

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年8月11日提出
【計算期間】	第6期(自 2019年11月12日至 2020年5月11日)
【ファンド名】	SMT 8資産インデックスバランス・オープン
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グロ ー バ ル  (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド  ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり ( )  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ・ シ ョ ー ト型/ 絶 対 収 益 追 求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	日本  北米  欧州  アジア  オセアニ ア  中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

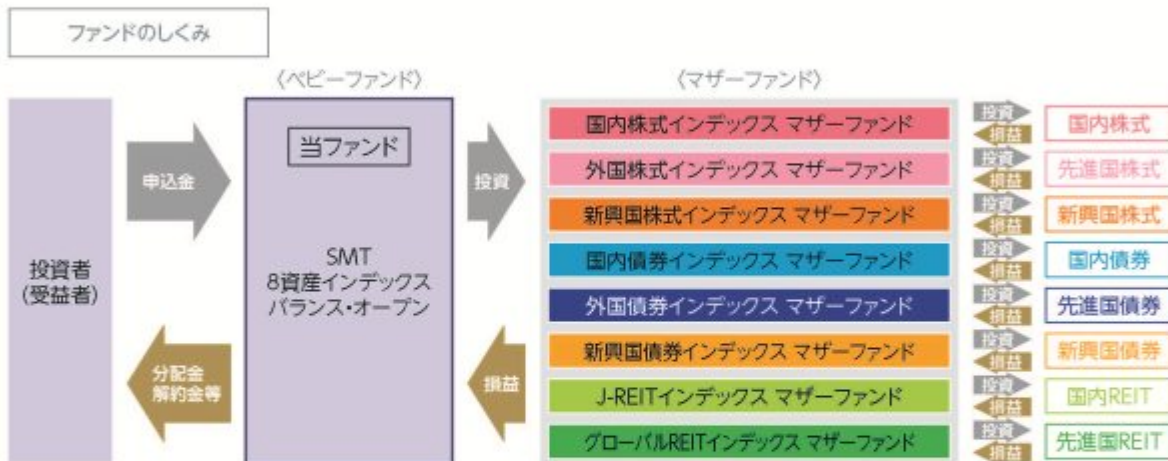
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

#### < ファンドの特色 >

## 特色1

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

- 国内、先進国及び新興国の株式及び債券、並びに国内及び先進国のREITに分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
- 各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)への連動を目指す運用を行います。
- 原則として、為替ヘッジは行いません。



### ? ファミリーファンド方式とは

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

### ? DR(預託証券)とは

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

### ? REITとは

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

## ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

**特色2** 8つのマザーファンド受益証券への均等配分を基本配分比率とします。

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

マザーファンド	インデックス
1 国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX(東証株価指数)
2 外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
3 新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)
4 国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI 総合
5 外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
6 新興国債券インデックス マザーファンド	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・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)
7 J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
8 グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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。



「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。

「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。

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

「NOMURA-BPI総合」とは、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。

「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及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。

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

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

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

## 分配方針

- 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配を行わないことがあります。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。  
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 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。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

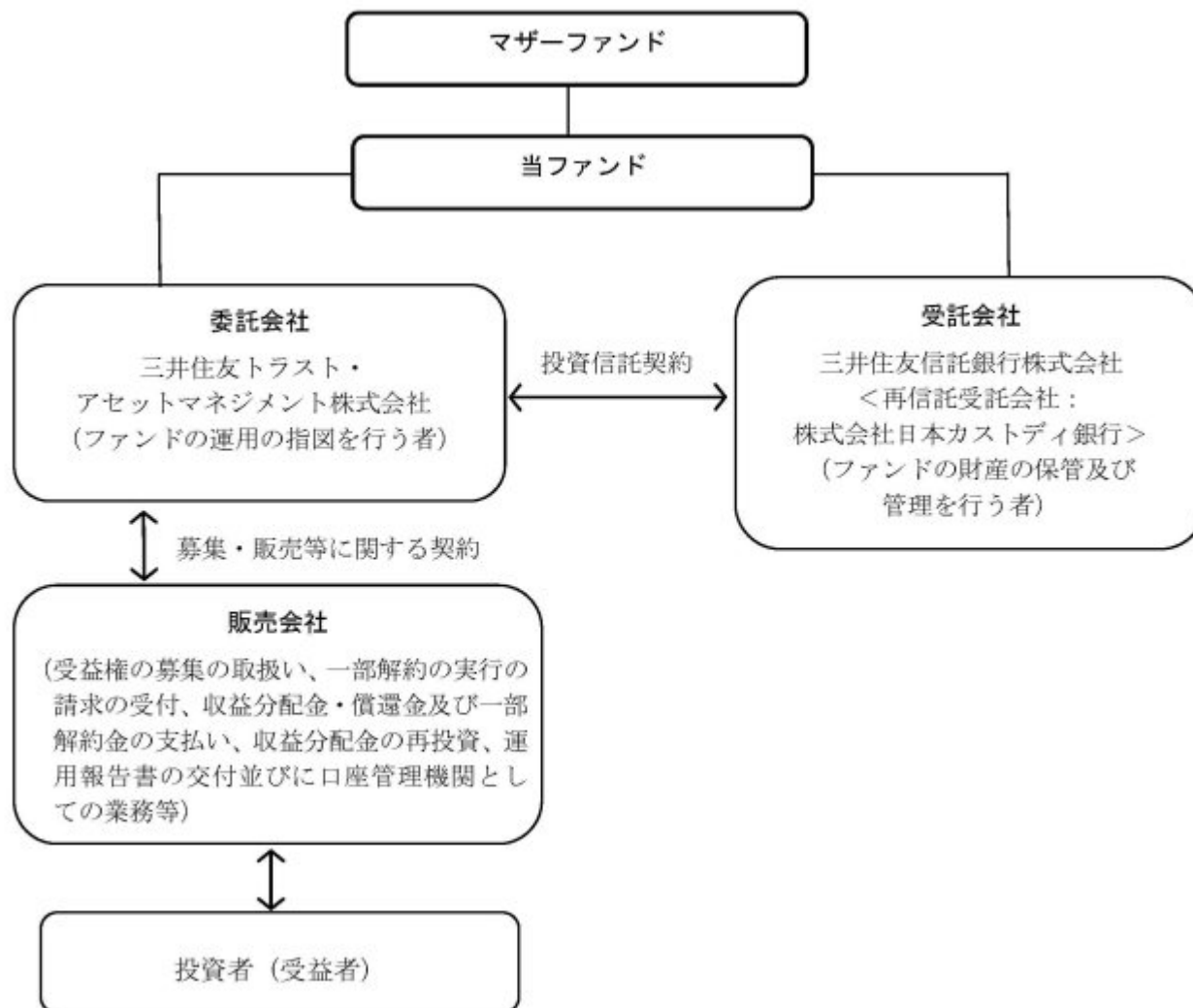
## (2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2020年 5月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 投資対象

