/62	760,000.00	1,609,311.40	
		RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,337,757.60	
		RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,797,159.80	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,753,987.40	
		RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,226,452.50	
		RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,103,093.25	
		RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	704,334.15	
		RFGB 0.5% 09/15/29	740,000.00	777,410.70	
		RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	935,163.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	736,861.35	
		RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	860,960.75	
		RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,486,608.50	
		RFGB 0% 09/15/24	750,000.00	764,186.25	
		RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	866,423.25	
		RFGB 1.375% 04/15/47	700,000.00	856,600.50	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	693,023.50	
		RFGB 1.625% 09/15/22	1,260,000.00	1,333,527.30	
		RFGB 2.625% 07/04/42	870,000.00	1,287,443.40	
		RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,143,587.60	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	806,496.70	
		RFGB 3.5% 04/15/21	1,040,000.00	1,092,956.80	
		RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,402,550.35	
		SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,618,018.00	
		SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,734,028.00	
		SPGB 0.25% 07/30/24	3,690,000.00	3,742,951.50	
		SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,870,557.10	
		SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,335,120.40	
		SPGB 0.45% 10/31/22	4,210,000.00	4,297,715.35	

		SPGB 0.6% 10/31/29	4,280,000.00	4,337,180.80	
		SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,238,951.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	4,950,000.00	5,323,378.50	
		SPGB 1.4% 04/30/28	5,830,000.00	6,339,425.40	
		SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,416,692.50	
		SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,148,808.60	
		SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,833,636.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,328,663.25	
		SPGB 1.6% 04/30/25	4,310,000.00	4,671,867.60	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,746,134.75	
		SPGB 1.95% 04/30/26	4,020,000.00	4,477,194.60	
		SPGB 1.95% 07/30/30	4,580,000.00	5,249,412.80	
		SPGB 2.15% 10/31/25	4,570,000.00	5,115,178.15	
		SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,269,240.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,040,928.40	
		SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	4,989,160.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	4,632,643.75	
		SPGB 3.45% 07/30/66	2,220,000.00	3,473,767.20	
		SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,860,535.75	
		SPGB 4.2% 01/31/37	3,840,000.00	5,832,998.40	
		SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	4,980,660.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	4,977,228.70	
		SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	6,697,504.20	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,655,013.25	
		SPGB 4.9% 07/30/40	3,490,000.00	5,945,808.30	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,575,268.80	
		SPGB 5.15% 10/31/44	2,890,000.00	5,294,711.20	
		SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,692,858.20	
		SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,429,905.30	
		SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	6,953,745.00	
		SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,820,243.00	
		SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,773,637.80	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,572,957.75	
	ユーロ 小計		1,025,840,000.00	1,212,762,228.55 (148,248,054,817)	
	イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,748,679.80	
		UKT 0.625% 06/07/25	2,170,000.00	2,191,103.25	
		UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	6,003,027.95	
		UKT 0.875% 10/22/29	3,140,000.00	3,214,056.90	
		UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,176,262.00	
		UKT 1.5% 01/22/21	7,380,000.00	7,454,796.30	
		UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,383,576.50	
		UKT 1.5% 07/22/47	5,520,000.00	5,971,425.60	

		UKT 1.625% 10/22/28	6,650,000.00	7,262,265.50	
		UKT 1.625% 10/22/54	1,950,000.00	2,239,575.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,481,208.00	
		UKT 1.75% 01/22/49	2,450,000.00	2,810,027.50	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,324,571.25	
		UKT 1.75% 09/07/22	4,170,000.00	4,319,848.95	
		UKT 1.75% 09/07/37	5,390,000.00	6,002,223.15	
		UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,155,473.35	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,667,250.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,332,999.85	
		UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,713,093.25	
		UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,365,940.15	
		UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,718,845.75	
		UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	5,068,392.00	
		UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	7,048,565.30	
		UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,630,054.40	
		UKT 3.75% 09/07/21	3,630,000.00	3,826,346.70	
		UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,394,416.60	
		UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,228,155.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	2,990,000.00	4,674,745.40	
		UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	865,060.45	
		UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,838,367.50	
		UKT 4.25% 12/07/46	3,400,000.00	5,830,252.00	
		UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,871,182.35	
		UKT 4.25% 12/07/55	3,150,000.00	6,096,210.75	
		UKT 4.5% 09/07/34	2,820,000.00	4,214,687.40	
		UKT 4.5% 12/07/42	3,600,000.00	6,046,344.00	
		UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,873,172.65	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,111,858.00	
		UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,762,382.50	
		UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,099,516.25	
		UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,080,962.50	
		UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,841,100.00	
		UKT 8% 06/07/21	740,000.00	816,923.00	
	イギリスポンド 小計		141,500,000.00	182,754,944.75 (26,179,645,835)	
	スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,890,000.00	8,360,283.45	
		SGB 0.75% 11/12/29	8,450,000.00	8,950,493.50	
		SGB 1.5% 11/13/23	19,090,000.00	20,362,348.50	
		SGB 1% 11/12/26	13,470,000.00	14,449,807.80	
		SGB 2.5% 05/12/25	12,740,000.00	14,545,066.90	
		SGB 3.5% 03/30/39	8,580,000.00	13,219,334.70	

	SGB 3.5% 06/01/22	16,620,000.00	18,125,439.60	
スウェーデンクローナ 小計		86,840,000.00	98,012,774.45 (1,134,987,928)	
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	8,650,000.00	8,727,114.75	
	NGB 1.75% 02/17/27	8,210,000.00	8,423,706.30	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	5,922,293.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	5,420,000.00	5,585,011.90	
	NGB 2% 04/26/28	6,410,000.00	6,717,519.75	
	NGB 2% 05/24/23	14,500,000.00	14,811,025.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	16,540,000.00	17,055,469.10	
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,611,277.00	
ノルウェークローネ 小計		75,480,000.00	77,853,416.80 (963,046,765)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,215,972.30	
	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	18,655,748.10	
	DGB 0.5% 11/15/29	7,700,000.00	8,253,861.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	13,440,000.00	14,510,697.60	
	DGB 1.75% 11/15/25	12,310,000.00	13,916,701.20	
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	13,824,108.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	25,310,000.00	47,530,028.65	
デンマーククローネ 小計		92,320,000.00	119,907,116.85 (1,961,680,431)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,560,000.00	7,582,226.40	
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,772,219.10	
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,880,000.00	2,913,494.40	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	5,985,023.10	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	6,972,520.65	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,529,004.60	
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	6,873,242.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,520,000.00	6,733,725.60	
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,620,000.00	3,753,958.10	
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,601,721.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,592,181.05	
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,732,595.60	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	779,967.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,750,000.00	5,248,037.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,645,293.00	
ポーランドズロチ 小計		78,070,000.00	80,715,210.20 (2,327,826,662)	
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	2,470,000.00	2,542,469.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,312,837.00	
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,053,508.30	
	ACGB 2.5% 05/21/30	5,280,000.00	5,950,718.40	

	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,551,284.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	952,380.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,695,915.65	
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,474,241.25	
	ACGB 2.75% 11/21/28	5,410,000.00	6,140,945.10	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,111,338.40	
	ACGB 2% 12/21/21	5,120,000.00	5,239,936.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,585,866.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	5,900,000.00	6,977,753.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,890,000.00	2,410,298.10	
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,113,590.80	
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,125,370.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	6,300,000.00	7,561,008.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,686,030.75	
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,129,449.20	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,130,000.00	4,757,408.95	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,185,351.75	
	ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	5,985,963.10	
オーストラリアドル 小計		90,110,000.00	103,543,664.95 (7,847,574,366)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	986,737.95	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	807,016.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	1,150,000.00	1,157,394.50	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,050,000.00	1,085,343.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,607,251.50	
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	769,098.80	
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	657,625.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	279,579.30	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,127,185.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,499,513.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	1,060,000.00	1,202,405.70	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,668,280.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	670,000.00	737,140.70	
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	742,329.85	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	418,087.25	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,147,371.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,140,000.00	1,350,951.30	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,550,000.00	1,745,734.00	
	SIGB 3% 09/01/24	1,570,000.00	1,674,632.65	
シンガポールドル 小計		19,340,000.00	20,663,678.40 (1,689,668,982)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,524,425.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	709,215.50	

		MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,732,913.00	
		MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,755,243.45	
		MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,721,836.15	
		MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	1,992,416.20	
		MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	357,189.00	
		MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,527,675.00	
		MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,233,865.00	
		MGS 3.844% 04/15/33	2,810,000.00	2,907,984.70	
		MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	763,616.25	
		MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,062,511.95	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,176,092.70	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,054,985.80	
		MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,700,299.60	
		MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,811,739.50	
		MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,085,403.50	
		MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,974,660.50	
		MGS 4.127% 04/15/32	3,800,000.00	4,041,452.00	
		MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,764,065.50	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,615,999.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,146,880.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,511,755.00	
		MGS 4.392% 04/15/26	3,530,000.00	3,758,373.35	
		MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,332,554.40	
		MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,687,320.00	
		MGS 4.736% 03/15/46	2,270,000.00	2,549,039.75	
		MGS 4.762% 04/07/37	3,370,000.00	3,873,713.90	
		MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	937,460.00	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,805,168.75	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,671,429.60	
		MGS 5.248% 09/15/28	1,140,000.00	1,301,971.20	
	マレーシアリンギット 小計		67,230,000.00	71,089,255.25 (1,930,073,280)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	46,150,000.00	51,733,457.75	
		SAGB 6.25% 03/31/36	17,080,000.00	12,225,351.60	
		SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,260,307.75	
		SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,715,408.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	20,750,000.00	21,163,340.00	
		SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,851,187.65	
		SAGB 8.25% 03/31/32	33,120,000.00	30,390,746.40	
		SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	23,970,221.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	23,736,101.20	
		SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	39,133,044.00	

		SAGB 8.875% 02/28/35	28,520,000.00	26,581,923.40	
		SAGB 8% 01/31/30	31,310,000.00	29,260,447.40	
		SAGB 9% 01/31/40	19,620,000.00	17,850,864.60	
	南アフリカランド 小計		340,370,000.00	312,872,400.75 (2,387,216,417)	
合計				397,747,228,001 (397,747,228,001)	

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　204銘柄	100.0%	48.2%
カナダドル	国債証券　30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券　16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券　297銘柄	100.0%	37.3%
イギリスポンド	国債証券　42銘柄	100.0%	6.6%
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　8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　22銘柄	100.0%	2.0%
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　32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券　13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,955,125,215
コール・ローン	1,379,195,620
株式	394,997,447,530
投資信託受益証券	300,191,800
投資証券	10,705,173,627
派生商品評価勘定	270,697,776
未収入金	1
未収配当金	299,183,460
差入委託証拠金	1,874,609,974
流動資産合計	419,781,625,003
資産合計	419,781,625,003
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	599,998
前受金	267,854,318
未払解約金	912,174,114
未払利息	552
流動負債合計	1,180,628,982
負債合計	1,180,628,982
純資産の部	
元本等	
元本	141,149,497,764
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	277,451,498,257
元本等合計	418,600,996,021
純資産合計	418,600,996,021
負債純資産合計	419,781,625,003

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1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

	2020年 1月20日現在
	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 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 1月20日現在
1．　計算期間の末日における受益権の総数	141,149,497,764口

	2020年 1月20日現在	
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	2.9657円
	(1万口当たり純資産額)	(29,657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 1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 1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。

	2020年 1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	(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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	141,058,766,855円
期中追加設定元本額	23,858,444,019円
期中一部解約元本額	23,767,713,110円
期末元本額	141,149,497,764円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,390,187,399円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,893,375円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	25,798,478,245円
世界経済インデックスファンド	7,440,741,384円
外国株式インデックス・オープン	648,785,530円

区分	2020年 1月20日現在
ＤＣマイセレクション２５	1,089,454,460円
ＤＣマイセレクション５０	4,794,545,753円
ＤＣマイセレクション７５	4,993,152,340円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	8,792,383,738円
ＤＣマイセレクションＳ２５	429,309,786円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,958,559,156円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,449,456,937円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	110,392,384円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	196,654,078円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	129,992,820円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,688,919,173円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,891,071,009円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,057,136円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,144,782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）	38,586,502円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	40,922,929円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	148,612,591円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	31,470,073円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	207,145,386円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	627,080,633円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	336,507,368円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,225,349,882円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,705,255,989円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	64,710,090円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	321,004,422円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	7,863,163円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	102,506,742円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,805,529,064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）	1,923,957,810円
外国株式ファンド・シリーズ１	999,585,968円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,262,207,614円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,508,807,799円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,488,858,275円
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,633,634,186円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,011,081,626円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,101,331,619円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,505,453,418円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	748,449,933円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	40,736,684円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	247,951,709円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,256,342,909円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	29,611,751,672円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	97,720,924円

区分	2020年 1月20日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	344,728,012円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	58,834,251円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,608,981円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	54,326,217円
グローバル経済コア	898,506,723円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	8,258,223円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	772,204円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,457,720円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	65,377,187円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	58,867円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	66,613円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	74,359円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	81,330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）	1,171,841,682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）	741,635,435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）	1,591,013,175円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	73,893,487円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	341,366,833円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	54,032,354,997
投資信託受益証券	31,474,696
投資証券	776,295,338
合計	54,840,125,031

(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 1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	12,412,588,561	－	12,680,442,879	267,854,318
合計		12,412,588,561	－	12,680,442,879	267,854,318

(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 1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	1,060,166,540	－	1,061,248,490	1,081,950
	アメリカドル	758,342,490	－	759,902,490	1,560,000
	カナダドル	42,144,000	－	42,165,000	21,000
	ユーロ	134,801,200	－	134,464,000	△337,200
	イギリスポンド	71,668,000	－	71,620,000	△48,000
	スイスフラン	34,211,100	－	34,152,000	△59,100
	オーストラリアドル	18,999,750	－	18,945,000	△54,750
	売建	491,249,510	－	490,088,000	1,161,510
	アメリカドル	341,911,400	－	341,527,000	384,400
	ユーロ	49,141,040	－	48,896,000	245,040
	イギリスポンド	43,260,540	－	42,972,000	288,540
	スウェーデンクローナ	56,936,530	－	56,693,000	243,530
合計		1,551,416,050	－	1,551,336,490	2,243,460

(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	34,273	32.67	1,119,698.91	

BAKER HUGHES CO	57,644	23.61	1,360,974.84	
CABOT OIL & GAS CORP	35,879	16.81	603,125.99	
CHENIERE ENERGY INC	19,927	66.00	1,315,182.00	
CHEVRON CORP	167,394	115.58	19,347,398.52	
CONCHO RESOURCES INC	17,481	90.10	1,575,038.10	
CONOCOPHILLIPS	96,071	65.07	6,251,339.97	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	32.66	249,751.02	
DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	25.85	978,706.85	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	89.54	1,207,625.98	
EOG RESOURCES INC	51,609	85.31	4,402,763.79	
EXXON MOBIL	371,576	68.56	25,475,250.56	
HALLIBURTON CO	76,620	23.96	1,835,815.20	
HESS CORP	24,844	69.90	1,736,595.60	
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	46.92	662,041.20	
KINDER MORGAN INC	181,360	21.36	3,873,849.60	
MARATHON OIL CORP	74,537	13.21	984,633.77	
MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	56.89	3,283,690.80	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	23.50	712,308.50	
NOBLE ENERGY INC	38,291	23.43	897,158.13	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,592	45.83	3,510,211.36	
ONEOK INC	36,957	77.17	2,851,971.69	
PHILLIPS 66	40,336	103.31	4,167,112.16	
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	148.79	2,150,759.45	
SCHLUMBERGER	123,022	38.37	4,720,354.14	
TARGA RESOURCES CORP	20,002	41.28	825,682.56	
TECHNIPFMC PLC	36,005	19.79	712,538.95	
VALERO ENERGY CORP	37,256	91.22	3,398,492.32	
WILLIAMS COS	103,730	23.86	2,474,997.80	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,553	237.00	4,634,061.00	
ALBEMARLE CORP	8,647	80.90	699,542.30	
AMCOR PLC	138,214	10.90	1,506,532.60	
AVERY DENNISON CORP	7,457	134.72	1,004,607.04	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	30.32	533,813.92	
BALL CORP	27,142	69.24	1,879,312.08	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	117.59	1,299,722.27	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	46.14	879,935.94	
CORTEVA INC	64,411	28.30	1,822,831.30	
CROWN HOLDINGS INC	11,700	73.44	859,248.00	
DOW INC	65,790	53.34	3,509,238.60	
DUPONT DE NEMOURS INC	66,679	61.56	4,104,759.24	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	77.45	918,402.10	
ECOLAB INC	23,026	195.58	4,503,425.08	

FMC CORP	12,118	100.00	1,211,800.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	124,849	12.87	1,606,806.63	
INT'L PAPER CO	33,803	45.75	1,546,487.25	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	134.88	1,169,949.12	
LINDE PLC	47,863	214.10	10,247,468.30	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,007	92.00	2,116,644.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,367	266.74	1,431,593.58	
MOSAIC CO/THE	31,911	21.87	697,893.57	
NEWMONT CORPORATION	73,290	43.48	3,186,649.20	
NUCOR CORP	26,204	53.81	1,410,037.24	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	109.04	969,365.60	
PPG INDUSTRIES INC	19,958	128.49	2,564,403.42	
RPM INTERNATIONAL INC	11,000	74.44	818,840.00	
SEALED AIR CORP	14,689	39.28	576,983.92	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,387	594.47	4,391,349.89	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	33.21	606,846.33	
VULCAN MATERIALS CO	11,960	141.11	1,687,675.60	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	71.19	245,961.45	
WESTROCK CO	21,244	43.68	927,937.92	
3 M COMPANY	50,865	181.35	9,224,367.75	
ACUITY BRANDS INC	3,505	123.28	432,096.40	
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	62.35	706,425.50	
ALLEGION PLC	7,435	128.05	952,051.75	
AMETEK INC	19,001	101.78	1,933,921.78	
ARCONIC INC	36,550	29.32	1,071,646.00	
BOEING CO	46,987	324.15	15,230,836.05	
CATERPILLAR	48,771	147.78	7,207,378.38	
CUMMINS INC	12,585	173.80	2,187,273.00	
DEERE&CO	26,740	176.20	4,711,588.00	
DOVER CORP	12,008	119.53	1,435,316.24	
EATON CORP	36,194	95.68	3,463,041.92	
EMERSON ELECTRIC CO	52,562	77.78	4,088,272.36	
FASTENAL CO	51,959	36.80	1,912,091.20	
FLOWSERVE CORP	10,826	50.49	546,604.74	
FORTIVE CORP	25,813	78.78	2,033,548.14	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	69.41	889,142.10	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,828	181.89	3,970,294.92	
GENERAL ELECTRIC CO	770,523	11.81	9,099,876.63	
GRAINGER (WW) INC	3,976	340.15	1,352,436.40	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	40.30	613,607.80	
HEICO CORP	3,640	121.38	441,823.20	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	95.21	614,009.29	

HONEYWELL INTL INC	62,588	183.23	11,467,999.24	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	277.81	978,446.82	
IDEX CORP	6,916	175.85	1,216,178.60	
ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	180.43	5,057,092.04	
INGERSOLL-RAND PLC	21,603	133.92	2,893,073.76	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	94.00	1,130,444.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	58.06	1,167,006.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	32.30	662,150.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	68,082	40.99	2,790,681.18	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,659	219.38	4,312,791.42	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	243.63	702,872.55	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,452	425.66	9,556,918.32	
MASCO CORP	24,547	49.09	1,205,012.23	
MIDDLEBY CORP	4,364	113.33	494,572.12	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,290	379.97	5,429,771.30	
OWENS CORNING	10,458	65.65	686,567.70	
PACCAR INC	30,075	78.52	2,361,489.00	
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	207.00	2,347,380.00	
PENTAIR PLC	13,583	47.29	642,340.07	
RAYTHEON COMPANY	24,818	231.34	5,741,396.12	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	204.74	2,152,022.14	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,262	379.74	3,517,151.88	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	52.71	728,873.88	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	46.93	570,011.78	
SNAP-ON INC	4,900	170.00	833,000.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	67.30	570,771.30	
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	172.53	2,283,262.02	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,000	376.88	1,130,640.00	
TEXTRON	21,534	46.12	993,148.08	
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	636.66	2,592,479.52	
UNITED RENTALS INC	6,446	158.72	1,023,109.12	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	72,207	154.40	11,148,760.80	
WABCO HOLDINGS INC	3,841	135.43	520,186.63	
WABTEC CORP	15,679	80.15	1,256,671.85	
XYLEM INC	16,060	83.46	1,340,367.60	
CINTAS CORP	7,616	284.23	2,164,695.68	
COPART INC	17,540	97.12	1,703,484.80	
COSTAR GROUP INC	3,300	649.63	2,143,779.00	
EQUIFAX INC	10,799	153.03	1,652,570.97	
IHS MARKIT LTD	32,775	79.27	2,598,074.25	
MANPOWER GROUP	5,123	98.76	505,947.48	
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	21.51	591,611.04	

REPUBLIC SERVICES INC	20,400	93.46	1,906,584.00	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	63.34	605,910.44	
ROLLINS INC	10,546	35.86	378,179.56	
TRANSUNION	15,344	92.85	1,424,690.40	
VERISK ANALYTICS INC	13,480	160.55	2,164,214.00	
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	98.17	2,258,695.36	
WASTE MANAGEMENT INC	37,723	119.65	4,513,556.95	
AMERCO	602	380.66	229,157.32	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	28.40	281,728.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	80.74	924,311.52	
CSX CORP	68,203	76.40	5,210,709.20	
DELTA AIR LINES INC	15,095	62.03	936,342.85	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	76.82	1,218,979.76	
FEDEX CORP	21,165	159.98	3,385,976.70	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	114.68	818,127.12	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	166.52	1,455,884.36	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	37.52	401,464.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,624	209.32	4,944,975.68	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	208.44	1,093,267.80	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	55.01	630,689.65	
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	35.13	553,262.37	
UNION PACIFIC CORP	62,381	185.32	11,560,446.92	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	89.70	538,469.10	
UNITED PARCEL SERVICE B	61,610	118.60	7,306,946.00	
XPO LOGISTICS INC	8,001	94.64	757,214.64	
APTIV PLC	22,107	91.53	2,023,453.71	
AUTOLIV INC	6,639	81.24	539,352.36	
BORGWARNER INC	15,953	41.53	662,528.09	
FORD MOTOR COMPANY	335,147	9.16	3,069,946.52	
GENERAL MOTORS CO	113,426	35.60	4,037,965.60	
HARLEY-DAVIDSON	14,677	35.72	524,262.44	
LEAR CORP	5,287	140.66	743,669.42	
TESLA INC	11,730	510.50	5,988,165.00	
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	36.79	424,814.13	
DR HORTON INC	32,171	55.71	1,792,246.41	
GARMIN LTD	11,464	99.04	1,135,394.56	
HANESBRANDS INC	31,136	14.32	445,867.52	
HASBRO INC	10,617	105.13	1,116,165.21	
LEGGETT & PLATT INC	10,594	51.20	542,412.80	
LENNAR CORP-CL A	23,545	63.09	1,485,454.05	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,496	241.25	2,290,910.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	139.70	707,161.40	

NEWELL BRANDS INC	37,563	20.26	761,026.38	
NIKE B	110,763	104.53	11,578,056.39	
NVR INC	294	3,893.41	1,144,662.54	
POLARIS INC	4,691	93.08	436,638.28	
PULTE GROUP INC	21,959	41.79	917,666.61	
PVH CORP	7,252	100.95	732,089.40	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	122.10	558,973.80	
TAPESTRY INC	25,989	28.89	750,822.21	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	20.39	325,220.50	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	18.37	299,118.71	
VF CORP	28,754	94.27	2,710,639.58	
WHIRLPOOL CORP	5,324	152.63	812,602.12	
ARAMARK	19,980	46.42	927,471.60	
CARNIVAL CORPORATION	35,126	51.90	1,823,039.40	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,257	878.15	1,981,984.55	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,266	113.52	1,278,916.32	
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	286.47	989,180.91	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	113.92	2,679,740.16	
LAS VEGAS SANDS CORP	31,490	74.06	2,332,149.40	
MARRIOTT INTL A	25,274	150.26	3,797,671.24	
MCDONALD'S CORP	67,182	211.98	14,241,240.36	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	25.02	441,903.24	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	34.54	1,542,418.24	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	59.65	1,064,036.70	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	135.05	2,065,049.55	
STARBUCKS CORP	103,987	93.62	9,735,262.94	
VAIL RESORTS INC	3,574	249.44	891,498.56	
WYNN RESORTS LTD	8,052	151.62	1,220,844.24	
YUM BRANDS INC	26,166	105.40	2,757,896.40	
ACTIVISION BLIZZARD INC	68,180	61.24	4,175,343.20	
ALPHABET INC-CL A	26,286	1,479.52	38,890,662.72	
ALPHABET INC-CL C	27,312	1,480.39	40,432,411.68	
ALTICE USA INC- A	12,457	28.72	357,765.04	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	502.73	6,853,215.36	
COMCAST CORP-CL A	398,164	47.50	18,912,790.00	
DISCOVERY INC - A	12,804	32.43	415,233.72	
DISCOVERY INC-C	31,156	30.48	949,634.88	
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	36.79	886,749.37	
ELECTRONIC ARTS INC	25,447	112.93	2,873,729.71	
FACEBOOK INC-A	210,848	222.14	46,837,774.72	
FOX CORP - CLASS A	30,270	39.34	1,190,821.80	
FOX CORP- CLASS B	15,092	38.57	582,173.90	

IAC/INTERACTIVECORP	6,721	275.70	1,852,979.70	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	24.15	817,091.10	
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	129.47	1,121,598.61	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	21.15	328,163.40	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	34,106	20.35	694,227.63	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	48.05	898,198.65	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	50.01	761,802.33	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	49.43	315,561.12	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	75.54	954,598.98	
MATCH GROUP INC	4,600	91.11	419,106.00	
NETFLIX INC	38,532	339.67	13,088,164.44	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	14.91	499,171.89	
OMNICOM GROUP	19,030	80.49	1,531,724.70	
PINTEREST INC- CLASS A	10,000	23.00	230,000.00	
ROKU INC	7,065	130.38	921,134.70	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	7.17	928,550.85	
SNAP INC - A	57,914	19.11	1,106,736.54	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,552	130.01	1,241,855.52	
THE WALT DISNEY CO	158,140	144.33	22,824,346.20	
TRIPADVISOR INC	10,393	30.93	321,455.49	
TWITTER INC	65,352	34.22	2,236,345.44	
VIACOMCBS INC-CLASS B	47,645	39.49	1,881,501.05	
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	47.96	477,777.52	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	151.05	934,395.30	
AMAZON.COM	36,824	1,864.72	68,666,449.28	
AUTOZONE INC	2,085	1,154.58	2,407,299.30	
BEST BUY COMPANY INC	20,711	89.94	1,862,747.34	
BOOKING HOLDINGS INC	3,673	2,054.69	7,546,876.37	
BURLINGTON STORES INC	6,004	226.97	1,362,727.88	
CARMAX INC	14,253	95.68	1,363,727.04	
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	157.99	3,527,916.70	
DOLLAR TREE INC	21,332	91.55	1,952,944.60	
EBAY	71,876	35.82	2,574,598.32	
EXPEDIA GROUP INC	12,028	111.82	1,344,970.96	
GAP	21,891	18.53	405,640.23	
GENUINE PARTS CO	12,722	102.80	1,307,821.60	
GRUBHUB INC	8,261	55.98	462,450.78	
HOME DEPOT	95,470	231.91	22,140,447.70	
KOHLS CORP	14,645	47.00	688,315.00	
LKQ CORP	29,351	34.61	1,015,838.11	
LOWES COMPANIES	67,188	122.36	8,221,123.68	
MERCADOLIBRE INC	3,995	673.01	2,688,674.95	

NORDSTROM INC	10,094	40.34	407,191.96	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,699	440.68	2,952,115.32	
ROSS STORES INC	31,827	117.68	3,745,401.36	
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,436	116.92	5,312,377.12	
TIFFANY & CO	9,326	134.25	1,252,015.50	
TJX COMPANIES INC	107,309	62.68	6,726,128.12	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	92.79	1,040,361.48	
ULTA BEAUTY INC	4,911	272.89	1,340,162.79	
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	106.79	568,870.33	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,741	304.68	11,803,607.88	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	5.69	192,891.00	
KROGER CO	68,147	28.15	1,918,338.05	
SYSCO CORP	41,755	82.82	3,458,149.10	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	54.41	3,667,614.87	
WALMART INC	126,110	114.96	14,497,605.60	
ALTRIA GROUP INC	165,376	51.02	8,437,483.52	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	45.25	2,162,859.50	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,439	70.74	1,870,294.86	
BUNGE LIMITED	11,767	56.06	659,658.02	
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	48.02	675,737.44	
COCA-COLA CO	356,211	56.94	20,282,654.34	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,270	53.54	1,085,255.80	
CONAGRA BRANDS INC	39,943	33.33	1,331,300.19	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,937	189.95	2,837,283.15	
GENERAL MILLS INC	53,542	53.85	2,883,236.70	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	150.85	1,888,792.85	
HORMEL FOODS CORP	27,157	46.30	1,257,369.10	
INGREDION INC	5,835	92.58	540,204.30	
JM SMUCKER CO	9,442	106.39	1,004,534.38	
KELLOGG CO	21,051	70.88	1,492,094.88	
KRAFT HEINZ CO/THE	57,581	31.03	1,786,738.43	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	90.50	1,169,622.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,092	168.68	1,870,998.56	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	15,100	56.57	854,207.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	127,274	55.16	7,020,433.84	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	67.31	2,351,272.92	
PEPSICO INC	123,268	141.26	17,412,837.68	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	137,103	88.69	12,159,665.07	
TYSON FOODS INC	26,508	89.86	2,382,008.88	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	72.00	1,531,008.00	
CLOROX COMPANY	10,995	157.70	1,733,911.50	
COLGATE-PALMOLIVE CO	72,272	71.18	5,144,320.96	

COTY INC-CL A	30,534	11.03	336,790.02	
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,514	219.88	4,290,738.32	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,548	144.50	4,414,186.00	
PROCTER & GAMBLE CO	220,272	126.41	27,844,583.52	
ABBOTT LABORATORIES	155,594	89.00	13,847,866.00	
ABIOMED INC	3,502	181.28	634,842.56	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	280.70	1,758,304.80	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	91.06	1,169,847.82	
ANTHEM INC	22,819	305.39	6,968,694.41	
BAXTER INTERNATIONAL	43,221	89.73	3,878,220.33	
BECTON DICKINSON & CO	23,911	277.08	6,625,259.88	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,474	44.28	5,467,428.72	
CARDINAL HEALTH	25,252	53.93	1,361,840.36	
CENTENE CORP	35,914	64.54	2,317,889.56	
CERNER CORP	27,944	75.86	2,119,831.84	
CIGNA CORP	33,690	212.52	7,159,798.80	
CVS HEALTH CORP	114,987	76.02	8,741,311.74	
DANAHER CORP	54,246	163.06	8,845,352.76	
DAVITA INC	9,056	79.47	719,680.32	
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	59.96	1,210,472.48	
DEXCOM INC	7,827	230.79	1,806,393.33	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,568	238.64	4,431,067.52	
HCA HEALTHCARE INC	24,531	148.40	3,640,400.40	
HENRY SCHEIN INC	12,492	69.29	865,570.68	
HOLOGIC INC	24,459	54.32	1,328,612.88	
HUMANA INC	11,566	366.55	4,239,517.30	
IDEXX LABORATORIES INC	7,763	285.80	2,218,665.40	
INSULET CORP	5,000	188.76	943,800.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,243	600.03	6,146,107.29	
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	177.00	1,562,379.00	
MCKESSON CORP	16,655	156.33	2,603,676.15	
MEDTRONIC PLC	118,252	119.03	14,075,535.56	
QUEST DIAGNOSTICS	11,580	107.06	1,239,754.80	
RESMED INC	12,398	160.57	1,990,746.86	
STERIS PLC	7,229	154.13	1,114,205.77	
STRYKER CORP	28,773	212.17	6,104,767.41	
TELEFLEX INC	3,971	383.73	1,523,791.83	
THE COOPER COS INC	4,135	355.31	1,469,206.85	
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,721	298.47	24,689,736.87	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	145.03	1,051,177.44	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	149.00	1,227,313.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,982	148.07	1,626,104.74	

WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	337.10	1,484,251.30	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,200	157.59	977,058.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,404	149.38	2,749,189.52	
ABBVIE INC	130,602	88.00	11,492,976.00	
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	90.12	2,468,116.44	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	113.27	2,157,566.96	
ALLERGAN PLC	27,804	192.68	5,357,274.72	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,585	118.82	1,138,889.70	
AMGEN	52,248	241.49	12,617,369.52	
BEIGENE LTD-ADR	3,149	170.36	536,463.64	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,800	376.89	678,402.00	
BIOGEN INC	15,870	285.50	4,530,885.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	88.27	1,429,267.84	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	207,290	66.72	13,830,388.80	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,661	30.00	919,830.00	
EXACT SCIENCES CORP	10,748	88.06	946,468.88	
GILEAD SCIENCES INC	112,546	62.98	7,088,147.08	
ILLUMINA INC	13,100	324.72	4,253,832.00	
INCYTE CORP	16,120	80.50	1,297,660.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	60.13	675,620.68	
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	161.51	2,302,325.05	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	151.05	750,869.55	
JOHNSON & JOHNSON	230,855	149.17	34,436,640.35	
LILLY (ELI) & CO	77,235	139.58	10,780,461.30	
MERCK & CO	223,750	90.97	20,354,537.50	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	831.31	1,879,591.91	
MYLAN NV	42,644	21.66	923,669.04	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	7,000	104.67	732,690.00	
PERKINELMER INC	9,475	101.32	960,007.00	
PERRIGO CO PLC	11,333	59.02	668,873.66	
PFIZER	482,431	40.51	19,543,279.81	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	385.94	2,671,090.74	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,448	127.90	824,699.20	
SEATTLE GENETICS INC	9,601	109.00	1,046,509.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	94,834	10.20	967,306.80	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35,324	339.19	11,981,547.56	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,826	235.83	5,383,055.58	
WATERS CORP	6,363	239.60	1,524,574.80	
ZOETIS INC	42,491	140.16	5,955,538.56	
BANK OF AMERICA CORP	772,510	34.71	26,813,822.10	
CITIGROUP	196,874	81.12	15,970,418.88	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	40.87	1,635,208.70	

COMERICA INC	14,360	68.72	986,819.20	
EAST WEST BANCORP INC	13,827	48.08	664,802.16	
FIFTH THIRD BANCORP	63,013	29.45	1,855,732.85	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	118.18	1,669,410.68	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	14.71	1,260,102.73	
JPMORGAN CHASE & CO	279,555	138.20	38,634,501.00	
KEY CORP	87,033	19.59	1,704,976.47	
M & T BANK CORP	11,742	163.03	1,914,298.26	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	16.05	589,356.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,972	153.36	6,130,105.92	
REGIONS FINL CORP	83,851	16.39	1,374,317.89	
SIGNATURE BANK	4,354	139.17	605,946.18	
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	258.40	1,134,376.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	117,881	56.29	6,635,521.49	
US BANCORP	133,575	55.35	7,393,376.25	
WELLS FARGO & CO	365,317	49.18	17,966,290.06	
ZIONS BANCORPORATION	15,186	50.74	770,537.64	
ALLY FINANCIAL INC	36,028	30.45	1,097,052.60	
AMERICAN EXPRESS	62,687	131.52	8,244,594.24	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	172.43	2,043,295.50	
BANK NEW YORK CO	76,753	46.18	3,544,453.54	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	115,181	230.20	26,514,666.20	
BLACKROCK INC	10,286	535.24	5,505,478.64	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	56,500	60.76	3,432,940.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,786	104.13	4,351,176.18	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	116.53	1,103,539.10	
CME GROUP INC	31,640	206.86	6,545,050.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,078	84.44	2,455,346.32	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	46.74	986,587.92	
EATON VANCE CORP	10,061	47.39	476,790.79	
EQUITABLE HOLDINGS INC	33,694	26.08	878,739.52	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	275.72	898,847.20	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.74	671,041.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,018	249.46	6,989,370.28	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	50,032	96.77	4,841,596.64	
INVESCO LTD	30,943	18.32	566,875.76	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	22.41	576,071.46	
KKR & CO INC -A	42,145	31.20	1,314,924.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	369.06	1,185,420.72	
MOODY'S CORP	14,592	257.63	3,759,336.96	
MORGAN STANLEY	107,117	57.51	6,160,298.67	
MSCI INC	7,262	279.07	2,026,606.34	

NASDAQ INC	9,996	109.31	1,092,662.76	
NORTHERN TRUST CORP	17,320	109.38	1,894,461.60	
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	132.26	2,653,929.16	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,942	96.27	1,053,386.34	
S&P GLOBAL INC	21,802	296.79	6,470,615.58	
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,514	48.34	4,907,186.76	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	65.26	704,938.52	
STATE STREET CORP	32,349	82.56	2,670,733.44	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	35.76	1,898,677.20	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	50.53	1,182,604.12	
VOYA FINANCIAL INC	12,505	62.71	784,188.55	
AFLAC	63,745	53.42	3,405,257.90	
ALLEGHANY CORP	1,276	816.56	1,041,930.56	
ALLSTATE CORP	28,490	117.55	3,348,999.50	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	111.28	780,406.64	
AMERICAN INT'L GROUP	77,241	52.90	4,086,048.90	
AON PLC	21,375	211.85	4,528,293.75	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	45.17	1,560,668.67	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,886	96.45	1,628,654.70	
ASSURANT INC	4,769	133.77	637,949.13	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	46.90	625,974.30	
BROWN & BROWN INC	20,000	41.41	828,200.00	
CHUBB LTD	40,488	153.69	6,222,600.72	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,306	107.31	1,427,866.86	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	169.49	367,115.34	
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	279.97	938,739.41	
FNF GROUP	24,961	47.31	1,180,904.91	
GLOBE LIFE INC	8,473	104.45	885,004.85	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	61.22	1,941,286.20	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	60.04	1,068,111.60	
LOEWS CORP	22,051	52.39	1,155,251.89	
MARKEL CORP	1,132	1,192.76	1,350,204.32	
MARSH & MCLENNAN COS	43,684	114.15	4,986,528.60	
METLIFE INC	72,012	52.61	3,788,551.32	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	57.08	1,321,687.40	
PROGRESSIVE CORP	51,928	76.30	3,962,106.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,732	97.10	3,372,477.20	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	160.59	872,164.29	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,822	193.22	738,486.84	
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	140.73	3,103,237.23	
UNUM GROUP	18,574	29.37	545,518.38	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	204.99	2,240,540.70	