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

### 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株式（DR（預託証券）を含みます。）及び債券、並びに国内及び先進国の不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．各マザーファンド受益証券の基本配分比率は、8分の1ずつの均等配分とします。また、各マザーファンド受益証券の配分比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ハ．各マザーファンドは、インデック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。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	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・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）
J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

- ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ホ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  1. 有価証券
  2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
  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

## 有価証券の指図範囲

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

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の

性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

###### 1．基本方針

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

###### 2．運用方法

###### (1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

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。

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。

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

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

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

###### 3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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。

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。

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。

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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。

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。

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。

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

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

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

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。

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

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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。

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。

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。

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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。

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。

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。

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



社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### 3. 運用制限

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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

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。

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

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

NOMURA-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。

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

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

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

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

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

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。

外貨建資産への投資は、行いません。

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。

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

FTSE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。

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

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

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

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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

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

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。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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。

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・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

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・マーケット・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。

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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

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

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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。

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

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

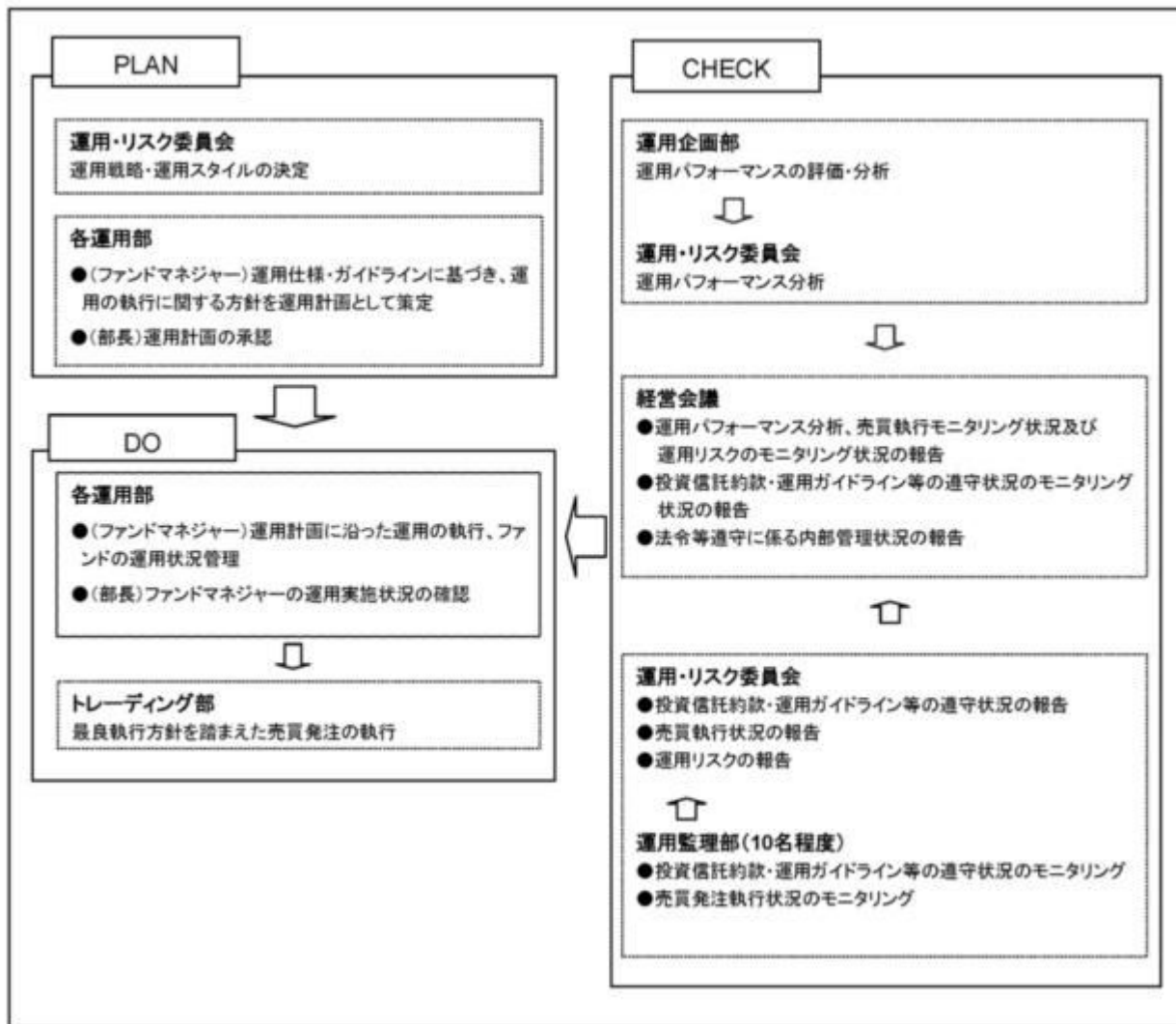
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