WR BERKLEY CORP	12,637	70.36	889,139.32	
CBRE GROUP INC-A	26,855	61.03	1,638,960.65	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.82	574,434.00	
JONES LANG LASALLE INC	4,484	171.94	770,978.96	
WEYERHAEUSER CO	69,607	30.98	2,156,424.86	
ACCENTURE PLC-CL A	56,196	209.20	11,756,203.20	
ADOBE INC	42,967	349.74	15,027,278.58	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	14,178	95.31	1,351,305.18	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	112.91	453,446.56	
ANSYS INC	7,624	270.28	2,060,614.72	
AUTODESK INC	18,836	193.35	3,641,940.60	
AUTOMATIC DATA PROCESS	38,497	176.87	6,808,964.39	
BLACK KNIGHT INC	12,000	65.86	790,320.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	12,000	79.40	952,800.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	131.00	1,264,150.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,110	73.73	1,777,630.30	
CDK GLOBAL INC	10,687	56.63	605,204.81	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	113.75	1,228,613.75	
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	117.22	1,330,681.44	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	50,849	62.77	3,191,791.73	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	140.00	434,000.00	
DOCUSIGN INC	8,693	72.53	630,503.29	
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	18.02	292,770.94	
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	35.60	836,528.80	
EPAM SYSTEMS INC	4,620	232.43	1,073,826.60	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	54,206	147.09	7,973,160.54	
FISERV INC	50,943	120.68	6,147,801.24	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	310.04	2,260,811.68	
FORTINET INC	12,963	117.49	1,523,022.87	
GARTNER INC	7,761	161.17	1,250,840.37	
GLOBAL PAYMENTS INC	26,654	198.62	5,294,017.48	
GODADDY INC - CLASS A	14,919	72.06	1,075,063.14	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,000	113.02	791,140.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,100	138.31	10,802,011.00	
INTUIT INC	22,935	282.85	6,487,164.75	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,658	149.47	995,171.26	
LEIDOS HOLDINGS	10,999	103.39	1,137,186.61	
MASTERCARD INC-CLASS A	78,756	323.66	25,490,166.96	
MICROSOFT CORP	635,320	167.10	106,161,972.00	
MONGODB INC	3,652	149.39	545,572.28	
NORTONLIFELOCK INC	53,148	28.13	1,495,053.24	
OKTA INC	8,635	125.83	1,086,542.05	

ORACLE CORP	202,316	55.13	11,153,681.08	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	242.07	1,952,052.48	
PAYCHEX INC	27,697	88.24	2,443,983.28	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	296.24	1,255,465.12	
PAYPAL HOLDINGS INC	98,367	116.04	11,414,506.68	
PTC INC	9,984	80.14	800,117.76	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,100	192.89	1,176,629.00	
SABRE CORP	24,114	23.11	557,395.11	
SALESFORCE.COM INC	73,241	182.23	13,346,707.43	
SERVICENOW INC	16,409	312.52	5,128,140.68	
SPLUNK INC	12,887	157.96	2,035,630.52	
SQUARE INC - A	27,989	69.38	1,941,876.82	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,645	63.47	1,246,868.15	
SYNOPSYS INC	13,552	151.86	2,058,006.72	
TWILIO INC - A	9,579	119.36	1,143,349.44	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,100	309.03	957,993.00	
VERISIGN INC	9,194	214.00	1,967,516.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	150,915	204.70	30,892,300.50	
VMWARE INC-CLASS A	6,787	151.36	1,027,280.32	
WESTERN UNION CO	38,757	27.77	1,076,281.89	
WIX.COM LTD	3,961	140.27	555,609.47	
WORKDAY INC-CLASS A	13,860	181.06	2,509,491.60	
AMPHENOL CORPORATION	25,582	109.45	2,799,949.90	
APPLE INC	395,946	318.73	126,199,868.58	
ARISTA NETWORKS INC	4,940	221.87	1,096,037.80	
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	82.32	548,745.12	
CDW CORP/DE	12,482	136.85	1,708,161.70	
CISCO SYSTEMS	376,282	49.02	18,445,343.64	
COGNEX CORP	16,230	58.64	951,727.20	
CORNING	66,228	30.06	1,990,813.68	
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	50.34	699,222.60	
F5 NETWORKS INC	5,350	137.00	732,950.00	
FLEX LTD	40,465	13.55	548,300.75	
FLIR SYSTEMS INC	11,686	54.66	638,756.76	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,105	15.10	1,692,785.50	
HP INC	135,146	21.97	2,969,157.62	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	145.95	468,061.65	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	24.70	773,208.80	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	105.37	1,670,430.61	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	176.12	2,454,408.32	
NETAPP INC	20,586	62.42	1,284,978.12	
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	61.08	1,394,822.88	

TE CONNECTIVITY LTD	30,145	100.18	3,019,926.10	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	44.14	910,255.08	
WESTERN DIGITAL CORP	26,625	68.26	1,817,422.50	
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	37.33	624,082.94	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	252.74	1,162,604.00	
AT&T INC	641,062	38.38	24,603,959.56	
CENTURYLINK INC	83,301	14.06	1,171,212.06	
SPRINT CORP	64,825	4.82	312,456.50	
T-MOBILE US INC	30,672	82.15	2,519,704.80	
VERIZON COMMUNICATIONS	363,367	60.13	21,849,257.71	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	20,398	34.77	709,238.46	
AES CORP	61,761	20.50	1,266,100.50	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	57.16	1,100,672.96	
AMEREN CORPORATION	21,002	79.75	1,674,909.50	
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,855	98.56	4,322,348.80	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,471	130.44	2,018,037.24	
AQUA AMERICA INC	17,000	50.57	859,690.00	
ATMOS ENERGY CORP	10,759	114.98	1,237,069.82	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	27.05	1,157,523.60	
CMS ENERGY CORP	24,527	65.65	1,610,197.55	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,281	90.24	2,642,317.44	
DOMINION ENERGY INC	71,032	84.05	5,970,239.60	
DTE ENERGY COMPANY	15,603	133.83	2,088,149.49	
DUKE ENERGY CORP	64,402	93.72	6,035,755.44	
EDISON INTL	30,299	76.96	2,331,811.04	
ENTERGY CORP	17,139	126.31	2,164,827.09	
EVERGY INC	21,330	67.33	1,436,148.90	
EVERSOURCE ENERGY	27,188	88.73	2,412,391.24	
EXELON CORP	86,267	47.39	4,088,193.13	
FIRSTENERGY CORP	45,526	49.06	2,233,505.56	
NEXTERA ENERGY INC	42,221	253.40	10,698,801.40	
NISOURCE INC	32,308	29.04	938,224.32	
NRG ENERGY INC	23,078	38.54	889,426.12	
OGE ENERGY CORP	15,686	45.64	715,909.04	
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	93.34	878,889.44	
PPL CORPORATION	65,108	36.09	2,349,747.72	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,254	59.16	2,558,906.64	
SEMPRA ENERGY	24,447	157.20	3,843,068.40	
SOUTHERN CO	92,099	67.26	6,194,578.74	
UGI CORP	18,019	44.50	801,845.50	
VISTRA ENERGY CORP	29,561	22.94	678,129.34	
WEC ENERGY GROUP INC	26,996	96.42	2,602,954.32	

	XCEL ENERGY INC	44,029	65.37	2,878,175.73	
	ADVANCED MICRO DEVICES	87,922	50.93	4,477,867.46	
	ANALOG DEVICES	32,917	119.47	3,932,593.99	
	APPLIED MATERIALS	80,718	62.85	5,073,126.30	
	BROADCOM INC	34,898	308.79	10,776,153.42	
	INTEL CORP	387,248	59.60	23,079,980.80	
	KLA CORP	13,856	178.73	2,476,482.88	
	LAM RESEARCH CORP	12,864	308.00	3,962,112.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	28.49	1,559,457.13	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,423	61.37	1,437,469.51	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	109.41	2,269,601.04	
	MICRON TECHNOLOGY	95,275	57.66	5,493,556.50	
	NVIDIA CORP	51,023	249.28	12,719,013.44	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	133.84	3,356,439.52	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	25.00	899,900.00	
	QORVO INC	10,609	114.74	1,217,276.66	
	QUALCOMM	107,281	95.91	10,289,320.71	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	124.17	1,801,706.70	
	TERADYNE INC	14,000	70.29	984,060.00	
	TEXAS INSTRUMENTS	82,668	131.70	10,887,375.60	
	XILINX INC	21,744	102.89	2,237,240.16	
アメリカドル 小計		26,292,127		2,486,194,790.95 (273,953,804,014)	
カナダドル	CAMECO CORP	28,709	11.60	333,024.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	41.41	4,278,812.48	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	12.11	1,170,625.26	
	ENBRIDGE	179,723	52.97	9,519,927.31	
	ENCANA CORP	117,430	5.33	625,901.90	
	HUSKY ENERGY INC	31,439	9.62	302,443.18	
	IMPERIAL OIL	24,763	35.45	877,848.35	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	22.52	798,446.60	
	KEYERA CORP	18,607	34.84	648,267.88	
	PARKLAND FUEL CORP	11,000	48.56	534,160.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	46,962	50.42	2,367,824.04	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	15.58	285,893.00	
	SUNCOR ENERGY	134,329	43.90	5,897,043.10	
	TC ENERGY CORP	82,858	70.85	5,870,489.30	
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	78.88	1,692,685.92	
	BARRICK GOLD CORP	160,347	23.46	3,761,740.62	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	57.54	756,018.06	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	13.19	750,511.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	138.00	2,312,604.00	

KINROSS GOLD CORP	107,615	5.89	633,852.35	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	56.78	967,133.74	
LUNDIN MINING CORP	62,243	7.84	487,985.12	
METHANEX CORP	7,099	52.79	374,756.21	
NUTRIEN LTD	51,428	61.22	3,148,422.16	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	21.21	968,809.17	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	61.85	267,624.95	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	36.88	1,358,585.44	
BOMBARDIER B	151,366	1.12	169,529.92	
CAE INC	25,999	38.73	1,006,941.27	
WSP GLOBAL INC	9,471	94.01	890,368.71	
THOMSON REUTERS CORP	18,789	103.09	1,936,958.01	
AIR CANADA	11,591	51.08	592,068.28	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,156	125.62	8,059,276.72	
CP RAILWAY LIMITED	11,846	343.08	4,064,125.68	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	71.64	2,004,343.92	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	38.81	685,345.79	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	83.78	1,789,959.70	
STARS GROUP INC/THE	20,487	32.87	673,407.69	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.36	507,072.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	26.69	1,203,372.03	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	145.70	788,091.30	
DOLLARAMA INC	26,700	45.74	1,221,258.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	79,408	44.43	3,528,097.44	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	31.06	473,758.18	
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	68.38	1,067,958.84	
METRO INC	22,050	54.47	1,201,063.50	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	105.74	727,808.42	
SAPUTO INC	20,412	39.88	814,030.56	
AURORA CANNABIS INC	53,000	2.77	146,810.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	39.53	1,098,934.00	
CANOPY GROWTH CORP	16,400	32.57	534,148.00	
CRONOS GROUP INC	15,900	11.18	177,762.00	
BANK MONTREAL	57,133	103.80	5,930,405.40	
BANK NOVA SCOTIA	108,575	72.48	7,869,516.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	108.77	4,132,172.30	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	73.52	2,075,322.56	
ROYAL BANK OF CANADA	126,779	106.55	13,508,302.45	
TORONTO-DOMINION BANK	157,982	74.12	11,709,625.84	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	75,671	81.38	6,158,105.98	
CI FINANCIAL CORP	18,671	23.15	432,233.65	
IGM FINANCIAL INC	7,685	39.41	302,865.85	

	ONEX CORP	6,603	88.20	582,384.60	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	612.66	1,412,181.30	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	34.07	810,457.16	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	73.76	607,044.80	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	143.54	1,872,192.22	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	168,472	27.61	4,651,511.92	
	POWER CORP OF CANADA	29,774	33.54	998,619.96	
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	34.79	721,544.60	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	53,901	63.55	3,425,408.55	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	8.78	345,932.00	
	CGI INC - CL A	21,192	113.35	2,402,113.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,349.99	2,296,332.99	
	OPEN TEXT CORP	24,643	61.37	1,512,340.91	
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,973	594.57	5,335,076.61	
	BCE INC	12,539	62.10	778,671.90	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	64.94	2,084,249.30	
	TELUS CORP	16,454	51.30	844,090.20	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	43,000	19.33	831,190.00	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	20.00	487,900.00	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	51.43	269,544.63	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	40.07	413,682.68	
	EMERA INC	20,611	58.15	1,198,529.65	
	FORTIS INC	38,447	56.59	2,175,715.73	
	HYDRO ONE LTD	32,299	26.19	845,910.81	
カナダドル 小計		3,553,193		175,375,101.25 (14,791,136,039)	
ユーロ	ENI	217,599	13.91	3,028,107.68	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	15.02	598,802.34	
	NESTE OIL OYJ	36,438	33.83	1,232,697.54	
	OMV AG	12,139	48.33	586,677.87	
	REPSOL SA	133,012	14.04	1,867,488.48	
	TENARIS SA	40,648	10.29	418,267.92	
	TOTAL SA	211,151	48.50	10,241,879.25	
	VOPAK	6,360	50.18	319,144.80	
	AIR LIQUIDE	42,062	129.40	5,442,822.80	
	AKZO NOBEL	19,742	87.98	1,736,901.16	
	ARCELORMITTAL	53,985	14.64	790,340.40	
	ARKEMA	5,335	87.32	465,852.20	
	BASF SE	81,730	64.52	5,273,219.60	
	COVESTRO AG	15,098	40.90	617,508.20	
	CRH PLC	71,124	34.83	2,477,248.92	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	25.42	342,000.68	

FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	43.54	250,877.48	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	64.04	949,905.32	
KONINKLIJKE DSM NV	15,234	110.50	1,683,357.00	
LANXESS	7,293	56.38	411,179.34	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	31.96	625,297.40	
SOLVAY SA	6,906	95.20	657,451.20	
STORA ENSO OYJ R	47,237	12.17	575,110.47	
SYMRISE AG	11,581	90.80	1,051,554.80	
THYSSEN KRUPP	33,044	11.99	396,362.78	
UMICORE	17,605	43.98	774,267.90	
UPM KYMMENE OYJ	43,990	29.09	1,279,669.10	
VOESTALPINE AG	8,140	24.32	197,964.80	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,695	34.60	750,647.00	
AIRBUS SE	51,774	136.78	7,081,647.72	
ALSTOM	18,760	45.46	852,829.60	
ANDRITZ AG	5,242	38.46	201,607.32	
BOUYGUES ORD	19,381	37.91	734,733.71	
BRENNTAG AG	15,254	48.81	744,547.74	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	9.97	927,469.22	
DASSAULT AVIATION SA	213	1,136.00	241,968.00	
EIFFAGE	6,079	104.55	635,559.45	
FERROVIAL SA	46,063	28.94	1,333,063.22	
GEA GROUP AG	13,382	29.00	388,078.00	
HOCHTIEF AG	2,222	117.00	259,974.00	
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	54.55	644,399.15	
KION GROUP AG	5,887	61.42	361,579.54	
KNORR-BREMSE AG	4,123	94.59	389,994.57	
KONE OYJ-B	30,120	60.12	1,810,814.40	
LEGRAND SA	24,584	73.80	1,814,299.20	
LEONARDO SPA	35,425	11.11	393,748.87	
METSO OYJ	9,561	36.57	349,645.77	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	285.80	1,358,407.40	
PRYSMIAN SPA	21,155	21.61	457,159.55	
SAFRAN SA	29,221	142.55	4,165,453.55	
SAINT-GOBAIN	45,357	35.36	1,604,050.30	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,188	94.22	4,634,493.36	
SIEMENS	67,838	117.10	7,943,829.80	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	15.45	270,323.40	
THALES SA	9,665	98.78	954,708.70	
VINCI S.A.	45,508	102.40	4,660,019.20	
WARTSILA OYJ	34,386	10.83	372,400.38	
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.20	631,839.60	

EDENRED	22,756	49.18	1,119,140.08	
RANDSTAD NV	9,588	54.86	525,997.68	
TELEPERFORMANCE	5,057	226.80	1,146,927.60	
WOLTERS KLUWER	25,709	68.30	1,755,924.70	
ADP	2,382	176.30	419,946.60	
AENA SME SA	5,610	172.95	970,249.50	
ATLANTIA SPA	42,039	20.64	867,684.96	
BOLLORE	61,805	3.81	235,724.27	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	15.25	354,898.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	34.05	2,893,773.30	
FRAPORT AG	3,561	71.94	256,178.34	
GETLINK	36,478	15.49	565,044.22	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	71.06	2,056,902.76	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	54.25	270,761.75	
CONTINENTAL AG	9,928	114.72	1,138,940.16	
DAIMLER AG	81,382	46.69	3,799,725.58	
FAURECIA	5,945	45.54	270,735.30	
FERRARI NV	11,268	157.10	1,770,202.80	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	12.43	1,198,183.72	
MICHELIN	14,695	110.00	1,616,450.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	26.95	277,369.40	
PEUGEOT SA	52,883	19.79	1,046,818.98	
PIRELLI & C SPA	39,097	5.07	198,221.79	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	67.74	950,256.72	
RENAULT SA	17,362	39.26	681,632.12	
VALEO SA	19,350	30.31	586,498.50	
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	181.36	2,901,578.64	
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	179.70	466,141.80	
ADIDAS AG	16,091	311.65	5,014,760.15	
ESSILORLUXOTTICA	24,247	144.70	3,508,540.90	
HERMES INTERNATIONAL	2,899	725.60	2,103,514.40	
KERING	6,807	610.20	4,153,631.40	
LVMH	24,557	439.05	10,781,750.85	
MONCLER SPA	15,736	42.70	671,927.20	
PUMA SE	7,720	76.10	587,492.00	
SEB SA	2,075	134.00	278,050.00	
ACCOR	17,931	40.20	720,826.20	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	106.55	761,086.65	
SODEXO	8,135	100.10	814,313.50	
ALTICE NV -A	50,000	6.10	305,400.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	14.50	173,652.00	
JC DECAUX SA	4,674	26.12	122,084.88	

PUBLICIS GROUPE	17,601	41.78	735,369.78	
SES	31,369	12.51	392,583.03	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	40.28	201,319.44	
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	62.32	425,645.60	
VIVENDI	77,307	25.21	1,948,909.47	
DELIVERY HERO SE	8,671	70.00	606,970.00	
INDITEX	93,820	31.75	2,978,785.00	
PROSUS	41,700	71.53	2,982,801.00	
ZALANDO SE	13,985	47.11	658,833.35	
CARREFOUR	53,759	14.75	792,945.25	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	36.98	136,345.26	
COLRUYT SA	4,160	45.07	187,491.20	
JERONIMO MARTINS	20,234	15.65	316,662.10	
KONINKLIJKE AHOLD NV	107,149	22.56	2,417,817.18	
METRO AG	13,712	13.19	180,929.84	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,662	72.04	4,874,370.48	
DANONE (GROUPE)	55,084	73.70	4,059,690.80	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	8.65	368,062.53	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	94.30	1,009,104.30	
HEINEKEN NV	22,649	103.65	2,347,568.85	
KERRY GROUP PLC-A	14,641	115.60	1,692,499.60	
PERNOD-RICARD	18,169	170.60	3,099,631.40	
REMY COINTREAU	1,575	117.40	184,905.00	
BEIERSDORF AG	9,190	105.90	973,221.00	
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	85.35	735,546.30	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	93.44	1,470,371.84	
LOREAL	22,456	275.30	6,182,136.80	
UNILEVER NV	129,135	51.07	6,594,924.45	
BIOMERIEUX	3,246	83.50	271,041.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	120.80	414,344.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	67.86	1,221,208.56	
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	48.45	1,780,392.15	
KONINKLIJKE PHILIPS	77,787	45.03	3,502,748.61	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	216.20	701,785.20	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	43.07	538,375.00	
BAYER	82,883	75.25	6,236,945.75	
EUROFINS SCIENTIFIC	971	479.60	465,691.60	
GALAPAGOS NV	3,800	206.50	784,700.00	
GRIFOLS SA	27,685	31.80	880,383.00	
IPSEN	2,722	82.35	224,156.70	
MERCK KGAA	12,078	115.50	1,395,009.00	
ORION OYJ-CLASS B	7,975	43.99	350,820.25	