## (3)【運用体制】

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

ることがあります。



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%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は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第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。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

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

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の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、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとし

す。（以下同じ。）

- (ロ) 委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

#### チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲



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

#### ル. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

#### ヲ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### カ. 資金の借入れ

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

#### ヨ. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）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は帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### リートの価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 信用リスク

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

### 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。

### 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>

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

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

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

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

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

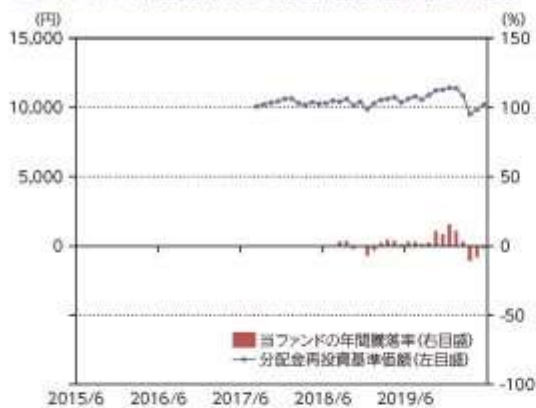
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

## 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

\*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドについては2018年8月～2020年5月の1年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2015年6月～2020年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式を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、ファンドの設立又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Market インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Market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 NOMJRA-BPI国債	NOMJRA-BPI国債とは、野村證券株式会社公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動向を表す振動収益指数で、一定の購入額に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動(サービス)に関し一切の責任を負いません。
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、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの資産、販売あるいは懸念保護を行っていません。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、またデータの錯誤、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権はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 DEA Latin America Bond Index - Emerging Market (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす算出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】

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

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

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

2: 収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」(税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコー

ス）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。上記及びの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （２）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

## （３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

## （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

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

## 5【運用状況】

以下は、2020年5月29日現在の状況について記載してあります。

### 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## （１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	42,119,773	98.85
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		490,445	1.15
合計（純資産総額）		42,610,218	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	2,234,272	2.4679	5,514,050	2.5857	5,777,157	13.56
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	3,605,535	1.4927	5,381,983	1.5555	5,608,409	13.16
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	3,775,748	1.3978	5,277,804	1.4762	5,573,759	13.08
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	2,162,797	2.4310	5,257,808	2.4822	5,368,494	12.60
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	3,235,461	1.5481	5,008,920	1.6317	5,279,301	12.39
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	3,011,533	1.6806	5,061,356	1.7106	5,151,528	12.09
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	1,681,478	2.8561	4,802,500	2.9017	4,879,144	11.45
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	3,170,615	1.4143	4,484,234	1.4136	4,481,981	10.52

(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	98.85
合計	98.85

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】



該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末	(2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
第3期計算期間末	(2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
第4期計算期間末	(2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
第5期計算期間末	(2019年11月11日)	32,350,523	32,350,523	11,176	11,176
第6期計算期間末	(2020年 5月11日)	38,971,244	38,971,244	9,884	9,884
	2019年 5月末日	24,376,194		10,373	
	6月末日	26,755,421		10,618	
	7月末日	28,136,818		10,783	
	8月末日	29,535,689		10,562	
	9月末日	30,794,306		10,883	
	10月末日	33,637,756		11,221	
	11月末日	34,153,920		11,275	
	12月末日	34,344,114		11,419	
	2020年 1月末日	35,966,329		11,393	
	2月末日	37,426,487		10,865	
	3月末日	34,935,405		9,497	
	4月末日	38,641,057		9,852	
	5月末日	42,610,218		10,196	

#### 【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	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	0

#### 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.7
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	11.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	10,577,572	4,052,049	28,946,438
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	15,251,653	4,770,851	39,427,240

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

#### ( 参考 )

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

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

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

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

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,544,900	6,649.46	10,272,750,754	6,755.00	10,435,799,500	3.33
日本	株式	ソニー	電気機器	867,400	5,513.11	4,782,071,614	6,874.00	5,962,507,600	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	125,500	31,705.75	3,979,071,625	44,350.00	5,565,925,000	1.78
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,078,100	5,085.89	5,483,098,009	4,832.00	5,209,379,200	1.66
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,152,000	3,802.62	4,380,618,240	4,191.00	4,828,032,000	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,816,300	2,470.05	4,486,351,815	2,444.00	4,439,037,200	1.42
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,341,800	503.35	4,702,195,030	444.20	4,149,627,560	1.32
日本	株式	第一三共	医薬品	396,200	5,656.36	2,241,049,832	10,085.00	3,995,677,000	1.27
日本	株式	任天堂	その他製品	84,900	38,898.05	3,302,444,445	43,540.00	3,696,546,000	1.18
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	947,900	3,564.59	3,378,874,861	3,710.00	3,516,709,000	1.12
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,012,600	2,818.55	2,854,063,730	3,136.00	3,175,513,600	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,090,200	2,730.70	2,977,009,140	2,784.00	3,035,116,800	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	944,500	3,725.75	3,518,970,875	3,119.00	2,945,895,500	0.94
日本	株式	信越化学工業	化学	232,800	9,592.86	2,233,217,808	12,620.00	2,937,936,000	0.94