QIAGEN N.V.	21,801	30.99	675,612.99	
RECORDATI SPA	7,493	39.49	295,898.57	
SANOFI	99,497	92.19	9,172,628.43	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	160.70	482,742.80	
UCB (GROUPE)	10,465	79.96	836,781.40	
ABN AMRO BANK NV-CVA	33,189	16.43	545,461.21	
AIB GROUP PLC	70,200	2.94	206,388.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA	600,761	4.80	2,887,557.74	
BANCO DE SABADELL SA	449,651	1.00	451,449.60	
BANCO SANTANDER SA	1,493,926	3.67	5,493,912.86	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	4.71	395,640.00	
BANKIA SA	110,053	1.80	198,150.42	
BANKINTER SA	58,881	6.28	370,125.96	
BNP PARIBAS	100,335	50.75	5,092,001.25	
CAIXABANK	286,347	2.76	792,894.84	
COMMERZBANK AG	80,494	5.28	425,330.29	
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	12.87	1,383,048.81	
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	33.48	922,708.80	
FINECOBANK SPA	53,120	11.11	590,163.20	
ING GROEP NV-CVA	349,585	10.62	3,712,592.70	
INTESA SANPAOLO	1,286,795	2.33	3,006,596.51	
KBC GROEP NV	21,492	67.92	1,459,736.64	
MEDIOBANCA	53,990	9.75	526,402.50	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	22.00	274,780.00	
SOCIETE GENERALE	70,347	30.65	2,156,135.55	
UNICREDIT SPA	172,440	13.15	2,267,586.00	
AMUNDI SA	4,764	70.25	334,671.00	
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	7.58	1,222,851.72	
DEUTSCHE BOERSE	17,199	146.45	2,518,793.55	
EURAZEO SA	3,357	62.10	208,469.70	
EXOR NV	10,345	72.12	746,081.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	96.14	600,586.58	
NATIXIS	69,996	3.91	274,174.33	
WENDEL	2,023	122.30	247,412.90	
AEGON	166,267	3.96	659,248.65	
AGEAS	16,065	51.52	827,668.80	
ALLIANZ SE-REG	37,563	219.65	8,250,712.95	
ASSICURAZIONI GENERALI	100,566	18.34	1,844,380.44	
AXA	173,280	24.37	4,223,700.00	
CNP ASSURANCES	11,830	17.21	203,594.30	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	177.70	1,028,705.30	
MAPFRE SA	90,939	2.42	220,436.13	

MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	268.60	3,401,819.00	
NN GROUP NV	27,631	32.84	907,402.04	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.28	473,469.97	
SAMPO OYJ-A SHS	38,075	40.47	1,540,895.25	
SCOR SE	13,354	38.29	511,324.66	
AROUNDTOWN SA	79,006	8.04	635,208.24	
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	37.16	1,077,974.44	
VONOVIA SE	43,528	50.14	2,182,493.92	
ADYEN NV	884	777.80	687,575.20	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,633	78.60	3,115,153.80	
ATOS SE	7,634	78.16	596,673.44	
CAPGEMINI SA	13,238	116.40	1,540,903.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,300	157.55	1,780,315.00	
SAP SE	86,843	125.96	10,938,744.28	
WIRECARD AG	9,864	127.60	1,258,646.40	
WORLDLINE SA	7,022	65.25	458,185.50	
INGENICO GROUP	4,681	102.85	481,440.85	
NOKIA OYJ	489,813	3.74	1,836,308.93	
CELLNEX TELECOM SA	21,365	42.31	903,953.15	
DEUTSCHE TELEKOM	297,100	14.68	4,361,428.00	
ELISA A	11,722	51.08	598,759.76	
ILIAD SA	1,253	123.00	154,119.00	
KPN (KON.)	308,450	2.74	847,620.60	
ORANGE	170,925	13.03	2,227,152.75	
PROXIMUS	13,141	25.13	330,233.33	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.51	436,762.38	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.50	235,073.50	
TELEFONICA	400,024	6.15	2,460,147.60	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.73	183,020.81	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	30.40	289,195.20	
E.ON SE	201,539	10.19	2,054,488.56	
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	11.13	553,810.36	
ENAGAS	18,299	23.69	433,503.31	
ENDESA	24,774	24.55	608,201.70	
ENEL	724,150	7.72	5,594,058.75	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	4.11	971,253.82	
ENGIE	156,560	15.19	2,378,929.20	
FORTUM OYJ	38,328	22.85	875,794.80	
IBERDROLA SA	534,398	9.40	5,025,478.79	
IBERDROLA SA-RTS	534,398	0.17	93,519.65	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,130	22.96	531,064.80	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.77	704,260.64	

	RWE STAMM	47,044	30.96	1,456,482.24	
	SNAM SPA	163,694	4.96	811,922.24	
	SUEZ	28,043	14.50	406,763.71	
	TERNA SPA	130,230	6.19	807,165.54	
	UNIPER SE	20,192	29.45	594,654.40	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	25.65	1,173,282.30	
	VERBUND AG	7,463	46.22	344,939.86	
	ASML HOLDING NV	37,644	270.90	10,197,759.60	
	INFINEON TECHNOLOGIES	107,254	21.13	2,266,277.02	
	STMICROELECTRONICS	57,598	25.16	1,449,165.68	
ユーロ 小計		17,505,636		372,741,822.21 (45,563,960,346)	
イギリスポンド	BP PLC	1,796,256	4.96	8,916,614.78	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	372,144	22.48	8,367,657.84	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	331,137	22.65	7,500,253.05	
	ANGLO AMERICAN PLC	96,044	22.45	2,156,668.02	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.84	352,823.04	
	BHP GROUP PLC	189,010	18.51	3,499,709.16	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	51.20	511,948.80	
	EVRAZ PLC	43,000	4.18	180,084.00	
	GLENCORE PLC	941,686	2.43	2,290,180.35	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	28.41	478,651.68	
	MONDI PLC	42,009	16.04	673,824.36	
	RIO TINTO PLC REG	101,122	46.51	4,703,184.22	
	ASHTEAD GROUP PLC	42,021	25.54	1,073,216.34	
	BAE SYSTEMS PLC	274,735	6.24	1,715,994.81	
	BUNZL PLC	27,712	20.86	578,072.32	
	DCC PLC	9,127	65.18	594,897.86	
	FERGUSON PLC	19,208	71.76	1,378,366.08	
	MEGGITT PLC	66,268	6.97	462,153.03	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	2.36	964,843.93	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	6.75	1,007,110.95	
	SMITHS GROUP PLC	37,146	17.33	643,740.18	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	91.75	575,914.75	
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	14.51	269,682.86	
	EXPERIAN PLC	77,938	26.50	2,065,357.00	
	G4S PLC	132,555	2.09	277,437.61	
	INTERTEK GROUP PLC	15,404	59.56	917,462.24	
	RELX PLC	174,568	20.04	3,498,342.72	
	RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	4.75	749,887.27	
	EASYJET PLC	11,633	14.77	171,877.57	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.99	771,173.18	

BURBERRY GROUP PLC	35,328	23.29	822,789.12	
PERSIMMON PLC	26,389	28.91	762,905.99	
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	2.12	574,745.90	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	50.40	534,189.60	
CARNIVAL PLC	13,721	37.08	508,774.68	
COMPASS GROUP PLC	136,301	19.36	2,639,468.86	
GVC HOLDINGS PLC	42,500	9.10	387,005.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	51.57	827,234.37	
TUI AG-DI	37,945	8.91	338,317.62	
WHITBREAD PLC	11,623	44.81	520,826.63	
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.73	458,777.34	
INFORMA PLC	117,961	8.63	1,018,711.19	
ITV PLC	295,435	1.46	431,335.10	
PEARSON	66,305	5.88	390,271.23	
WPP PLC	113,065	10.19	1,152,697.67	
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	8.74	279,680.00	
KINGFISHER PLC	170,994	2.10	359,600.38	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	1.87	253,009.44	
NEXT PLC	11,202	69.38	777,194.76	
OCADO GROUP PLC	38,762	13.34	517,278.89	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.91	399,890.97	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.16	320,996.94	
TESCO	856,393	2.48	2,128,992.99	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	26.60	767,277.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	203,330	34.66	7,048,434.45	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.66	496,773.60	
DIAGEO	210,292	32.81	6,899,680.52	
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	20.45	1,702,776.47	
RECKITT BENCKISER PLC	63,097	62.11	3,918,954.67	
UNILEVER PLC	98,655	44.00	4,340,820.00	
NMC HEALTH PLC	9,509	15.57	148,102.67	
SMITH & NEPHEW PLC	75,051	18.92	1,419,964.92	
ASTRAZENECA	115,877	78.78	9,128,790.06	
GLAXOSMITHKLINE	441,129	18.46	8,143,241.34	
BARCLAYS	1,471,691	1.75	2,578,991.30	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,784,402	5.94	10,599,347.88	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,050,820	0.58	3,536,704.29	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	2.24	888,742.42	
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	7.02	1,788,415.20	
3I GROUP PLC	79,251	11.26	892,762.51	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	18.00	486,513.10	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	28,508	76.40	2,178,011.20	

	M&G PLC	229,107	2.46	564,061.43	
	SCHRODERS PLC	8,614	32.97	284,003.58	
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.10	496,948.75	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	3.15	611,238.06	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.30	378,741.50	
	AVIVA PIC	348,023	4.07	1,418,889.77	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.34	380,717.82	
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.99	1,646,132.57	
	PRUDENTIAL	229,107	14.16	3,245,300.65	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.57	482,016.66	
	AVEVA GROUP PLC	4,500	50.55	227,475.00	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	11.32	329,015.80	
	SAGE GROUP PLC	89,321	7.34	655,794.78	
	HALMA PLC	32,374	21.55	697,659.70	
	BT GROUP PLC	730,298	1.84	1,344,624.67	
	VODAFONE GROUP PLC	2,384,174	1.54	3,680,687.82	
	CENTRICA PLC	440,558	0.92	409,102.15	
	NATIONAL GRID PLC	291,880	9.76	2,850,791.96	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	25.83	467,832.96	
	SSE PLC	93,277	14.95	1,394,491.15	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	10.03	590,961.15	
イギリスポンド 小計		26,007,303		162,872,616.20 (23,331,502,270)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	21.70	377,536.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	632.00	424,704.00	
	GIVAUDAN-REG	813	3,077.00	2,501,601.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	44,261	52.74	2,334,325.14	
	SIKA AG-BR	11,762	181.50	2,134,803.00	
	ABB LTD	165,849	23.19	3,846,038.31	
	GEBERIT AG-REG	3,423	519.20	1,777,221.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	247.80	366,496.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	257.40	969,883.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	60.14	795,291.36	
	SGS SA	437	2,690.00	1,175,530.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	165.65	839,348.55	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	80.94	3,621,579.36	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	273.50	679,100.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	51.75	203,791.50	
	DUFRY AG-REG	3,825	95.90	366,817.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	2,148.00	343,680.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	89,900.00	719,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	8,090.00	841,360.00	

	NESTLE SA - REGISTERED	259,686	106.58	27,677,333.88	
	ALCON INC	35,606	59.54	2,119,981.24	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	229.30	1,170,347.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	895	1,001.50	896,342.50	
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	365.20	2,376,356.40	
	NOVARTIS	189,231	92.78	17,556,852.18	
	ROCHE HOLDING GENUSS	61,860	327.95	20,286,987.00	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	183.30	660,063.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,862	13.47	2,948,071.14	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	49.94	1,057,579.38	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	82.75	281,101.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,608	932.80	1,499,942.40	
	UBS GROUP AG	345,678	12.73	4,402,209.33	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	176.50	684,290.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	488.20	1,439,701.80	
	SWISS RE LTD	26,239	108.00	2,833,812.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,483	402.60	5,428,255.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	117.80	739,430.60	
	TEMENOS AG - REG	5,252	151.25	794,365.00	
	SWISSCOM	2,441	523.00	1,276,643.00	
スイスフラン 小計		1,537,145		120,447,974.22 (13,711,797,385)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	322.80	4,580,854.80	
	BOLIDEN AB	23,903	263.30	6,293,659.90	
	ALFA LAVAL AB	25,639	251.50	6,448,208.50	
	ASSA ABLOY AB-B	85,980	234.10	20,127,918.00	
	ATLAS COPCO A	59,675	392.60	23,428,405.00	
	ATLAS COPCO B	36,538	345.30	12,616,571.40	
	EPIROC AB-A	53,833	119.00	6,406,127.00	
	EPIROC AB-B	29,972	115.95	3,475,253.40	
	SANDVIK AB	100,730	187.95	18,932,203.50	
	SKANSKA B	28,530	228.90	6,530,517.00	
	SKF AB-B	28,335	189.45	5,368,065.75	
	VOLVO B	125,906	159.45	20,075,711.70	
	SECURITAS B	22,844	161.75	3,695,017.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	244.00	4,433,480.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	77.94	3,017,213.28	
	HENNES & MAURITZ B	69,119	184.98	12,785,632.62	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	418.70	3,332,433.30	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	540.00	8,180,460.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	52,085	321.60	16,750,536.00	
	NORDEA BANK ABP	295,938	76.98	22,781,307.24	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	92.00	12,761,320.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	96.20	13,120,333.20	
	SWEDBANK AB-A	80,216	138.30	11,093,872.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	233.20	2,983,094.40	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	538.20	21,763,731.60	
	KINNEVIK AB - B	18,104	231.70	4,194,696.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	427.60	3,112,928.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	85.44	22,962,427.20	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	547.80	11,779,891.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	8,677	453.60	3,935,887.20	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	141.45	7,074,197.40	
	TELIA CO AB	235,437	40.52	9,539,907.24	
スウェーデンクローナ 小計		2,151,519		333,581,862.43 (3,862,877,966)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	292.90	3,020,091.90	
	EQUINOR ASA	92,158	181.75	16,749,716.50	
	NORSK HYDRO	106,150	31.94	3,390,431.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	346.90	6,407,243.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	263.20	1,834,767.20	
	MOWI ASA	40,968	222.50	9,115,380.00	
	ORKLA	69,804	87.54	6,110,642.16	
	DNB ASA	80,217	164.15	13,167,620.55	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	192.30	3,571,780.20	
	TELENOR ASA	60,821	168.00	10,217,928.00	
ノルウェークローネ 小計		504,444		73,585,600.51 (910,253,878)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	497.40	4,515,894.60	
	NOVOZYMES A/S	17,687	321.50	5,686,370.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,605	662.00	11,654,510.00	
	ISS A/S	14,253	173.85	2,477,884.05	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,205.00	2,453,295.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	8,642.00	4,390,136.00	
	DSV PANALPINA A S	18,714	769.60	14,402,294.40	
	PANDORA A/S	8,431	364.40	3,072,256.40	
	CARLSBERG AS-B	9,692	1,048.50	10,162,062.00	
	COLOPLAST-B	10,223	860.20	8,793,824.60	
	DEMANT A/S	7,420	219.90	1,631,658.00	
	GENMAB A/S	5,595	1,520.00	8,504,400.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	281.30	1,370,212.30	
	NOVO NORDISK A/S-B	156,652	413.55	64,783,434.60	
	DANSKE BANK A/S	59,378	110.00	6,531,580.00	
	TRYG A/S	9,828	209.80	2,061,914.40	

	ORSTED A/S	15,908	695.40	11,062,423.20	
デンマーククローネ 小計		366,143		163,554,150.05 (2,675,745,894)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	34.91	720,158.39	
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.86	933,618.66	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	8.74	1,447,300.30	
	SANTOS	156,437	8.82	1,379,774.34	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	22.38	286,754.94	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	35.56	2,972,460.40	
	WORLEY LTD	34,596	16.00	553,536.00	
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.29	390,348.82	
	BHP GROUP LTD	261,560	40.60	10,619,336.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	15.61	770,010.08	
	BORAL LIMITED	81,732	4.91	401,304.12	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	11.41	1,536,653.16	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.37	507,518.63	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	30.44	1,137,329.72	
	NEWCREST MINING LIMITED	66,006	31.90	2,105,591.40	
	ORICA LTD	29,211	23.13	675,650.43	
	RIO TINTO LTD	32,522	105.24	3,422,615.28	
	SOUTH32 LTD	408,172	2.88	1,175,535.36	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	35.32	325,650.40	
	BRAMBLES LTD	129,297	12.29	1,589,060.13	
	SEEK LTD	26,358	23.39	616,513.62	
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.65	901,101.55	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	7.15	607,750.00	
	TRANSURBAN GROUP	249,164	15.77	3,929,316.28	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	36.98	1,950,768.96	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.52	379,706.56	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	43.85	143,082.55	
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.75	792,518.50	
	REA GROUP LTD	3,593	114.90	412,835.70	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.42	199,620.46	
	WESFARMERS LTD	97,071	44.26	4,296,362.46	
	COLES GROUP LTD	93,277	15.92	1,484,969.84	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	107,751	39.04	4,206,599.04	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	11.79	543,872.70	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	17.66	1,030,902.50	
	COCHLEAR LIMITED	4,811	240.71	1,158,055.81	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	76.53	1,243,459.44	
	SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	30.97	1,207,489.33	
	CSL LIMITED	40,233	300.10	12,073,923.30	

	AUST AND NZ BANKING GROUP	252,665	25.42	6,422,744.30	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.18	431,978.12	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	156,654	84.05	13,166,768.70	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	250,533	25.46	6,378,570.18	
	WESTPAC BANKING	306,284	24.98	7,650,974.32	
	AMP LTD	244,230	1.93	471,363.90	
	ASX LTD	15,814	84.14	1,330,589.96	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	8.63	380,306.84	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,283	144.14	4,220,851.62	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	63.32	690,947.84	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.91	1,655,998.05	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.29	705,744.48	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	13.90	1,571,992.70	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	13.50	1,611,279.00	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	17.90	794,330.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	25.43	457,740.00	
	TELSTRA CORP	342,339	3.90	1,335,122.10	
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.94	218,436.50	
	AGL ENERGY LTD	51,344	20.79	1,067,441.76	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.76	212,205.95	
オーストラリアドル 小計		6,094,379		120,904,441.88 (9,163,347,650)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	5.43	416,176.92	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	9.09	772,195.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	15.16	1,013,506.64	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	22.50	1,023,930.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	16.27	590,877.59	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.53	659,611.21	
	MERCURY NZ LTD	85,000	5.30	450,500.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.33	589,199.52	
ニュージーランドドル 小計		651,266		5,515,997.38 (402,116,209)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	75.30	17,619,898.80	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	11.64	1,897,320.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	67.30	8,008,700.00	
	MTR CORP	133,000	47.80	6,357,400.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	24.30	1,664,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	187,000	62.20	11,631,400.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	45.00	9,126,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	10.50	1,386,000.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	20.65	2,907,520.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	104,500	25.90	2,706,550.00	