日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	971,600	2,630.93	2,556,211,588	2,951.50	2,867,677,400	0.91
日本	株式	花王	化学	331,500	8,540.00	2,831,010,000	8,647.00	2,866,480,500	0.91
日本	株式	ダイキン工業	機械	176,400	13,758.70	2,427,034,680	15,850.00	2,795,940,000	0.89
日本	株式	HOYA	精密機器	276,500	8,114.00	2,243,521,000	10,110.00	2,795,415,000	0.89
日本	株式	ファナック	電気機器	131,600	18,268.61	2,404,149,076	19,215.00	2,528,694,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,556,600	153.19	2,842,685,554	134.50	2,495,862,700	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	406,800	4,775.03	1,942,482,204	6,015.00	2,446,902,000	0.78
日本	株式	三菱商事	卸売業	957,000	2,793.39	2,673,274,230	2,515.00	2,406,855,000	0.77
日本	株式	S M C	機械	43,400	38,414.11	1,667,172,374	54,370.00	2,359,658,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	665,300	3,777.13	2,512,924,589	3,455.00	2,298,611,500	0.73
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,200,500	1,550.34	1,861,183,170	1,914.50	2,298,357,250	0.73
日本	株式	中外製薬	医薬品	144,400	7,700.00	1,111,880,000	15,890.00	2,294,516,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	482,800	5,517.56	2,663,877,968	4,668.00	2,253,710,400	0.72
日本	株式	日本電産	電気機器	333,300	6,814.38	2,271,232,854	6,622.00	2,207,112,600	0.70
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	953,800	2,042.17	1,947,821,746	2,310.00	2,203,278,000	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	140,700	13,590.79	1,912,224,153	15,615.00	2,197,030,500	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.21
		建設業	2.54
		食料品	3.87
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.02
		医薬品	6.93
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.77

鉄鋼	0.56
非鉄金属	0.67
金属製品	0.53
機械	4.96
電気機器	14.10
輸送用機器	7.07
精密機器	2.54
その他製品	2.31
電気・ガス業	1.55
陸運業	4.21
海運業	0.13
空運業	0.36
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.26
卸売業	4.51
小売業	4.79
銀行業	4.93
証券、商品先物取引業	0.75
保険業	2.00
その他金融業	1.11
不動産業	2.04
サービス業	5.22
小計	97.00
合計	97.00

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	349円		5,090,025,750	5,440,910,000	1.74

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	254,505,201,751	63.67
	イギリス	18,507,271,674	4.63
	スイス	14,386,421,318	3.60
	カナダ	13,094,934,735	3.28
	フランス	12,896,893,882	3.23
	ドイツ	11,364,426,752	2.84
	オーストラリア	7,628,043,418	1.91
	オランダ	6,940,539,900	1.74
	アイルランド	6,906,875,288	1.73
	スウェーデン	3,450,794,636	0.86
	スペイン	3,231,493,576	0.81
	香港	3,059,266,855	0.77
	デンマーク	2,960,638,571	0.74
	イタリア	2,252,059,469	0.56
	フィンランド	1,607,581,240	0.40
	シンガポール	1,354,256,213	0.34
	バミューダ	1,226,063,235	0.31
	ベルギー	1,112,714,780	0.28
	ジャージー	858,084,757	0.21
	イスラエル	841,269,775	0.21
	ケイマン	740,025,368	0.19
	ノルウェー	728,511,672	0.18
	ニュージーランド	396,371,714	0.10
	ルクセンブルク	298,353,686	0.07
	キュラソー	267,229,835	0.07
	オーストリア	230,538,439	0.06
	ポルトガル	228,087,020	0.06
	リベリア	85,007,272	0.02
	パナマ	79,011,665	0.02
	マン島	63,970,577	0.02
パプアニューギニア	29,069,333	0.01	
英ヴァージン諸島	20,325,793	0.01	
	小計	371,351,334,199	92.90

投資信託受益証券	オーストラリア	184,952,012	0.05
	香港	82,262,137	0.02
	小計	267,214,149	0.07
投資証券	アメリカ	8,151,318,634	2.04
	オーストラリア	525,807,975	0.13
	フランス	235,307,663	0.06
	イギリス	208,690,938	0.05
	シンガポール	175,055,387	0.04
	香港	157,327,410	0.04
	カナダ	80,798,481	0.02
	小計	9,534,306,488	2.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,572,211,962	4.65
合計(純資産総額)		399,725,066,798	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,662,722,080	2.92
	買建	カナダ	617,886,006	0.15
	買建	ドイツ	2,716,486,651	0.68
	買建	イギリス	1,022,834,732	0.26
	買建	オーストラリア	584,955,840	0.15