	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	28.25	1,808,000.00	
	WH GROUP LTD	829,500	8.77	7,274,715.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	18.14	1,980,162.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	28.90	8,959,000.00	
	HANG SENG BANK	68,000	173.50	11,798,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,200	280.00	28,616,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,068,000	86.60	92,488,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	56.45	12,192,974.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	19.02	3,290,460.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	39.00	4,883,892.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	25.35	1,635,075.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.10	5,455,650.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.72	3,696,488.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	136,500	123.00	16,789,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	76.50	3,098,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	27.60	2,655,120.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	49.10	4,664,500.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	52.40	3,406,000.00	
	PCCW LTD	357,000	4.75	1,695,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	57.50	2,875,000.00	
	CLP HOLDINGS	141,000	83.40	11,759,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	15.90	14,270,313.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	58.20	6,460,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	117.10	2,775,270.00	
香港ドル 小計		7,434,484		317,833,859.00 (4,506,884,120)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.84	768,132.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.32	248,240.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	4.20	457,800.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	199,900	1.16	231,884.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.24	372,960.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.05	392,163.65	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.04	258,048.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.94	399,500.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.11	268,181.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	30.86	305,514.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.25	759,050.00	
	DBS GROUP	156,300	26.35	4,118,505.00	
	OCBC BANK	290,600	11.20	3,254,720.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	115,000	26.73	3,073,950.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	8.76	545,748.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.93	878,355.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	11.34	353,808.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	8.49	403,275.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.64	427,648.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	3.30	2,482,401.90	
シンガポールドル 小計		3,234,176		19,999,883.55 (1,635,390,477)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	15.59	1,056,316.04	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	542.60	1,164,419.60	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	28.81	2,832,311.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.67	3,469,958.85	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.78	1,570,110.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	93.00	1,162,779.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	258.00	1,115,334.00	
	NICE LTD	4,894	604.00	2,955,976.00	
イスラエルシェケル 小計		430,087		15,327,204.59 (488,631,282)	
合　計		95,761,902		394,997,447,530 (394,997,447,530)	

(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	102,205	1,168,203.15	
		LENDLEASE GROUP	44,009	825,168.75	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	812,334.40	
	オーストラリアドル 小計		236,074	2,805,706.30 (212,644,480)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,764,000.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,410,000.00	
	香港ドル 小計		595,500	6,174,000.00 (87,547,320)	
投資信託受益証券合計			831,574	300,191,800 (300,191,800)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	844,245.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,598,700.60	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,995	9,102,212.90	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,215,671.90	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,833	2,772,826.31	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,896,620.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	966,416.36	
		CROWN CASTLE INTL CORP	37,198	5,403,009.50	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,838	2,219,760.72	
	DUKE REALTY CORP	29,929	1,067,567.43	
	EQUINIX INC	7,467	4,390,596.00	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,570	1,027,476.40	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	33,874	2,794,605.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,757,779.17	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,951	1,221,693.56	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	780,936.37	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41,014	1,486,757.50	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,210,636.92	
	INVITATION HOMES INC	46,500	1,417,785.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,669	774,113.22	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	717,699.89	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,322	1,037,263.10	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	42,000	936,180.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,371,655.63	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	784,831.88	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	18,000	778,680.00	
	PROLOGIS INC	56,738	5,348,691.26	
	PUBLIC STORAGE	13,426	2,963,789.50	
	REALTY INCOME CORP	27,116	2,070,306.60	
	REGENCY CENTERS CORP	14,271	901,927.20	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,160	2,560,726.40	
	SIMON PROPERTY GROUP	27,453	4,056,729.81	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	736,033.08	
	SUN COMMUNITIES INC	7,365	1,140,985.80	
	UDR INC	24,799	1,176,712.55	
	VENTAS INC	30,413	1,788,588.53	
	VEREIT INC	105,798	1,011,428.88	
	VICI PROPERTIES INC	38,000	998,260.00	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	1,034,208.00	
	WELLTOWER INC	34,628	2,991,512.92	
	WP CAREY INC	14,644	1,217,502.16	
アメリカドル 小計		1,163,462	79,573,123.45 (8,768,162,472)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,600	311,696.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	265,379.85	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	203,282.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	424,890.70	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	182,050.23	
カナダドル 小計		48,641	1,387,299.28 (117,004,821)	

	ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	377,479.00	
		GECINA SA	4,459	741,977.60	
		ICADE	2,845	279,805.75	
		KLEPIERRE	17,225	561,362.75	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,888	1,594,180.80	
	ユーロ 小計		39,995	3,554,805.90 (434,539,473)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	466,954.32	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	573,907.10	
		SEGRO PLC	94,451	853,648.13	
	イギリスポンド 小計		232,415	1,894,509.55 (271,388,493)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,173,302.30	
		GOODMAN GROUP	140,271	2,054,970.15	
		GPT GROUP	167,884	990,515.60	
		MIRVAC GROUP	306,089	1,007,032.81	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,961,251.89	
		STOCKLAND	207,412	1,039,134.12	
		VICINITY CENTERS	291,115	745,254.40	
	オーストラリアドル 小計		1,693,524	8,971,461.27 (679,947,049)	
	香港ドル	LINK REIT	179,500	15,481,875.00	
	香港ドル 小計		179,500	15,481,875.00 (219,532,987)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	229,100	719,374.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	520,020.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	200,300	520,780.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	539,000.00	
		SUNTEC REIT	173,000	325,240.00	
	シンガポールドル 小計		1,065,400	2,624,414.00 (214,598,332)	
投資証券合計			4,422,937	10,705,173,627 (10,705,173,627)	
合計				11,005,365,427 (11,005,365,427)	

(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　610銘柄	96.9%	—	—	67.5%
	投資証券　41銘柄	—	—	3.1%	2.2%
カナダドル	株式　85銘柄	99.2%	—	—	3.6%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.8%	0.0%
ユーロ	株式　236銘柄	99.1%	—	—	11.2%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式　93銘柄	98.9%	—	—	5.7%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.1%	0.1%
スイスフラン	株式　39銘柄	100.0%	—	—	3.4%
スウェーデンクローナ	株式　32銘柄	100.0%	—	—	1.0%
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	91.1%	—	—	2.3%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.1%	—	0.1%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.8%	0.2%
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	—	1.8%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.6%	0.1%
シンガポールドル	株式　20銘柄	88.4%	—	—	0.4%
	投資証券　5銘柄	—	—	11.6%	0.1%
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。

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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,313,360,525
コール・ローン	941,100,347
国債証券	57,436,870,553
未収利息	830,228,749
前払費用	85,522,964
流動資産合計	60,607,083,138
資産合計	60,607,083,138
負債の部	
流動負債	
未払解約金	120,633,302
未払利息	377
流動負債合計	120,633,679
負債合計	120,633,679
純資産の部	
元本等	
元本	33,299,525,287
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	27,186,924,172
元本等合計	60,486,449,459
純資産合計	60,486,449,459
負債純資産合計	60,607,083,138

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1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	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。

	2020年 1月20日現在

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	33,299,525,287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　1.8164円 (1万口当たり純資産額)　(18,164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 1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 1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。

	2020年 1月20日現在
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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	28,341,111,188円
期中追加設定元本額	7,566,911,064円
期中一部解約元本額	2,608,496,965円
期末元本額	33,299,525,287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	4,113,455,750円
世界経済インデックスファンド	5,567,807,499円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	4,382,387,416円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,342,209,834円

区分	2020年 1月20日現在
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,823,854,114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）	97,764,927円
分散投資コア戦略ファンドＡ	238,608,738円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,162,765,699円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	247,408,584円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,410,307,452円
コア投資戦略ファンド（切替型）	144,618,229円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	187,696,489円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	87,261,882円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	185,823,171円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,225,015,997円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	104,955,096円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	121,777,144円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	183,824,296円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,406,406円
グローバル経済コア	720,157,475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	22,339円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	23,809円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	25,278円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	26,454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）	96,902,724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 1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	204,183,190
合計	204,183,190

(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	22,700,000.00	29,367,557.50	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	93,452,861.25	
		MBONO 5.75% 03/05/26	51,600,000.00	49,057,152.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	80,796,030.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	83,000,000.00	82,753,490.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	300,000.00	300,010.50	
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	83,164,672.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000.00	95,923,542.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	53,235,951.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	65,912,625.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	25,834,560.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	81,800,000.00	91,321,929.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	55,447,296.50	
		MBONO 8% 09/05/24	39,800,000.00	41,770,100.00	
		MBONO 8% 11/07/47	54,800,000.00	60,569,892.00	
		MBONO 8% 12/07/23	112,900,000.00	117,627,687.50	
	メキシコペソ 小計		968,550,000.00	1,026,535,356.75 (6,066,823,958)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	25,934,640.13	
		BLTN 0% 07/01/21	22,550,000.00	21,104,317.24	
		BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00	24,245,956.05	
		BLTN 0% 07/01/23	48,550,000.00	39,851,621.78	
		BNTNF 10% 01/01/23	31,850,000.00	35,502,212.77	
		BNTNF 10% 01/01/25	24,450,000.00	28,168,851.38	
		BNTNF 10% 01/01/27	22,150,000.00	26,170,607.33	
		BNTNF 10% 01/01/29	12,700,000.00	15,362,366.54	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,696,625.00	
		BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	513,281.25	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,065,062.50	
	ブラジルレアル 小計		222,100,000.00	220,615,541.97 (5,841,899,551)	
	チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/21	825,000,000.00	849,293,311.35	

	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,855,000,000.00	2,025,875,992.49	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,545,000,000.00	1,749,934,726.62	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,530,000,000.00	1,608,929,555.85	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,170,000,000.00	2,558,939,802.44	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,770,000,000.00	2,442,558,780.24	
チリペソ 小計		9,695,000,000.00	11,235,532,168.99 (1,602,186,887)	
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	23,178,892,000.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	3,550,000,000.00	3,664,487,500.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	64,500,000,000.00	81,359,010,000.00	
コロンビアペソ 小計		91,700,000,000.00	108,202,389,500.00 (3,581,499,092)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	6,734,937.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,400,000.00	3,809,547.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,129,550.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	7,992,915.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,200,000.00	9,568,006.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	9,107,287.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,000,000.00	8,500,730.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	7,000,000.00	8,916,005.00	
ペルーヌエボソル 小計		53,600,000.00	62,758,977.50 (2,081,715,283)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	13,629,252.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,188,298.00	
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	30,817,550.00 (90,911,772)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,472,624.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	25,644,250.00	
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	46,116,874.00 (95,461,929)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	3,450,465.75	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,050,000.00	7,996,950.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	9,744,198.75	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,700,000.00	6,757,821.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	10,910,067.50	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	9,487,395.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	5,600,000.00	5,685,008.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	10,395,247.50	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	5,671,276.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	7,023,000.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,684,377.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	6,268,665.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	11,100,000.00	10,097,559.00	

	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,850,000.00	10,740,415.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,970,915.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,921,647.50	
トルコリラ 小計		119,600,000.00	119,805,008.50 (2,241,551,709)	
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	38,200,000.00	34,609,773.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	29,000,000.00	27,746,330.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	48,400,000.00	44,783,310.00	
	CZGB 1% 06/26/26	47,900,000.00	46,061,837.50	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	53,624,117.50	
	CZGB 2.5% 08/25/28	55,000,000.00	58,726,525.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	53,222,525.50	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	39,277,475.50	
	CZGB 4.7% 09/12/22	43,400,000.00	46,824,477.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	44,301,081.50	
チェココルナ 小計		437,700,000.00	449,177,452.50 (2,183,002,419)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	576,364,725.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	585,779,120.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	270,000,000.00	281,770,650.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	462,500,000.00	496,944,687.50	
	HGB 3% 06/26/24	512,500,000.00	559,329,687.50	
	HGB 3% 08/21/30	315,000,000.00	339,272,325.00	
	HGB 3% 10/27/27	678,000,000.00	739,233,570.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	688,000,000.00	842,239,280.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	638,492,985.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	462,090,880.00	
	HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	555,700,207.50	
ハンガリーフォリント 小計		5,367,500,000.00	6,077,218,117.50 (2,209,068,785)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	12,650,000.00	12,687,191.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,158,520.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	5,600,000.00	5,665,128.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000.00	21,601,235.25	
	POLGB 2.5% 04/25/24	11,550,000.00	11,825,640.75	
	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000.00	16,714,187.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,300,000.00	14,518,075.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	12,950,000.00	13,374,501.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	9,850,000.00	10,214,499.25	
	POLGB 2% 04/25/21	10,050,000.00	10,113,918.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000.00	13,438,314.50	
	POLGB 4% 10/25/23	20,050,000.00	21,614,702.00	

	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	11,987,622.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	5,350,000.00	5,735,975.75	
ポーランドズロチ 小計		175,500,000.00	181,649,510.00 (5,238,771,868)	
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	135,100,000.00	139,117,198.50	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	167,966,640.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	188,746,605.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	173,181,294.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	47,500,000.00	50,467,087.50	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	176,123,872.50	
	RFLB 7.4% 07/17/24	219,200,000.00	233,416,216.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	173,095,793.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	126,657,405.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,500,000.00	66,220,537.50	
	RFLB 7.6% 07/20/22	138,700,000.00	145,350,665.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	50,300,000.00	56,210,753.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	197,987,881.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	198,206,147.50	
	RFLB 7.95% 10/07/26	147,000,000.00	163,051,665.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	101,064,186.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	111,971,472.00	
	RFLB 7% 12/15/21	170,500,000.00	175,063,432.50	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	175,634,160.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	147,410,550.00	
ロシアルーブル 小計		2,758,750,000.00	2,966,943,561.00 (5,310,828,974)	
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,217,799.75	
	MGS 3.62% 11/30/21	10,200,000.00	10,320,717.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	14,200,000.00	14,659,228.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,949,619.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	8,852,193.75	
	MGS 3.885% 08/15/29	11,550,000.00	12,126,576.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,082,390.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,367,250.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	8,735,538.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,663,512.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,550,000.00	7,846,677.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	11,850,000.00	12,055,182.75	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	9,852,381.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,700,000.00	7,701,449.00	
マレーシアリンギット 小計		131,300,000.00	136,430,514.00 (3,704,088,455)	
タイバーツ	THAIGB 1.45% 12/17/24	27,500,000.00	27,755,200.00	

		THAIGB 1.875% 06/17/22	96,500,000.00	98,086,942.50	
		THAIGB 2.125% 12/17/26	94,500,000.00	99,462,195.00	
		THAIGB 2.4% 12/17/23	112,500,000.00	117,492,750.00	
		THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	73,165,269.00	
		THAIGB 2% 12/17/22	84,500,000.00	86,465,892.50	
		THAIGB 3.3% 06/17/38	102,400,000.00	126,492,160.00	
		THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000.00	217,842,744.00	
		THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,806,520.00	
		THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	166,397,158.50	
		THAIGB 3.65% 12/17/21	64,100,000.00	67,102,123.50	
		THAIGB 3.775% 06/25/32	78,000,000.00	96,552,690.00	
		THAIGB 3.85% 12/12/25	107,800,000.00	123,530,715.00	
		THAIGB 4.875% 06/22/29	116,000,000.00	150,904,400.00	
	タイバーツ 小計		1,346,200,000.00	1,542,056,760.00 (5,628,507,174)	
	フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,006,225.00	
		PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	36,708,450.00	
	フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	51,714,675.00 (111,703,698)	
	インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,164,712,000.00	
		INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,680,975,000.00	
		INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,481,326,000.00	
		INDOGB 5.625% 05/15/23	48,800,000,000.00	48,551,364,000.00	
		INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	34,351,740,000.00	
		INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	27,083,680,000.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	23,284,638,000.00	
		INDOGB 7.5% 06/15/35	6,200,000,000.00	6,303,385,000.00	
		INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	25,223,250,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/22	42,200,000,000.00	43,448,487,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	37,411,248,000.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	15,300,000,000.00	15,521,391,000.00	
		INDOGB 8.125% 05/15/24	29,600,000,000.00	31,820,000,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	44,700,000,000.00	48,908,952,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	35,356,174,000.00	
		INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	20,239,726,500.00	
		INDOGB 8.25% 07/15/21	31,800,000,000.00	33,096,963,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	58,800,000,000.00	63,617,484,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	56,316,000,000.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,004,862,000.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000.00	55,264,422,500.00	
		INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	36,776,382,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,416,375,000.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	36,853,700,000.00	

	インドネシアルピア 小計		710,300,000,000.00	752,177,237,000.00 (6,092,635,619)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	105,000,000.00	117,703,425.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	24,837,219.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	52,700,000.00	36,607,264.50	
		SAGB 6.75% 03/31/21	22,950,000.00	22,983,048.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	47,900,000.00	48,854,168.00	
		SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	35,454,969.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	46,109,148.75	
		SAGB 8.5% 01/31/37	93,300,000.00	82,524,783.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	59,646,356.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	77,830,308.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	42,550,000.00	39,658,514.75	
		SAGB 8% 01/31/30	83,400,000.00	77,940,636.00	
		SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	31,844,050.00	
	南アフリカランド 小計		767,050,000.00	701,993,890.00 (5,356,213,380)	
合計				57,436,870,553 (57,436,870,553)	

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%	10.6%
ブラジルレアル	国債証券　11銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券　6銘柄	100.0%	2.8%
コロンビアペソ	国債証券　3銘柄	100.0%	6.2%
ペルーヌエボソル	国債証券　8銘柄	100.0%	3.6%
ウルグアイペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.2%
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　16銘柄	100.0%	3.9%
チェココルナ	国債証券　10銘柄	100.0%	3.8%
ハンガリーフォリント	国債証券　11銘柄	100.0%	3.8%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	9.1%
ロシアルーブル	国債証券　20銘柄	100.0%	9.2%
マレーシアリンギット	国債証券　14銘柄	100.0%	6.4%
タイバーツ	国債証券　14銘柄	100.0%	9.8%

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　24銘柄	100.0%	10.6%
南アフリカランド	国債証券　13銘柄	100.0%	9.3%

(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。

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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,301,442,730
コール・ローン	104,271,977
株式	69,368,831,475
投資信託受益証券	246,376,472
投資証券	168,158,006
派生商品評価勘定	73,475,431
未収入金	2,470,810
未収配当金	63,282,796
差入委託証拠金	855,480,950
流動資産合計	73,183,790,647
資産合計	73,183,790,647
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	196,795
前受金	73,268,636
未払金	19,848,121
未払株式払込金	1,800,864
未払解約金	134,384,998
未払利息	41
流動負債合計	229,499,455
負債合計	229,499,455
純資産の部	
元本等	
元本	23,263,694,840
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	49,690,596,352
元本等合計	72,954,291,192
純資産合計	72,954,291,192
負債純資産合計	73,183,790,647

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1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 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

	2020年 1月20日現在
	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 1月20日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		23,263,694,840口
2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	3.1360円
	(1万口当たり純資産額)	(31,360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 1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。

	2020年 1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 1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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	19,183,829,395円
期中追加設定元本額	5,573,513,977円
期中一部解約元本額	1,493,648,532円
期末元本額	23,263,694,840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	7,229,169,628円
世界経済インデックスファンド	3,341,714,946円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	4,269,703,017円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	4,394,505,833円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	209,102,636円
分散投資コア戦略ファンドＡ	347,760,091円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,245,634,607円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	459,734,910円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	484,087,793円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	339,457,426円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,787,534円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	108,865,193円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	63,230,215円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	225,584,918円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,908,299円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,477,416円
グローバル経済コア	423,042,879円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	15,644,376円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	26,252円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	29,706円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	33,160円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	36,269円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	50,157,736円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2020年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,418,724,114
投資信託受益証券	23,136,325
投資証券	△824,931
合計	4,441,035,508

(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 1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	3,064,571,223	－	3,137,839,859	73,268,636
合計		3,064,571,223	－	3,137,839,859	73,268,636

(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 1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	44,082,000	－	44,072,000	10,000
	アメリカドル	44,082,000	－	44,072,000	10,000
合計		44,082,000	－	44,072,000	10,000

(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	539,935	8.20	4,427,467.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.81	84,864.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	39,588	108.40	4,291,339.20	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,639	204.20	1,968,283.80	
	ROSNEFT OJSC-GDR	133,544	7.82	1,044,314.08	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	102,995	8.68	894,511.57	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	26,908	78.96	2,124,655.68	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	10.32	160,073.52	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	13.54	229,232.20	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,497	35.22	2,342,024.34	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	24.26	475,447.48	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	26,818	13.17	353,193.06	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	59.55	424,234.20	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	15.83	613,776.59	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,045	43.93	353,416.85	
	51JOB INC-ADR	2,701	90.67	244,899.67	
	BEST INC - ADR	14,126	6.41	90,547.66	
	DP WORLD PLC	21,152	14.09	298,031.68	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	29,952	24.18	724,239.36	
	NIO INC - ADR	53,878	4.67	251,610.26	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	39.29	546,956.09	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	13,433	135.75	1,823,529.75	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	36,996	54.02	1,998,523.92	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	35,200	49.85	1,754,720.00	
	58.COM INC-ADR	9,450	68.70	649,215.00	
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	87.74	464,846.52	
	BAIDU INC - SPON ADR	27,285	139.61	3,809,258.85	
	HUYA INC-ADR	3,593	20.43	73,404.99	
	IQIYI INC-ADR	11,977	23.91	286,370.07	
	JOYY INC	6,185	66.09	408,766.65	
	MOMO INC-SPON ADR	15,529	37.29	579,076.41	
	NETEASE INC-ADR	6,869	349.82	2,402,913.58	
	SINA CORP	5,725	43.06	246,518.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	14.08	127,747.84	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	46.79	245,600.71	

	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	167,046	227.43	37,991,271.78	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	35.56	124,744.48	
	JD.COM INC-ADR	71,913	40.35	2,901,689.55	
	PINDUODUO INC-ADR	17,726	39.43	698,936.18	
	TRIP.COM GROUP LTD	45,465	38.94	1,770,407.10	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	14.41	684,302.08	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47,223	13.28	627,357.55	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	3,643	29.41	107,140.63	
	BANCO MACRO SA-ADR	4,035	33.05	133,356.75	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	147,287	5.24	771,783.88	
	CREDICORP LTD	6,868	216.85	1,489,325.80	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	14,502	15.60	226,231.20	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	253,773	17.22	4,371,239.92	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	267,408	1.54	413,412.76	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	37.93	76,656.53	
	QUDIAN INC-SPON ADR	20,893	3.52	73,543.36	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.99	54,323.13	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	6,140	54.90	337,086.00	
	GLOBANT SA	3,122	119.67	373,609.74	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	10.50	418,467.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	11.99	176,444.84	
アメリカドル 小計		2,722,560		90,634,941.34 (9,987,064,186)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,455,661	7.82	11,383,269.02	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	350,392	58.70	20,568,010.40	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	207.64	3,010,780.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	48.04	4,652,770.08	
	ALFA S.A.B.-A	359,900	15.84	5,700,816.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	75.82	2,843,250.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	384.30	8,956,111.50	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	247.79	7,701,313.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	205.11	3,482,767.80	
	ALSEA SAB DE CV	34,300	49.42	1,695,106.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	46.52	10,392,102.80	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	75.94	2,384,516.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	102.67	1,119,103.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	510,280	58.12	29,657,473.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	105.75	5,337,731.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	188,640	176.80	33,351,552.00	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	207.53	5,387,478.80	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	35.69	6,488,442.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	41.25	7,499,250.00	

	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	247,600	112.73	27,911,948.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	24.86	6,277,150.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,314,140	15.50	51,369,170.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	87.71	5,043,325.00	
メキシコペソ 小計		7,696,855		262,213,436.45 (1,549,681,409)	
ブラジルレアル	COSAN SA	18,400	78.00	1,435,200.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	297,600	31.85	9,478,560.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	409,040	29.85	12,209,844.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	26.27	1,986,012.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	34.27	507,196.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	14.78	931,140.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	21.57	2,264,850.00	
	SUZANO SA	50,679	43.78	2,218,726.62	
	VALE SA	310,478	57.00	17,697,246.00	
	EMBRAER SA	69,700	19.55	1,362,635.00	
	WEG SA	84,872	36.80	3,123,289.60	
	CCR SA	125,600	19.03	2,390,168.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	49.49	3,066,004.48	
	RUMO SA	97,700	24.30	2,374,110.00	
	COGNA EDUCACAO	138,184	11.67	1,612,607.28	
	B2W CIA DIGITAL	20,960	71.26	1,493,609.60	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	28.33	1,805,074.28	
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	59.22	4,909,752.54	
	MAGAZINE LUIZA SA	70,100	54.35	3,809,935.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	28.75	2,185,000.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	23.39	970,685.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	90.04	1,332,592.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,500	115.68	2,834,160.00	
	AMBEV SA	470,500	18.70	8,798,350.00	
	BRF SA	52,500	35.75	1,876,875.00	
	JBS SA	106,400	29.75	3,165,400.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	62,900	45.88	2,885,852.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	63.00	1,266,300.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	46,200	74.10	3,423,420.00	
	HYPERA SA	35,300	37.42	1,320,926.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,362	33.58	3,907,435.96	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	405,653	35.45	14,380,398.85	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	50.12	4,425,596.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	483,781	34.94	16,903,308.14	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	446,767	13.60	6,076,031.20	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	200,703	45.34	9,099,874.02	

	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	36.14	2,493,660.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	69,100	43.21	2,985,811.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	65.02	474,646.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,963	18.97	1,630,718.11	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	34.56	1,569,024.00	
	CIELO SA	99,269	7.23	717,714.87	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	42,600	59.62	2,539,812.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	16.64	1,213,056.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	41.17	728,709.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	40.25	1,352,400.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	98,092	15.64	1,534,158.88	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	60.15	2,087,205.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,750	53.43	894,952.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	81,000	24.51	1,985,310.00	
ブラジルレアル 小計		5,625,928		181,735,341.93 (4,812,351,854)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	7,799.00	348,849,270.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	2,077.00	282,399,305.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	23,783.00	234,429,031.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	30,286	7,025.00	212,759,150.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	3,250.00	230,220,250.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,057.00	145,853,316.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	7,450.00	69,456,350.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,247.00	34,181,364.00	
	BANCO DE CHILE	3,735,628	82.06	306,545,633.68	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,194	36,402.00	189,071,988.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	43.60	273,800,195.60	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	4.01	67,180,864.71	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,450.00	101,108,400.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	321.30	91,966,662.90	
	COLBUN SA	475,888	127.88	60,856,557.44	
	ENEL AMERICAS SA	3,990,008	170.99	682,251,467.92	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	77.10	197,474,533.80	
チリペソ 小計		34,555,956		3,528,404,340.05 (503,150,458)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	3,385.00	1,655,193,915.00	
	GRUPO ARGOS SA	33,752	18,100.00	610,911,200.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	44,600.00	1,310,169,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	45,880.00	1,756,194,640.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,450.00	440,376,600.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	32,700.00	680,814,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	19,520.00	985,974,720.00	

コロンビアペソ 小計		965,424		7,439,634,675.00 (246,251,907)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,794	20.52	118,892.88	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	4,358	19.06	83,063.48	
	OPAP SA	17,668	11.44	202,121.92	
	JUMBO SA	8,599	18.69	160,715.31	
	ALPHA BANK AE	129,138	1.87	241,617.19	
	EUROBANK ERGASIAS SA	291,098	0.90	261,988.20	
	NATIONAL BANK OF GREECE	53,130	3.00	159,708.78	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.80	361,656.60	
ユーロ 小計		535,992		1,589,764.36 (194,332,795)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	12.49	333,483.00	
イギリスポンド 小計		26,700		333,483.00 (47,771,439)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	121.00	1,403,963.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	9.50	1,109,172.50	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	22.92	545,748.12	
	KOC HOLDING AS	89,884	21.14	1,900,147.76	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	28,973	28.88	836,740.24	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	15.03	934,730.73	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	76.00	494,076.00	
	ARCELIK AS	15,358	22.02	338,183.16	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	49.54	2,121,500.96	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	21,501	25.58	549,995.58	
	AKBANK T.A.S.	276,321	8.82	2,437,151.22	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	12.20	2,927,902.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	7.10	1,228,385.20	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	10.54	1,205,544.12	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	14.36	1,365,578.56	
トルコリラ 小計		1,318,200		19,398,819.55 (362,951,913)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	813.00	6,067,419.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	84.80	5,829,830.40	
	CEZ AS	13,737	519.00	7,129,503.00	
チェココルナ 小計		89,948		19,026,752.40 (92,470,016)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,854.00	120,881,170.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	6,645.00	100,857,810.00	
	OTP BANK NYRT	21,391	14,140.00	302,468,740.00	
ハンガリーフォリント 小計		78,924		524,207,720.00 (190,549,506)	

ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	11,057	85.66	947,142.62	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	86.24	2,648,689.12	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	4.25	622,612.25	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	101.00	1,326,332.00	
	CCC SA	3,138	96.95	304,229.10	
	LPP SA	124	8,740.00	1,083,760.00	
	AMREST HOLDINGS SE	7,816	46.15	360,708.40	
	CD PROJEKT SA	6,704	266.50	1,786,616.00	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.60	672,157.20	
	DINO POLSKA SA	4,430	155.60	689,308.00	
	BANK MILLENNIUM SA	99,381	6.14	610,696.24	
	BANK PEKAO SA	15,510	103.50	1,605,285.00	
	M BANK SA	1,663	384.80	639,922.40	
	PKO BANK POLSKI SA	86,794	35.00	3,037,790.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	306.60	1,108,359.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	41.65	2,584,132.60	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	7.86	437,750.17	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.72	490,570.09	
ポーランドズロチ 小計		635,274		20,956,060.19 (604,372,775)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.02	295,960.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	12.76	2,449,920.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,557,400	4.72	12,070,928.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	344,000	15.70	5,400,800.00	
	CNOOC LTD-R	1,764,000	13.52	23,849,280.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	3.76	323,360.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,152,000	3.94	8,478,880.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.81	967,020.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.64	897,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	57.65	6,341,500.00	
	BBMG CORPORATION - H	131,000	2.43	318,330.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	4.80	487,200.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	3.56	1,196,160.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	9.43	3,885,160.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	10.18	2,137,800.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.11	247,556.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	10.78	894,740.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.18	1,025,880.00	
	MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	3.13	913,960.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	8.22	1,060,380.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	2.32	461,680.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	9.09	822,645.00	

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.94	2,872,260.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	3.59	445,160.00	
BOC AVIATION LTD	32,500	74.70	2,427,750.00	
CHINA COMMUICATIONS CONST-H	395,000	6.27	2,476,650.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	5.75	1,127,000.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	38.20	6,092,900.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	79,000	11.30	892,700.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	8.64	1,654,560.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.89	2,317,860.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	7.25	1,232,500.00	
CITIC LTD	585,000	10.18	5,955,300.00	
CRRC CORP LTD-H	511,050	5.85	2,989,642.50	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	12.32	3,548,160.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	19.66	688,100.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	1.73	247,390.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.59	435,120.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	14.94	567,720.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	4.85	346,775.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	16.52	702,100.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	15.82	3,350,676.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	9.36	294,053.76	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	29.25	1,822,275.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	7.12	827,344.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	21,750	30.15	655,762.50	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	6.15	2,368,205.10	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	29.15	3,964,400.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	9.28	1,670,400.00	
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	7.79	1,667,060.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	6.92	747,360.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	308,000	4.28	1,318,240.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	13.94	2,307,725.18	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.34	939,840.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	3.18	465,870.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	6.36	663,627.84	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.86	738,480.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	64,000	11.24	719,360.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	18.20	2,328,180.40	
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	2.95	324,500.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.32	644,160.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	4.50	526,500.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	7.79	1,947,500.00	
BYD CO LTD-H	68,500	48.00	3,288,000.00	

CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	0.27	67,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	6.90	1,835,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	25.60	696,320.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	471,000	15.52	7,309,920.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	6.03	2,127,082.50	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	9.40	2,372,033.60	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	6.83	628,360.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	77.00	8,547,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	3.03	587,820.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	25.25	2,929,000.00	
LI NING CO LTD	194,000	27.70	5,373,800.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	117.30	8,211,000.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	17.34	780,300.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	27,000	11.60	313,200.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	37,000	35.30	1,306,100.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.46	2,117,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	32,200	36.90	1,188,180.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	565,500	399.00	225,634,500.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.75	445,468.50	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	102,700	111.90	11,492,130.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	31.85	1,337,700.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	10.40	2,028,000.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	4.16	428,480.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	32.15	8,262,550.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	41.25	5,857,500.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.97	719,385.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	14.06	3,205,680.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	50.65	2,329,900.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.64	691,200.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	7.10	3,976,000.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	53.10	2,548,800.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	60.40	4,016,600.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	358,000	10.06	3,601,480.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	33,500	61.80	2,070,300.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	9.99	2,437,560.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.80	2,028,720.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	29.10	3,643,320.00	
3SBIO INC	119,000	11.24	1,337,560.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	12.04	1,204,000.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	452,000	18.92	8,551,840.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	7.13	1,122,975.00	

CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.92	650,720.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	18.80	1,541,600.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	38,000	27.75	1,054,500.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	73,500	31.85	2,340,975.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	6.23	507,745.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	24.05	1,334,775.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	674,000	11.74	7,912,760.00	
SSY GROUP LTD	114,000	6.92	788,880.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	19,100	104.50	1,995,950.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	54,500	106.00	5,777,000.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,929,000	3.35	9,812,150.00	
BANK OF CHINA LTD-H	8,066,200	3.30	26,618,460.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	5.49	5,201,637.75	
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.58	4,356,496.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,427,620	6.77	63,824,987.40	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	3.66	2,507,100.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	436,923	41.20	18,001,227.60	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	5.97	4,026,168.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	4.04	610,040.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,452,515	5.89	38,005,313.35	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	730,000	5.31	3,876,300.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.83	1,522,560.00	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80,000	23.08	1,846,400.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	14.30	1,916,200.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.60	1,511,100.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.29	1,195,830.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	16.06	2,119,920.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	17.98	3,578,020.00	
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.56	1,065,960.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.22	905,492.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	14.44	854,848.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	9.09	2,516,112.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	14.00	2,223,200.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	747,000	22.00	16,434,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	270,800	30.95	8,381,260.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	1.28	305,920.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	19.80	2,808,115.20	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	34.65	3,340,260.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.29	2,276,680.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	9.68	6,672,307.84	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	573,000	99.55	57,042,150.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	32.35	1,478,395.00	

AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	12.20	1,732,400.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	12.86	1,620,360.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	20.30	3,775,800.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	6.28	3,629,840.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	381,040	29.65	11,297,836.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	265,111	37.40	9,915,151.40	
CHINA VANKE CO LTD-H	151,200	32.20	4,868,640.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.44	1,777,440.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	789,154	12.08	9,532,980.32	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	204,000	9.10	1,856,400.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	14.02	1,895,504.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	4.06	633,360.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	11.76	1,046,640.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	150,000	13.68	2,052,000.00	
LONGFOR PROPERTIES	178,500	37.40	6,675,900.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	3.07	1,031,520.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	32.10	4,253,250.00	
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.84	385,480.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	3.25	1,717,920.75	
SOHO CHINA LTD	113,000	3.24	366,120.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	234,000	44.95	10,518,300.00	
WHARF HOLDINGS	100,000	22.10	2,210,000.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.77	1,023,060.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	104,086	4.42	460,060.12	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	5.26	689,060.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	9.73	2,354,660.00	
KINGSOFT CORP LTD	66,000	26.15	1,725,900.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	20.10	1,587,900.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	65.10	4,654,650.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	17.36	1,475,600.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	4.54	1,071,440.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	25.10	1,681,700.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	9.81	676,890.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	17.36	366,296.00	
LENOVO GROUP LTD	732,000	5.90	4,318,800.00	
SUNNY OPTICAL TECH	69,000	142.10	9,804,900.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	753,200	13.24	9,972,368.00	
ZTE CORP-H	82,908	29.35	2,433,349.80	
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	604,500	66.20	40,017,900.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	3.20	4,339,200.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,156,000	1.80	7,480,800.00	
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	618,000	7.16	4,424,880.00	

	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	36.60	1,427,400.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	4.08	2,488,800.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.08	2,791,360.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	172,200	31.65	5,450,130.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	5.04	1,275,120.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.68	1,118,880.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	43.60	3,749,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	11.18	1,960,972.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	138,000	1.48	204,240.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	75,100	95.05	7,138,255.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	272,000	16.78	4,564,160.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	2.90	533,600.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.95	1,461,500.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	538,000	3.10	1,667,800.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	6.98	2,512,800.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	5.47	251,620.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	22.35	1,005,750.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	15.44	4,091,600.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	224,453	6.00	1,346,718.00	
香港ドル 小計		88,752,743		1,039,619,647.41 (14,741,806,600)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.39	1,402,334.52	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	23.80	597,380.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	7.03	1,477,003.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	5.17	746,031.00	
	GAMUDA BHD	139,200	4.10	570,720.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.95	380,090.00	
	IJM CORP BHD	198,100	2.21	437,801.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.26	760,141.96	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	1.65	106,920.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	7.09	755,751.46	
	MISC BHD	125,040	8.20	1,025,328.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.11	287,700.00	
	GENTING BHD	205,300	6.18	1,268,754.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	3.36	1,242,192.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	13.70	149,330.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	33.32	283,220.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.60	148,400.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.63	831,733.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.40	1,337,120.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	145.60	1,004,640.00	

	PPB GROUP BERHAD	52,680	18.50	974,580.00	
	QL RESOURCES BHD	83,200	8.15	678,080.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	5.31	1,311,814.26	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	5.50	872,300.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.63	1,290,959.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	4.76	468,384.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	3.94	512,988.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	517,519	5.16	2,670,398.04	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	16.96	1,039,512.32	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	16.86	251,770.38	
	MALAYAN BANKING BHD	404,004	8.62	3,482,514.48	
	PUBLIC BANK BERHAD	298,520	19.60	5,850,992.00	
	RHB BANK BHD	206,419	5.84	1,205,486.96	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	4.60	1,312,329.40	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.62	1,440,054.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.70	1,527,030.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	4.02	283,619.04	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.50	1,245,750.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	323,475	12.90	4,172,827.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.98	247,317.70	
マレーシアリンギット 小計		6,810,082		45,651,297.22 (1,239,432,719)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	364,800	11.60	4,231,680.00	
	IRPC PCL - NVDR	829,500	3.36	2,787,120.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	132.00	16,460,400.00	
	PTT PCL-NVDR	1,097,800	46.00	50,498,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	62.50	7,506,250.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	32.00	6,604,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	56.25	12,652,537.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	371.00	30,051,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	75.00	32,107,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	11.40	9,313,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	471,100	13.80	6,501,180.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	323,310	35.00	11,315,850.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,235	16.20	7,634,007.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	68.25	2,375,100.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	102,700	42.25	4,339,075.00	
	CP ALL PCL-NVDR	566,800	74.25	42,084,900.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	30.50	10,391,350.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	44.50	2,937,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	449,700	14.70	6,610,590.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	930,100	26.00	24,182,600.00	