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

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

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

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	424,286	19,900.10	8,443,337,009	34,221.42	14,519,670,467	3.63
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	692,070	13,879.74	9,605,756,436	19,505.94	13,499,477,280	3.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	40,314	198,001.10	7,982,216,684	258,190.28	10,408,683,069	2.60
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	229,762	19,631.15	4,510,494,367	24,243.71	5,570,284,170	1.39
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	29,486	122,379.94	3,608,495,025	152,340.97	4,491,926,045	1.12
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,573	123,043.11	3,515,710,882	152,503.34	4,357,478,140	1.09
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	251,260	14,630.78	3,676,130,836	15,803.68	3,970,833,667	0.99
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	163,330	17,668.86	2,885,855,384	20,888.77	3,411,764,078	0.85
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	283,950	11,073.88	3,144,428,344	11,468.71	3,256,542,135	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	300,112	11,545.68	3,465,000,097	10,737.94	3,222,586,390	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	237,820	11,352.52	2,699,857,555	12,479.93	2,967,977,381	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	90,353	25,929.66	2,342,822,933	32,685.89	2,953,268,590	0.74
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	85,613	27,409.48	2,346,608,269	32,506.31	2,782,963,489	0.70
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	104,694	20,681.69	2,165,249,788	26,359.90	2,759,723,810	0.69
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	414,846	4,802.91	1,992,471,510	6,634.60	2,752,337,686	0.69
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,131	30,377.45	2,039,268,911	38,056.19	2,554,750,762	0.64
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	125,861	21,370.08	2,689,659,691	19,903.80	2,505,112,549	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	394,419	6,272.31	2,473,920,076	5,991.57	2,363,189,679	0.59
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	696,675	3,439.23	2,396,027,524	3,339.88	2,326,812,153	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	821,173	2,948.16	2,420,956,621	2,673.19	2,195,156,215	0.55
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	527,795	4,378.79	2,311,104,952	4,105.49	2,166,859,945	0.54
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	171,900	13,993.07	2,405,409,563	12,554.12	2,158,054,517	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	242,811	8,588.73	2,085,439,997	8,499.17	2,063,692,258	0.52



アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	55,452	16,495.50	914,708,736	36,504.28	2,024,235,579	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	404,599	5,675.51	2,296,305,694	4,902.83	1,983,680,256	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	388,189	5,269.35	2,045,506,135	5,063.58	1,965,629,046	0.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	403,535	7,514.25	3,032,265,196	4,843.15	1,954,381,019	0.49
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	205,324	9,770.67	2,006,154,145	9,298.53	1,909,212,934	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	132,991	13,709.97	1,823,303,328	14,225.14	1,891,816,086	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	46,170	30,165.36	1,392,734,791	40,843.11	1,885,726,846	0.47

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

		半導体・半導体製造装置	3.54
		小計	92.90
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.39
合計			95.35

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
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	714	アメリカドル	97,490,640.5	10,483,168,573	108,460,170	11,662,722,080	2.92
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	43	カナダドル	7,225,405.5	563,653,883	7,920,600	617,886,006	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	58	スイスフラン	5,461,276	609,041,499	5,762,880	642,676,377	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	563	ユーロ	15,649,303.5	1,864,301,525	17,407,960	2,073,810,274	0.52
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	56	オーストラリアドル	7,251,842	517,418,927	8,198,400	584,955,840	0.15
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	124	イギリスポンド	7,064,690	936,283,365	7,717,760	1,022,834,732	0.26

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,640,000.00	284,882,400	283,852,800	0.07
	ユーロ	買建	370,000.00	44,027,410	44,078,100	0.01
	イギリスポンド	買建	480,000.00	63,534,240	63,609,600	0.02
	アメリカドル	売建	17,000,000.00	1,827,840,000	1,827,840,000	0.46

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

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

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	ケイマン	13,065,941,272	20.83
	中国	7,957,051,901	12.68
	台湾	7,407,938,749	11.81
	韓国	7,199,274,094	11.48
	インド	4,847,009,893	7.73
	ブラジル	2,944,920,105	4.69
	南アフリカ	2,304,508,055	3.67
	ロシア	2,162,420,312	3.45
	サウジアラビア	1,692,188,631	2.70
	香港	1,682,204,883	2.68
	タイ	1,445,629,711	2.30
	メキシコ	1,117,000,082	1.78
	マレーシア	1,110,596,005	1.77
	インドネシア	937,368,520	1.49
	カタール	565,103,755	0.90
	バミューダ	514,096,452	0.82
	フィリピン	482,935,309	0.77
	ポーランド	462,417,176	0.74
	チリ	371,131,702	0.59
	アラブ首長国連邦	357,288,602	0.57
	トルコ	272,476,193	0.43
	アメリカ	226,645,124	0.36
	ハンガリー	154,148,616	0.25
	ギリシャ	136,540,123	0.22
	コロンビア	129,585,737	0.21
	ルクセンブルク	77,681,997	0.12
	エジプト	71,954,033	0.11
	チェコ	71,518,943	0.11
	ジャージー	58,333,013	0.09
	アルゼンチン	42,706,270	0.07
	シンガポール	20,803,266	0.03
	マン島	17,794,032	0.03
	パキスタン	14,987,850	0.02
ペルー	14,654,887	0.02	
スペイン	5,640,885	0.01	
	小計	59,942,496,178	95.55

投資信託受益証券	ブラジル	118,362,835	0.19
	メキシコ	26,595,103	0.04
	小計	144,957,938	0.23
投資証券	南アフリカ	43,266,711	0.07
	メキシコ	26,016,994	0.04
	小計	69,283,705	0.11
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,579,684,186	4.11
合計（純資産総額）		62,736,422,007	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,633,615,082	4.20

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		178,374,000	0.28

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 （％）
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	185,886	20,516.23	3,813,680,774	21,451.15	3,987,470,272	6.36
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	612,600	4,639.60	2,842,221,902	5,661.73	3,468,378,248	5.53
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	2,632,389	1,093.96	2,879,739,389	1,052.51	2,770,642,070	4.42

韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	510,272	4,544.77	2,319,072,040	4,379.76	2,234,868,895	3.56
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,216,620	89.68	916,326,263	85.71	875,733,930	1.40
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	47,573	13,541.59	644,214,071	17,987.63	855,725,579	1.36
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	306,633	2,028.80	622,098,836	2,105.31	645,559,821	1.03
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	605,500	1,294.30	783,704,230	1,061.05	642,468,803	1.02
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	654,500	890.88	583,081,906	750.36	491,115,202	0.78
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,988,515	80.68	563,864,404	69.76	487,561,436	0.78
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	78,907	3,645.11	287,624,884	5,486.18	432,898,053	0.69
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	58,170	7,223.49	420,190,707	7,290.91	424,112,235	0.68
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	177,443	3,147.82	558,559,811	2,321.89	412,003,305	0.66
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	46,044	10,066.34	463,494,905	8,226.04	378,760,016	0.60
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	365,523	1,012.17	369,972,921	1,011.58	369,756,487	0.59
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	289,100	1,587.15	458,847,829	1,255.95	363,095,261	0.58
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,333,248	320.56	427,394,269	269.57	359,408,996	0.57
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	592,047	864.06	511,568,778	593.13	351,164,081	0.56
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,635,200	45.68	394,499,475	39.52	341,345,138	0.54
ブラジル	株式	VALE SA	素材	340,278	970.07	330,094,446	995.28	338,674,712	0.54
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	29,357	13,343.60	391,728,305	11,432.58	335,626,533	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	87,965	3,738.93	328,895,572	3,780.15	332,520,895	0.53
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	14,853	14,357.10	213,246,063	20,899.45	310,419,531	0.49
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	7,551	32,475.95	245,225,947	39,382.86	297,379,995	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	96,664	3,014.17	291,362,019	2,866.14	277,053,427	0.44
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	160,804	1,461.26	234,976,851	1,646.79	264,812,027	0.42
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,625,440	73.47	266,374,047	72.98	264,610,714	0.42
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	487,496	567.90	276,853,673	519.79	253,396,521	0.40
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	87,189	3,118.66	271,913,625	2,874.22	250,601,109	0.40
ロシア	株式	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	素材	73,003	3,107.82	226,880,408	3,419.45	249,630,400	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.21
		素材	6.88
		資本財	2.86
		商業・専門サービス	0.32
		運輸	1.54
		自動車・自動車部品	1.81
		耐久消費財・アパレル	1.17
		消費者サービス	1.41
		メディア・娯楽	8.44
		小売	10.43
		食品・生活必需品小売り	1.52
		食品・飲料・タバコ	3.62
		家庭用品・パーソナル用品	1.20
		ヘルスケア機器・サービス	1.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.53
		銀行	14.24
		各種金融	1.96
		保険	3.27
		不動産	2.45
		ソフトウェア・サービス	1.84
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.74
電気通信サービス	4.15		
公益事業	2.32		
半導体・半導体製造装置	6.47		
	小計	95.55	
投資信託受益証券			0.23
投資証券			0.11
合計			95.89

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	534	アメリカドル	23,864,798	2,566,181,729	24,491,910	2,633,615,082	4.20

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	950,000.00	102,514,500	102,144,000	0.16
	香港ドル	買建	5,500,000.00	76,285,000	76,230,000	0.12

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	454,188,617,800	84.08
地方債証券	日本	28,860,716,530	5.34
特殊債券	日本	37,009,791,304	6.85
社債券	日本	20,057,528,090	3.71
	フランス	1,887,916,000	0.35
	オーストラリア	398,256,000	0.07
	アメリカ	204,640,000	0.04
	イギリス	99,821,000	0.02
	小計	22,648,161,090	4.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,547,983,581	0.47
合計(純資産総額)		540,159,303,143	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,420,000,000	101.37	9,549,054,000	100.91	9,505,816,200	0.100	2023/12/20	1.76
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	101.97	7,444,538,800	100.99	7,372,854,000	0.100	2024/6/20	1.36