	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	145.00	4,756,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	154.50	8,018,550.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	142.00	17,948,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	141.50	11,079,450.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	16.40	7,193,860.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127,400	117.00	14,905,800.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,147,300	1.56	4,909,788.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	64.00	5,747,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	70.50	5,379,150.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	64.00	14,483,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	10.20	8,894,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	217.00	22,980,300.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	60.25	14,682,925.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	48.75	3,217,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.16	3,999,461.44	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	63.00	3,364,200.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	336.00	7,795,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	41.00	7,605,500.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	92.25	6,291,450.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	52,400	195.00	10,218,000.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	73.00	3,963,900.00	
タイバーツ 小計		15,131,938		478,020,173.94 (1,744,773,634)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	54.00	12,848,760.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	803.00	22,708,840.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	789.00	5,410,962.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	289,060	72.00	20,812,320.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	1,055.00	24,059,275.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	132.70	19,175,150.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	213.60	13,031,736.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	153.50	14,668,460.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	87.50	5,236,437.50	
	BDO UNIBANK INC	173,721	157.50	27,361,057.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	65.05	10,491,719.35	
	SECURITY BANK CORP	30,810	191.00	5,884,710.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.50	8,244,950.00	
	AYALA LAND INC	742,900	43.55	32,353,295.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.30	2,743,400.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	27.70	2,576,100.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,000,150	40.70	40,706,105.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,098.00	9,839,620.00	
	PLDT INC	6,225	1,086.00	6,760,350.00	

	ABOITIZ POWER CORP	89,500	32.55	2,913,225.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	291.00	8,471,010.00	
フィリピンペソ 小計		6,270,951		296,297,482.35 (640,002,561)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,480.00	2,130,164,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	2,670.00	1,194,291,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	21,775.00	4,374,597,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	1,310.00	3,776,075,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,225.00	2,008,545,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	18,750.00	3,562,500,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	11,250.00	975,375,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	12,850.00	3,014,610,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,175.00	639,112,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	7,075.00	15,230,352,500.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,620.00	1,467,234,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	792,300	7,375.00	5,843,212,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	58,300.00	3,474,680,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	2,240.00	2,056,096,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	11,575.00	1,863,575,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	8,250.00	3,540,075,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	8,400.00	6,269,760,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,615.00	4,450,778,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	953,200	34,375.00	32,766,250,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,725.00	14,044,791,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,775.00	6,299,305,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	669,100	2,150.00	1,438,565,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,246,000	4,630.00	24,288,980,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,275.00	871,335,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	585.00	942,084,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,870,600	3,810.00	18,556,986,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	387,000	3,360.00	1,300,320,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	2,020.00	1,598,830,000.00	
インドネシアルピア 小計		32,609,096		167,978,480,100.00 (1,360,625,688)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	48,850.00	322,068,050.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	84,100.00	373,992,700.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	133,500.00	745,731,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	19,600.00	209,837,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	30,050.00	217,622,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	416,000.00	325,728,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,512	77,700.00	195,182,400.00	
	LG CHEM LTD	4,436	333,000.00	1,477,188,000.00	

LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,129	179,000.00	202,091,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	217,500.00	419,775,000.00	
OCI COMPANY LTD	1,127	63,800.00	71,902,600.00	
POSCO	7,894	241,500.00	1,906,401,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	54,200.00	184,225,800.00	
CJ CORP	1,230	92,400.00	113,652,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,217	85,400.00	274,731,800.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	33,865	4,655.00	157,641,575.00	
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	32,650.00	140,656,200.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	30,100.00	203,476,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,825	23,600.00	66,670,000.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	23,400.00	51,503,400.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	42,050.00	388,499,950.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	318,000.00	257,580,000.00	
KCC CORP	870	233,500.00	203,145,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	32,950.00	170,549,200.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	3,318	128,000.00	424,704,000.00	
LG CORP	9,902	72,800.00	720,865,600.00	
LOTTE CORP	2,370	35,700.00	84,609,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	17,850.00	106,885,800.00	
SAMSUNG C&T CORP	8,727	107,500.00	938,152,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	19,050.00	352,729,800.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,410.00	275,288,910.00	
SK HOLDINGS CO LTD	3,449	245,000.00	845,005,000.00	
S-1 CORPORATION	960	93,100.00	89,376,000.00	
CJ LOGISTICS	862	144,000.00	124,128,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	144,500.00	210,247,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	27,400.00	150,809,600.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,310.00	128,162,160.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	31,000.00	219,046,000.00	
HANON SYSTEMS	19,000	11,100.00	210,900,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,414	248,000.00	1,590,672,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	14,394	118,500.00	1,705,689,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,286	81,400.00	348,880,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	73,000.00	219,219,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	25,363	41,400.00	1,050,028,200.00	
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	48,200.00	196,656,000.00	
HLB INC	3,060	107,400.00	328,644,000.00	
LG ELECTRONICS INC	11,019	69,200.00	762,514,800.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	5,058	89,000.00	450,162,000.00	
KANGWON LAND INC	13,208	28,600.00	377,748,800.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	23,100.00	117,117,000.00	

KAKAO CORP	5,017	168,500.00	845,364,500.00	
NAVER CORP	13,779	191,000.00	2,631,789,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,650	631,000.00	1,041,150,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	95,200.00	234,668,000.00	
PEARL ABYSS CORP	338	194,700.00	65,808,600.00	
CJ ENM CO LTD	830	156,500.00	129,895,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	108,500.00	331,033,500.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	88,400.00	108,024,800.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	136,500.00	141,141,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	881	320,500.00	282,360,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	171,000.00	93,879,000.00	
EMART	2,723	121,000.00	329,483,000.00	
GS RETAIL CO LTD	4,060	39,350.00	159,761,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	250,500.00	194,137,500.00	
KT&G CORP	11,869	94,000.00	1,115,686,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	116,500.00	232,184,500.00	
OTTOGI CORPORATION	68	544,000.00	36,992,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,873	236,500.00	679,464,500.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	105,500.00	74,905,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,406,000.00	1,301,956,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	855,000.00	115,425,000.00	
PACIFIC CORP	3,393	91,200.00	309,441,600.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,381	54,900.00	350,316,900.00	
CELLTRION INC	9,074	175,000.00	1,587,950,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	490	294,500.00	144,305,000.00	
HELIXMITH CO LTD	1,641	85,600.00	140,469,600.00	
MEDY-TOX INC	335	346,700.00	116,144,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	437,000.00	683,031,000.00	
YUHAN CORPORATION	661	229,500.00	151,699,500.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	7,250.00	168,316,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	29,127	35,150.00	1,023,814,050.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,250.00	318,712,500.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	40,491	47,900.00	1,939,518,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,550	41,050.00	1,869,827,500.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	47,720	10,650.00	508,218,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	73,700.00	339,167,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,595.00	172,214,880.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,700.00	239,408,400.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	12,150.00	137,270,700.00	
SAMSUNG CARD CO	1,899	38,600.00	73,301,400.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	38,150.00	220,354,400.00	
DB INSURANCE CO LTD	4,209	47,500.00	199,927,500.00	

	HANWHA LIFE INSURANCE	44,037	2,225.00	97,982,325.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	24,150.00	219,789,150.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	27,050.00	107,523,750.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	227,000.00	705,516,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	73,700.00	546,632,900.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	199,500.00	622,639,500.00	
	KMW CO LTD	1,901	55,400.00	105,315,400.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	15,850.00	381,525,350.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	148,500.00	210,127,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	134,500.00	753,603,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	471,313	61,300.00	28,891,486,900.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	82,047	50,900.00	4,176,192,300.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,221	269,500.00	1,407,059,500.00	
	LG UPLUS CORP	14,194	13,500.00	191,619,000.00	
	SK TELECOM	2,172	235,000.00	510,420,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	26,850.00	656,938,950.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	35,050.00	159,056,900.00	
	SK HYNIX INC	54,068	99,000.00	5,352,732,000.00	
韓国ウォン 小計		1,540,713		86,642,770,500.00 (8,231,063,197)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	137,240	96.40	13,229,936.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	48.85	11,439,497.60	
	CHINA STEEL	1,120,261	24.05	26,942,277.05	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	354,061	88.00	31,157,368.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	452,824	99.00	44,829,576.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	508,752	73.00	37,138,896.00	
	TAIWAN CEMENT	469,479	44.90	21,079,607.10	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	507.00	6,084,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	29.50	10,266,826.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,237	315.00	6,689,655.00	
	CHINA AIRLINES LTD	437,203	8.99	3,930,454.97	
	EVA AIRWAYS CORP	164,159	13.60	2,232,562.40	
	EVERGREEN MARINE	359,039	13.00	4,667,507.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	39.00	6,903,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	42.10	7,454,268.10	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	405.50	8,084,453.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	36,207	189.50	6,861,226.50	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	34.30	1,372,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	194.00	4,940,016.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	284.50	4,552,000.00	
	POU CHEN	273,780	38.80	10,622,664.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	71.60	1,582,932.80	

TATUNG CO LTD	210,000	21.80	4,578,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	687.00	20,610,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	310.00	18,458,640.00	
STANDARD FOODS CORP	35,756	70.80	2,531,524.80	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	484,395	75.70	36,668,701.50	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	420,468	22.40	9,418,483.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,871,237	22.60	42,289,956.20	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	978,573	29.00	28,378,617.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,004,094	24.35	24,449,688.90	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	757,945	22.30	16,902,173.50	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,075,339	32.10	34,518,381.90	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	13.35	15,444,468.15	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	964,768	14.65	14,133,851.20	
TAIWAN BUSINESS BANK	476,620	12.65	6,029,243.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	903,621	21.25	19,201,946.25	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	52.80	17,469,460.80	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	132,022	142.50	18,813,135.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	945,153	20.50	19,375,636.50	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	823,123	43.10	35,476,601.30	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.85	12,379,283.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	307,791	25.95	7,987,176.45	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	649,082	47.15	30,604,216.30	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,166,470	10.25	11,956,317.50	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	46.85	1,973,322.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	44.95	1,503,128.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	173.50	8,328,000.00	
ACER INC	255,803	18.25	4,668,404.75	
ADVANTECH CO LTD	28,402	316.00	8,975,032.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	235.50	14,858,166.00	
AU OPTRONICS CORP	945,090	10.45	9,876,190.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	248.00	17,285,600.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	88.80	2,556,729.60	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	9.26	7,176,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	19.00	8,203,440.00	
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	152.00	28,409,256.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	66.00	6,128,100.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,231,248	92.30	113,644,190.40	
INVENTEC CO LTD	280,511	23.00	6,451,753.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,040	4,985.00	50,049,400.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	50.00	11,272,600.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	94.10	5,646,000.00	
PEGATRON CORP	200,474	67.90	13,612,184.60	

	QUANTA COMPUTER INC	242,270	65.00	15,747,550.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	38.55	4,938,255.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	229.50	6,196,500.00	
	WISTRON CORP	242,695	29.30	7,110,963.50	
	WIWYNN CORP	8,000	707.00	5,656,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	39.05	5,611,172.60	
	YAGEO CORPORATION	22,764	413.00	9,401,532.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	136.50	8,179,353.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	372,315	109.50	40,768,492.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	70.90	11,131,300.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	109.00	16,589,800.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	349,315	79.30	27,700,679.50	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	422.00	7,596,000.00	
	MEDIATEK INC	147,804	420.50	62,151,582.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	83.60	8,610,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	228.50	12,120,782.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	350.00	4,059,650.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	99,770	110.50	11,024,585.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	262.00	13,347,328.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,430,389	333.00	809,319,537.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	16.00	19,360,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	79.60	7,084,400.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	285.50	9,136,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	19.05	6,648,450.00	
新台湾ドル 小計		32,955,048		2,169,844,935.92 (7,985,029,364)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	453.90	30,011,868.00	
	COAL INDIA LTD	147,331	207.90	30,630,114.90	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	249.65	14,835,451.25	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	122.65	23,765,277.25	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	125.40	31,689,708.60	
	PETRONET LNG LTD	49,423	272.65	13,475,180.95	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	281,474	1,581.00	445,010,394.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	210.40	15,471,343.20	
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,830.05	45,678,048.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	16,698	563.25	9,405,148.50	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	768.25	21,005,491.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	210.05	25,491,037.85	
	JSW STEEL LTD	80,284	273.35	21,945,631.40	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,447.85	11,739,167.80	
	SHREE CEMENT LTD	901	23,325.90	21,016,635.90	
	TATA STEEL LTD	39,709	495.25	19,665,882.25	

ULTRATECH CEMENT LTD	9,271	4,486.75	41,596,659.25	
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	589.25	31,939,707.00	
VEDANTA LTD	198,772	159.50	31,704,134.00	
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	84.00	12,062,652.00	
HAVELLS INDIA LTD	23,476	638.70	14,994,121.20	
LARSEN & TOUBRO LTD	44,586	1,304.20	58,149,061.20	
SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,588.00	9,410,488.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	387.60	24,235,077.60	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	554.40	14,666,652.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,472.95	12,313,862.00	
BAJAJ AUTO LTD	8,362	3,118.10	26,073,552.20	
BHARAT FORGE LTD	30,322	522.45	15,841,728.90	
BOSCH LTD	965	15,387.15	14,848,599.75	
EICHER MOTORS LTD	1,254	21,292.20	26,700,418.80	
HERO MOTOCORP LTD	10,359	2,454.00	25,420,986.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	569.30	43,078,361.70	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,533	7,520.15	79,209,739.95	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	139.85	10,745,654.45	
TATA MOTORS LTD	147,050	197.30	29,012,965.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	601	25,854.85	15,538,764.85	
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	1,188.75	33,069,836.25	
INFO EDGE INDIA LTD	6,428	2,600.45	16,715,692.60	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	281.70	22,387,544.10	
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,990.55	21,947,804.30	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	3,124.45	15,959,690.60	
ITC LTD	347,144	239.95	83,297,202.80	
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	15,439.45	36,977,482.75	
UNITED SPIRITS LTD	32,483	581.85	18,900,233.55	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	5,255	1,509.95	7,934,787.25	
DABUR INDIA LTD	58,111	489.65	28,454,051.15	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	743.70	28,605,676.80	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	63,593	2,060.30	131,020,657.90	
MARICO LTD	42,465	349.70	14,850,010.50	
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	485.95	9,882,279.20	
CIPLA LTD	31,308	480.30	15,037,232.40	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	1,903.35	17,240,544.30	
DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	3,034.35	31,630,064.40	
LUPIN LTD	26,552	766.65	20,356,090.80	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,589	1,627.40	12,350,338.60	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	454.60	37,709,070.00	
AXIS BANK LTD	209,166	739.90	154,761,923.40	
BANDHAN BANK LTD	36,073	481.00	17,351,113.00	

	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	161,699	2,453.95	396,801,261.05	
	ICICI BANK LTD	467,580	532.05	248,775,939.00	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	466.65	13,052,667.15	
	STATE BANK OF INDIA	167,428	318.00	53,242,104.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	16,731	4,231.75	70,801,409.25	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	3,263.25	13,363,008.75	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	360.05	10,055,836.45	
	REC LTD	48,168	141.00	6,791,688.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	19,022	1,087.75	20,691,180.50	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	9,715.00	37,771,920.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	49,372	607.65	30,000,895.80	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	17,954	1,412.50	25,360,025.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	481.50	15,278,958.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	32,481	996.35	32,362,444.35	
	DLF LTD	56,420	261.25	14,739,725.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	105,458	598.80	63,148,250.40	
	INFOSYS LTD	335,829	767.85	257,866,297.65	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	89,479	2,219.10	198,562,848.90	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	778.45	37,408,414.75	
	WIPRO LTD	118,712	251.10	29,808,583.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	199,402	500.05	99,710,970.10	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	218.25	7,814,223.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	126.35	22,081,936.80	
	NTPC LTD	260,019	121.20	31,514,302.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	197.40	39,749,451.00	
	TATA POWER CO LTD	93,250	61.55	5,739,537.50	
インドルピー 小計		6,330,101		3,877,312,772.25 (6,048,607,924)	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	150.25	10,968,250.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	170.83	11,360,195.00	
	MCB BANK LTD	53,300	222.28	11,847,524.00	
パキスタンルピー 小計		192,800		34,175,969.00 (24,606,697)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	57,358	23.00	1,319,234.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.39	1,060,980.75	
	INDUSTRIES QATAR	159,480	10.50	1,674,540.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.97	1,013,830.30	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.09	1,662,748.60	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	16.54	1,889,364.20	
	QATAR NATIONAL BANK	432,557	21.00	9,083,697.00	
	QATAR INSURANCE CO	189,640	3.25	616,330.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.63	753,188.70	

	OOREDOO QSC	72,800	6.99	508,872.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	16.60	1,036,188.60	
カタールリアル 小計		2,350,431		20,618,974.15 (621,249,691)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	141.00	2,768,958.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,219	1,360.00	7,097,840.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,437	298.83	11,486,128.71	
	GOLD FIELDS LTD	83,566	89.39	7,469,964.74	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	77,953	154.61	12,052,313.33	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	432.00	2,320,704.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	141.23	4,794,758.50	
	SASOL LTD	57,207	273.06	15,620,943.42	
	SIBANYE GOLD LTD	218,901	39.20	8,580,919.20	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	224.70	6,224,639.40	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	113.15	4,585,856.35	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	188.73	5,380,692.30	
	NASPERS LTD-N SHS	43,282	2,510.51	108,659,893.82	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	83,044	17.67	1,467,387.48	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	155.50	3,736,976.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	49.42	5,460,662.90	
	BID CORP LTD	33,071	335.59	11,098,296.89	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	264.38	7,117,373.98	
	PICK N PAY STORES LTD	45,989	66.87	3,075,284.43	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,792	115.52	5,174,371.84	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	199.58	4,645,024.92	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	211.01	2,747,983.23	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	25.20	3,944,883.60	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	121.21	4,514,345.24	
	ABSA GROUP LTD	70,978	139.50	9,901,431.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,385	1,449.72	6,357,022.20	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	207.54	7,894,198.98	
	STANDARD BANK GROUP LTD	126,090	164.43	20,732,978.70	
	FIRSTRAND LTD	334,349	60.02	20,067,626.98	
	INVESTEC LTD	28,883	84.91	2,452,455.53	
	PSG GROUP LTD	18,494	234.95	4,345,165.30	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,647	299.18	3,484,549.46	
	REMGRO LTD	55,441	190.13	10,540,997.33	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	77.75	5,784,444.50	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	127.32	4,455,690.72	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	18,158	112.13	2,036,056.54	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	21.95	1,494,312.10	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	19.75	9,669,837.00	

	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	29.61	2,998,545.48	
	SANLAM LTD	189,452	77.55	14,692,002.60	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	32,121	127.40	4,092,215.40	
	MTN GROUP LTD	173,000	84.00	14,532,000.00	
	TELKOM SA LTD	11,353	36.65	416,087.45	
	VODACOM GROUP	58,903	121.92	7,181,453.76	
南アフリカランド 小計		3,218,337		403,155,273.31 (3,076,074,735)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	8.08	2,177,479.20	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.78	743,238.64	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	259,815	15.58	4,047,917.70	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	509,421	2.25	1,146,197.25	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.88	337,728.84	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.23	1,628,719.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	168,271	16.52	2,779,836.92	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		1,900,268		12,861,117.75 (385,447,698)	
香港・オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	6.91	628,119.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	8.69	332,827.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	7.09	622,502.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	10.09	617,508.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	3.47	570,121.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	52.13	1,534,707.20	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.72	221,364.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	22,500	28.13	632,925.00	
	BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	98,100	6.85	671,985.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	10.70	571,380.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	17.51	649,621.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.30	599,300.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	7.76	317,384.00	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	61,700	10.18	628,106.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.80	616,280.00	
	SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	69,000	8.87	612,030.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	32,780	34.28	1,123,698.40	
	SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	23,600	24.41	576,076.00	
	TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	38,900	16.26	632,514.00	
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	43,200	15.40	665,280.00	
	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	7.39	681,358.00	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	47,500	53.92	2,561,200.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	14.30	337,480.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.64	293,760.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	22.24	253,536.00	

AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	16.64	282,880.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	25,000	26.75	668,750.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	6.56	633,696.00	
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	75,820	9.73	737,728.60	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	63,200	9.89	625,048.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	494,300	5.25	2,595,075.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.80	1,223,220.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	115.08	1,542,072.00	
CRRC CORP LTD-A	79,000	6.94	548,260.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	12,900	54.88	707,952.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	37.91	515,576.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	12,200	49.34	601,948.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	18.40	894,240.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.27	696,864.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	16.88	707,272.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	30.80	628,320.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	9.51	214,926.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	14.71	635,472.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.43	249,979.73	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	27.54	870,264.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	36,300	19.40	704,220.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	15.38	681,334.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	8.67	698,802.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	37,300	16.35	609,855.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	50.26	552,860.00	
AIR CHINA LTD-A	25,900	9.20	238,280.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.55	222,000.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	2.49	932,754.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	7.93	969,839.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.00	189,900.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	17.65	547,150.00	
S F HOLDING CO LTD-A	13,700	37.18	509,366.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	73.26	389,669.94	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.54	245,976.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	43.01	356,983.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	16,800	30.43	511,224.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	104,734	7.12	745,706.08	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	25.64	956,372.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	52,300	11.59	606,157.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	28.61	981,323.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	22.69	664,817.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	24.74	1,053,924.00	

GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	67.91	1,256,335.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	60.31	1,242,386.00	
NAVINFO CO LTD-A	33,200	17.78	590,296.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	5,500	121.00	665,500.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	19.45	505,700.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	30,100	20.98	631,498.00	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	89.85	1,329,780.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.59	601,887.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	18,600	31.40	584,040.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	12.38	663,568.00	
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	16.42	279,140.00	
CITIC GUOAN INFORMATION-A	174,400	3.62	631,328.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.55	913,070.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	1,800	367.00	660,600.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	40.00	652,000.00	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	52,800	11.19	590,832.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	11.35	934,786.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	15,200	44.97	683,544.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	28.83	706,335.00	
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	22,800	27.53	627,684.00	
HLA CORP LTD-A	21,400	7.84	167,776.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	16.69	283,730.00	
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	10.53	482,274.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	8.07	326,835.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	4,800	147.30	707,040.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	54.45	560,835.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	11,800	109.86	1,296,348.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	36.70	623,900.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	32,400	30.55	989,820.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	32.88	1,127,849.76	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	34.60	598,580.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	115.50	1,051,050.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	41.78	480,470.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,000	1,107.50	7,752,500.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	91.80	899,640.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	14,100	88.82	1,252,362.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	19.55	523,940.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	96.69	647,823.00	
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	50,891	11.05	562,345.55	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	13.99	442,084.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	63,900	35.40	2,262,060.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	138.55	2,937,260.00	

AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,780	42.99	592,402.20	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	110.18	550,900.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	22.21	215,881.20	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	6,500	80.01	520,065.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	57,300	14.57	834,861.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	35.44	524,512.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	14.46	359,186.40	
OVCTEK CHINA INC-A	9,300	53.48	497,364.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	2,800	193.05	540,540.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	4,700	106.60	501,020.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,800	149.98	569,924.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	19,500	29.05	566,475.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	7,400	73.80	546,120.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	1,100	493.00	542,300.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	39.47	603,891.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	31.18	318,036.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	59.00	584,100.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	36.95	820,031.35	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	35.10	561,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	73.40	587,200.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	14,500	34.08	494,160.00	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	26,926	24.15	650,262.90	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	26,460	90.66	2,398,863.60	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	12,600	50.70	638,820.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	95.80	651,440.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	19.36	135,520.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	25.02	281,024.64	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	12.78	249,210.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	29.69	504,730.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	6,300	96.93	610,659.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	87.16	618,836.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	123.38	481,182.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	36,900	17.89	660,141.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	24.77	599,434.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.62	1,280,032.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.62	325,960.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	5.61	554,829.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	7.10	410,380.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	8.61	434,805.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	28.15	675,600.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	9.13	415,415.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.08	884,292.00	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	4.18	538,802.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	37.93	3,978,857.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	6.29	1,720,944.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	7.58	905,052.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.82	1,520,184.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	19.25	1,832,600.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	16.39	1,956,966.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	12.23	1,691,409.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	4.19	133,661.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	4.75	581,875.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	7.26	1,339,470.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	56,200	18.94	1,064,428.00	
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	25.36	1,095,552.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	31.24	752,884.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	128,800	15.75	2,028,600.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	13.13	1,336,634.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	8.54	707,112.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	15.18	919,908.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	110.69	597,726.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	7.24	314,216.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	7.11	624,969.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	10.61	336,337.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.03	1,042,216.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	37.73	686,686.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	59,100	86.25	5,097,375.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	27.44	384,160.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	18.87	1,032,189.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	30.46	1,635,702.00	
GEMDALE CORP-A	45,500	14.04	638,820.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.12	1,318,616.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	37.50	480,000.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	24.77	666,313.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	41.13	555,255.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	21.37	615,456.00	
GLODON CO LTD-A	15,400	40.29	620,466.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	7,000	87.40	611,800.00	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	35.96	388,368.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	15,500	37.65	583,575.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	57,200	32.69	1,869,868.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	38.62	517,508.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.83	553,518.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	23.16	648,480.00	

	CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	15.96	555,408.00	
	DAWNING INFORMATION INDUST-A	17,600	43.40	763,840.00	
	FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	27.40	569,920.00	
	GOERTEK INC -A	26,900	21.99	591,531.00	
	GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	12.60	630,000.00	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	58,500	35.67	2,086,695.00	
	INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	17,600	33.50	589,600.00	
	LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	38,500	17.65	679,525.00	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	64,932	41.90	2,720,650.80	
	SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	23.00	558,900.00	
	SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	3,400	168.50	572,900.00	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	45.17	605,278.00	
	YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,500	81.86	613,950.00	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	20.78	629,634.00	
	CHINA UNITED NETWORK-A	600,000	5.97	3,582,000.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.99	867,262.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	17.74	2,377,160.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.97	1,184,251.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	8.74	590,824.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.73	859,500.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	5.64	465,300.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	3,200	253.01	809,632.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	28.88	470,744.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	21.04	854,224.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	276.80	719,680.00	
香港・オフショア人民元 小計		12,431,740		182,290,919.35 (2,925,769,255)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	21.54	507,460.86	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	94,278	34.35	3,238,449.30	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	51.50	504,906.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	13.62	434,859.36	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	18.22	588,196.26	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	14,573	80.00	1,165,840.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	46.10	2,073,762.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,481	92.20	6,774,948.20	
	SAUDI CEMENT	7,489	68.30	511,498.70	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	25.55	538,057.45	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	10.82	715,353.48	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,804	55.70	1,103,082.80	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	102.80	455,609.60	
	JARIR MARKETING CO	5,046	168.00	847,728.00	
	ALMARAI CO	22,935	49.00	1,123,815.00	

	SAVOLA	25,336	35.80	907,028.80	
	AL RAJHI BANK	120,466	66.20	7,974,849.20	
	ALINMA BANK	82,467	25.60	2,111,155.20	
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	27.90	1,608,100.20	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	15.36	550,087.68	
	BANK ALBILAD	32,374	27.70	896,759.80	
	BANQUE SAUDI FRANSI	57,797	38.50	2,225,184.50	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	119,460	47.20	5,638,512.00	
	RIYAD BANK	120,952	25.45	3,078,228.40	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	31.70	3,223,351.10	
	SAUDI BRITISH BANK	71,793	34.70	2,491,217.10	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,609	103.80	167,014.20	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	79.00	522,427.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	10.02	471,861.84	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	10.08	465,564.96	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	27.00	929,178.00	
	SAUDI TELECOM CO	39,344	98.40	3,871,449.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	20.42	1,883,152.82	
サウジアラビアリアル 小計		1,565,028		59,598,689.81 (1,753,393,454)	
合　計		266,311,037		69,368,831,475 (69,368,831,475)	

(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	6,773,232.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	6,773,232.00 (40,029,801)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,953,514.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,900	1,844,178.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	901,230.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,341,096.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	26,962	1,752,530.00	
	ブラジルレアル 小計		173,362	7,792,548.00 (206,346,671)	
投資信託受益証券合計			231,762	246,376,472 (246,376,472)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	10,106,268.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	10,106,268.00 (59,728,043)	

	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	189,245	3,554,021.10	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	6,508,736.82	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	4,148,246.45	
	南アフリカランド 小計		1,032,277	14,211,004.37 (108,429,963)	
投資証券合計			1,340,677	168,158,006 (168,158,006)	
合計				414,534,478 (414,534,478)	

(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　56銘柄	100.0%	—	—	14.3%
メキシコペソ	株式　23銘柄	94.0%	—	—	2.2%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.4%	—	0.1%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.6%	0.1%
ブラジルレアル	株式　50銘柄	95.9%	—	—	6.9%
	投資信託受益証券　5銘柄	—	4.1%	—	0.3%
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%	—	—	0.4%
ユーロ	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.3%
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%	—	—	0.5%
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%	—	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.9%
香港ドル	株式　210銘柄	100.0%	—	—	21.1%
マレーシアリンギット	株式　40銘柄	100.0%	—	—	1.8%
タイバーツ	株式　41銘柄	100.0%	—	—	2.5%
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%	—	—	1.9%
韓国ウォン	株式　110銘柄	100.0%	—	—	11.8%

新台湾ドル	株式　88銘柄	100.0%	—	—	11.4%
インドルピー	株式　84銘柄	100.0%	—	—	8.7%
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　11銘柄	100.0%	—	—	0.9%
南アフリカランド	株式　44銘柄	96.6%	—	—	4.4%
	投資証券　3銘柄	—	—	3.4%	0.2%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.6%
香港・オフショア人民元	株式　218銘柄	100.0%	—	—	4.2%
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。

2【ファンドの現況】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

【純資産額計算書】

（2020年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	19,143,535,470円
Ⅱ　負債総額	36,869,832円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,106,665,638円
Ⅳ　発行済口数	15,008,600,231口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2730円
（1万口当たり純資産額）	（12,730円）

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	579,750,700,898円
Ⅱ　負債総額	14,174,439,886円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	565,576,261,012円
Ⅳ　発行済口数	393,306,442,963口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4380円
（1万口当たり純資産額）	（14,380円）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	289,298,909,660円
Ⅱ　負債総額	700,802,056円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	288,598,107,604円
Ⅳ　発行済口数	204,862,878,114口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4087円
（1万口当たり純資産額）	（14,087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 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	414,925,860,686円
Ⅱ　負債総額	338,978,031円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	414,586,882,655円
Ⅳ　発行済口数	142,262,529,302口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9142円
（1万口当たり純資産額）	（29,142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 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	376,499,875,267円
Ⅱ　負債総額	1,484,362,378円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	375,015,512,889円
Ⅳ　発行済口数	141,118,327,922口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6575円
（1万口当たり純資産額）	（26,575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 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	58,987,980,745円
Ⅱ　負債総額	10,530,304円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	58,977,450,441円
Ⅳ　発行済口数	33,816,518,639口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7440円
（1万口当たり純資産額）	（17,440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 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	68,493,697,694円
Ⅱ　負債総額	2,172,531,095円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	66,321,166,599円
Ⅳ　発行済口数	23,685,800,114口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8000円
（1万口当たり純資産額）	（28,000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 2月28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 4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2月28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	542	12,905,410
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	84	345,778
単位型公社債投資信託	21	173,541
合計	647	13,424,729

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関す

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

(2) 委託者の財務諸表及び中間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、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(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、第33期事業年度（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
　また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日　至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 （2018年3月31日現在）		当事業年度 （2019年3月31日現在）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		23,973,152		23,830,484
有価証券		―		2,268,127
前払費用		157,614		197,843
未収委託者報酬		5,373,307		6,351,590
未収運用受託報酬		―		5,525,778
未収収益		896		212,722
その他		8,946		2,261,900
流動資産合計		29,513,917		40,648,447
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	36,782	※1	282,407
器具備品	※1	79,655	※1	564,981
その他	※1	1,912	※1	14,462
有形固定資産合計		118,350		861,851
無形固定資産				
ソフトウェア		210,679		1,487,265
その他		4,377		7,256
無形固定資産合計		215,056		1,494,522
投資その他の資産				
投資有価証券		42,802		11,334,053
関係会社株式		―		4,663,000
長期貸付金		17,088		―
繰延税金資産		248,633		141,789
その他		32,880		32,492
貸倒引当金		△17,088		―
投資その他の資産合計		324,317		16,171,335
固定資産合計		657,724		18,527,709
資産合計		30,171,641		59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日現在）	当事業年度 （2019年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	－	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	－	5,464,685
その他営業収益	－	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	－	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	－	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240

営業利益	5,516,262	8,554,888

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	―	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	―	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	△50,178	△125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2017年4月1日　至　2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
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	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
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	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	－	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	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	△1,134	－	△1,134	21,847,309
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				△30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	－	1,317	3,744,907
当期末残高	182	－	182	25,592,216

当事業年度（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から資本金への振替	1,700,000	△1,700,000	△1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	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	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
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					18,589,438
剰余金の配当	500		△30,500	△30,000	△30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	－	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	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	182	－	182	25,592,216
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				18,589,438
剰余金の配当				△30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

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．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。

４．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。

５．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。

６．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。

７．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。
この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号　平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2018年3月31日）		当事業年度 （2019年3月31日）	
建　　物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	〃	351,328	〃
そ の 他	2,677	〃	3,595	〃
計	392,342	〃	408,445	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017年6月30日

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

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度（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(千円)	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	30,000	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

2019年6月27日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28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、当該投資信託を有価証券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有価証券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。

有価証券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6.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（2018年3月31日）　（単位:千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	23,973,152	23,973,152	―
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	―
(3) 未収運用受託報酬	―	―	―
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	―
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	―
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	―
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	―	―	―
ヘッジ会計が適用されているもの	―	―	―
デリバティブ取引計	―	―	―

(*) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

	貸借対照表計上額 (*1)	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	23,830,484	23,830,484	－
（2）未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	－
（3）未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	－
（4）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,602,178	13,602,178	－
（5）未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	－
（6）未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	－
（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	(850)	(850)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	－
デリバティブ取引計	81,231	81,231	－

（*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、（2）未収委託者報酬、及び（3）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。

（4）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。

（5）未払金、及び（6）未払法人税等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（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:千円）

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)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（2018年3月31日）　（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	－	－	－
未収委託者報酬	5,373,307	－	－	－
未収運用受託報酬	－	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	－	12,846	21,065	496

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830,484	－	－	－
未収委託者報酬	6,351,590	－	－	－
未収運用受託報酬	5,525,778	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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:千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

２．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）　（単位:千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	23,576	25,037	△1,461
小計	23,576	25,037	△1,461
合計	42,799	42,536	262

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	9,196,375	9,602,961	△406,585
小計	9,196,375	9,602,961	△406,585

合計	13,602,178	13,035,220	566,957

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

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）　（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538,203	46,789	34,437

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	－	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	－	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	－	42	42
	スイスフラン	7,802	－	△6	△6
	香港ドル	183,640	－	645	645
	ユーロ	183,228	－	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	－	90	90
	スイスフラン	1,110	－	5	5
	香港ドル	560	－	4	4
	ユーロ	2,492	－	△0	△0
合計		1,346,753	－	7,916	7,916

（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（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739,103	－	△8,766	△8,766
合計		6,739,103	－	△8,766	△8,766

（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（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		3,432,867	－	13,731
	英ポンド		2,575,513	－	50,256
	カナダドル	有価証券	40,963	－	566
	スイスフラン	投資有価証券	34,448	－	△132
	香港ドル	子会社株式	566,113	－	2,528
	人民元		1,725,146	－	9,137
	ユーロ		262,583	－	6,080
	買建				
	ユーロ		6,313	－	△86
合計			8,643,951	－	82,081

（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．退職給付債務に関する事項　（単位：千円）

	前事業年度（2018年3月31日）	当事業年度（2019年3月31日）
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。
2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項　（単位：千円）

	前事業年度（2018年3月31日）	当事業年度（2019年3月31日）
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。
2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度（2018年3月31日）		当事業年度（2019年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	〃	－	
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	〃	40,467	〃

退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	〃	164,674	〃
その他	23,674	〃	82,358	〃
繰延税金資産 合計	255,547	〃	413,091	〃
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	△6,833	〃	―	
有価証券評価差額	―		△173,602	〃
繰延ヘッジ損益	―		△58,719	〃
その他	△80	〃	△38,979	〃
繰延税金負債 合計	△6,913	〃	△271,302	〃
繰延税金資産の純額	248,633	〃	141,789	〃

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。

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

①対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

②企業結合日

2018年10月1日

③企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

④結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 （当社）

⑤その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

(2)実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（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 2017年4月1日　至 2018年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

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

当事業年度（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	4,679,437千円

［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 2017年4月1日　至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）

兄弟会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用	4,809,206	その他未払金	424,421

（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 投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
② 投資助言費用
各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	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	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							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)	 18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 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。

（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（2018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（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）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第34期中間会計期間末 （2019年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826
固定資産		
有形固定資産	※1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780
資産合計		62,606
負債の部		
流動負債		
未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	※2	655
流動負債合計		9,216
固定負債		
退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計	9,935

（単位：百万円）

	第34期中間会計期間末 （2019年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

（単位：百万円）

		第34期中間会計期間 （自　2019年4月1日 至　2019年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	※1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	※2	1,110
営業外費用	※3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		△18
法人税等合計		2,179

中間純利益	4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日　至 2019年9月30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
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	―	―	―
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	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
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		△2,536	△2,305	△2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	230	―	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	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
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△513	152	△360	△360
当中間期変動額合計	△513	152	△360	2,229
当中間期末残高	△120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自　2019年4月1日
至　2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

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

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、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

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．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）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。

（2）連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第34期中間会計期間末 （2019年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額　470百万円 ※2　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第34期中間会計期間 （自　2019年4月1日 至　2019年9月30日）
※1　減価償却実施額 有形固定資産　62百万円 無形固定資産　42百万円 ※2　営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益　481百万円 投資有価証券償還益　309百万円 為替差益　181百万円 ※3　営業外費用の主要項目 デリバティブ費用　456百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日　至 2019年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（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

（金融商品関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

2019年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	－
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	－
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	－
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	－
(7)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)負債に計上されているものについては、(　　)で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法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)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) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円)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ため、「（5）投資有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

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

２．その他有価証券

（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	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	3,767	4,101	△334
小計	3,767	4,101	△334
合計	10,344	10,517	△173

（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。

（デリバティブ取引関係）

第34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	872	－	1	1
	英ポンド	52	－	0	0
	カナダドル	2	－	0	0
	スイスフラン	6	－	0	0
	香港ドル	195	－	0	0
	ユーロ	155	－	2	2
合計		1,285	－	5	5

（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	6,493	－	△57	△57
合計		6,493	－	△57	△57

（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。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド カナダドル スイスフラン 香港ドル ユーロ	有価証券 投資有価証券 子会社株式	 2,500 2,259 22 53 96 113	 － － － － － －	 5 41 0 0 0 1
合計			5,046	－	48

（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。

（セグメント情報等）
（セグメント情報）
第34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）
当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）
第34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）
１．製品及びサービスごとの情報
単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報
(1)営業収益
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省

略しております。

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第34期中間会計期間 （自　2019年4月1日 至　2019年9月30日）
1株当たり純資産額　17,557,176円40銭 1株当たり中間純利益　1,631,928円83銭 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 4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。

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

2019年６月５日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤　澤　　孝	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹　内　知　明	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年４月１日から2019年３月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

（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3月１９日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の２０１９年1月２２日から２０２０年1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。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の２０２０年１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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤　澤　　孝	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹　内　知　明	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年４月１日から2020年３月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

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