日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	102.47	7,111,793,200	101.42	7,039,172,600	0.100	2026/9/20	1.30
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	101.57	7,008,870,600	100.86	6,959,547,000	0.100	2023/9/20	1.29
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	102.83	6,498,856,000	0.400	2025/9/20	1.20
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	6,380,000,000	102.30	6,527,242,000	101.31	6,463,833,200	0.100	2026/3/20	1.20
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	6,050,000,000	101.33	6,131,015,300	101.07	6,115,098,000	0.100	2024/12/20	1.13
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	6,050,000,000	101.27	6,127,353,300	100.67	6,091,079,500	0.100	2022/12/20	1.13
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	6,020,000,000	101.36	6,101,914,500	101.03	6,082,547,800	0.100	2024/9/20	1.13
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	102.64	5,943,420,000	101.53	5,878,702,800	0.100	2028/3/20	1.09
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,230,000,000	103.97	5,437,631,000	102.72	5,372,308,300	0.400	2025/6/20	0.99
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,200,000,000	102.04	5,306,291,800	101.47	5,276,596,000	0.100	2027/3/20	0.98
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	4,990,000,000	100.81	5,030,419,000	100.46	5,013,403,100	0.100	2022/3/20	0.93
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	4,940,000,000	103.04	5,090,176,000	101.22	5,000,515,000	0.100	2029/6/20	0.93
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	4,840,000,000	102.98	4,984,232,000	101.50	4,912,987,200	0.100	2027/9/20	0.91
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	100.89	4,812,641,300	100.54	4,795,996,500	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	101.81	4,652,899,800	1.000	2021/12/20	0.86
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,470,000,000	102.03	4,560,741,000	101.37	4,531,462,500	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	4,380,000,000	101.50	4,445,702,600	100.95	4,421,829,000	0.100	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	100.98	4,422,924,000	100.61	4,406,805,600	0.100	2022/9/20	0.82
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	4,190,000,000	102.48	4,294,243,000	101.46	4,251,257,800	0.100	2028/9/20	0.79
日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	3,630,000,000	118.35	4,296,170,400	116.85	4,241,655,000	1.400	2034/9/20	0.79
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	4,140,000,000	101.20	4,189,680,000	100.82	4,174,279,200	0.100	2023/6/20	0.77
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	101.13	4,126,104,000	100.75	4,110,967,200	0.100	2023/3/20	0.76
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	3,780,000,000	102.09	3,859,367,000	101.28	3,828,421,800	0.100	2029/3/20	0.71
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	3,680,000,000	101.17	3,723,095,000	100.98	3,716,064,000	0.100	2030/3/20	0.69
日本	国債証券	第403回利付国債(2年)	3,690,000,000	100.80	3,719,520,000	100.30	3,701,402,100	0.100	2021/8/1	0.69
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	3,590,000,000	102.46	3,678,361,000	101.49	3,643,814,100	0.100	2028/6/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	3,040,000,000	120.47	3,662,515,000	118.09	3,589,966,400	1.500	2034/6/20	0.66
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	102.92	3,499,313,600	102.15	3,473,134,000	0.600	2023/3/20	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率



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

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	123,793,130,163	44.83
	フランス	26,723,420,939	9.68
	イタリア	24,157,538,281	8.75
	ドイツ	19,733,645,443	7.15
	イギリス	17,809,166,953	6.45
	スペイン	15,914,219,064	5.76
	ベルギー	6,716,910,728	2.43
	オーストラリア	5,550,816,381	2.01
	カナダ	5,259,580,632	1.90
	オランダ	5,146,805,020	1.86
	オーストリア	4,070,753,564	1.47
	メキシコ	2,156,705,226	0.78
	アイルランド	2,036,942,207	0.74
	ポーランド	1,650,199,823	0.60
	フィンランド	1,536,409,804	0.56
	デンマーク	1,368,613,306	0.50
	マレーシア	1,336,319,048	0.48
	シンガポール	1,225,821,018	0.44
	イスラエル	1,039,070,414	0.38
	スウェーデン	778,291,358	0.28
ノルウェー	679,335,982	0.25	

	小計	268,683,695,354	97.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,485,354,323	2.71
合計(純資産総額)		276,169,049,677	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	2,570,598,758	0.93
	買建	ドイツ	3,130,786,434	1.13

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		5,894,295,300	2.13

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	15,010,000	11,226.13	1,685,042,413	12,376.87	1,857,768,347	2.375	2029/5/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	10,541.89	1,544,387,769	11,692.20	1,712,908,375	1.625	2029/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,903.37	1,362,921,754	11,690.52	1,461,315,898	2.375	2024/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	10,790,000	9,912.11	1,069,517,252	12,640.65	1,363,926,739	2.250	2046/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	12,150,000	10,599.68	1,287,861,820	11,130.61	1,352,369,739	1.625	2022/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.75% 09/15/21	12,000,000	10,957.62	1,314,915,550	11,110.45	1,333,254,392	2.750	2021/9/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	10,050,000	10,333.63	1,038,530,116	13,221.98	1,328,809,960	2.500	2046/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	9,300,000	11,123.97	1,034,530,001	14,055.34	1,307,147,286	2.875	2045/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	10,200,000	10,774.52	1,099,001,978	12,797.75	1,305,370,516	2.250	2049/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	10,988.49	1,181,262,751	12,119.80	1,302,879,270	2.375	2027/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	11,321.83	1,131,051,187	12,574.28	1,256,171,509	2.625	2029/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	10,902.53	1,199,278,730	11,087.56	1,219,631,721	2.750	2021/8/15	0.44

アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	10,616.06	1,084,962,079	11,785.03	1,204,430,674	2.000	2026/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,834.48	1,099,700,493	11,675.82	1,185,096,317	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/48	7,300,000	12,227.23	892,588,249	15,655.69	1,142,865,803	3.375	2048/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.125% 09/30/21	10,300,000	10,762.66	1,108,554,075	11,032.32	1,136,329,572	2.125	2021/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	11,305.70	1,008,468,815	12,717.10	1,134,365,557	2.875	2028/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	8,500,000	10,341.16	878,998,609	13,206.02	1,122,512,391	2.500	2046/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,954.08	1,095,408,110	11,222.60	1,122,260,373	2.000	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,804.61	1,080,461,440	11,065.92	1,106,592,907	1.500	2022/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/15/21	10,000,000	10,931.11	1,093,111,022	11,026.86	1,102,686,547	2.625	2021/6/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,541.72	1,054,172,032	10,916.18	1,091,618,516	1.250	2021/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	11,541.19	969,460,372	12,980.88	1,090,394,524	3.125	2028/11/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	12,932.49	1,097,969,066	12,720.28	1,079,952,149	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	10,795.84	966,228,041	11,993.79	1,073,444,691	2.250	2027/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,542.98	1,033,212,086	10,862.63	1,064,537,756	1.125	2021/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,654.71	1,017,524,891	11,090.71	1,059,162,938	1.750	2022/5/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,663.53	1,018,367,277	11,062.77	1,056,495,372	1.750	2022/3/31	0.38
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000	20,582.39	994,129,832	21,479.61	1,037,465,430	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	10,780.72	921,751,785	12,061.84	1,031,287,467	2.250	2027/8/15	0.37

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.29
合計	97.29

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	72	アメリカドル	9,028,796.1	970,866,444	9,028,687.68	970,854,786	0.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	46	アメリカドル	6,379,512.28	685,988,956	6,378,187.5	685,846,502	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	48	アメリカドル	8,512,723.25	915,373,131	8,499,000	913,897,470	0.33
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	36	ユーロ	4,035,919	480,799,030	4,032,720	480,417,933	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	45	ユーロ	6,079,500	724,250,835	6,075,000	723,714,750	0.26

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	94	ユーロ	16,184,546	1,928,064,965	16,172,700	1,926,653,751	0.70
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	------------	---------------	------------	---------------	------

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	25,840,000.00	2,772,547,151	2,777,800,000	1.01
	カナダドル	買建	3,290,000.00	252,780,172	256,554,200	0.09
	ユーロ	買建	20,470,000.00	2,400,971,147	2,438,591,100	0.88
	イギリスポンド	買建	3,180,000.00	418,933,676	421,350,000	0.15

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

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

合計(純資産総額)	57,235,746,015	100.00
-----------	----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		8,851,745	0.02
	売建		8,761,133	0.02

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	89,700,000,000	3.65	3,275,264,776	3.61	3,243,208,269	9.850	2027/6/28	5.67
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	47,100,000	2,229.15	1,049,932,437	2,253.75	1,061,519,132	10.000	2023/1/1	1.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	48,550,000	1,617.28	785,193,668	1,715.41	832,835,164	0.000	2023/7/1	1.46
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000	2,298.49	810,220,810	2,305.24	812,598,601	10.000	2025/1/1	1.42
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	108,700,000	682.97	742,397,801	704.43	765,718,627	10.500	2026/12/21	1.34
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	144,200,000	411.68	593,648,328	423.08	610,090,632	3.400	2036/6/17	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	106,000,000	546.58	579,375,497	561.69	595,400,876	8.500	2029/5/31	1.04
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	112,900,000	506.45	571,784,510	526.14	594,014,183	8.000	2023/12/7	1.04
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000	0.78	572,614,324	0.78	567,226,051	8.375	2024/3/15	0.99
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,743.83	546,023,065	2,832.23	563,613,891	2.500	2023/1/25	0.98
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000	2,367.64	567,050,964	2,325.78	557,025,952	10.000	2027/1/1	0.97
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	1,784.89	509,588,905	1,888.75	539,240,055	0.000	2022/1/1	0.94
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	487.19	527,149,891	496.79	537,531,692	6.500	2022/6/9	0.94
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000	1,734.71	477,914,120	1,837.66	506,277,646	0.000	2022/7/1	0.88
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	16,250,000	2,897.28	470,808,842	3,002.67	487,934,599	4.000	2023/10/25	0.85
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000	502.99	463,511,736	528.51	487,027,402	7.500	2027/6/3	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000	2,747.91	449,284,189	2,959.94	483,951,261	2.500	2027/7/25	0.85

ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000	2,749.16	452,237,973	2,941.30	483,844,240	2.500	2026/7/25	0.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	24,650,000	1,847.87	455,500,645	1,930.50	475,868,508	0.000	2021/7/1	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	111,800,000	415.42	464,441,745	424.27	474,338,891	3.300	2038/6/17	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	405.90	463,948,500	414.05	473,268,808	3.650	2031/6/20	0.83
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	552.20	454,188,843	572.59	470,960,375	10.000	2024/12/5	0.82
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	79,050,000	570.10	450,670,374	579.44	458,050,071	8.000	2030/1/31	0.80
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	538.64	481,007,949	504.72	450,720,104	8.750	2048/2/28	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000	433.11	439,176,785	440.17	446,338,170	4.875	2029/6/22	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000	2,753.10	411,588,733	2,882.79	430,977,165	2.500	2024/4/25	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000	490.02	403,777,099	498.95	411,139,415	7.250	2021/12/9	0.72
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000	0.80	407,648,776	0.79	400,079,483	8.375	2026/9/15	0.70
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	13,050,000	2,850.50	371,991,072	3,064.54	399,922,606	2.750	2029/10/25	0.70
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000	2,855.69	378,380,177	3,015.22	399,517,205	3.250	2025/7/25	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	92.28
合計	92.28

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	82,326.50	8,819,154	8,851,745	0.02
	ロシアルーブル	売建	5,802,075.00	8,819,154	8,761,133	0.02

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

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

#### J - REITインデックス マザーファンド

## 投資状況

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,956,526,000	3.44

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	12,245	779,271.73	9,542,182,418	676,000	8,277,620,000	7.19
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,644	699,701.62	8,847,027,394	588,000	7,434,672,000	6.46
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,027	291,066.65	5,538,125,265	304,000	5,784,208,000	5.02
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	40,820	184,307.78	7,523,443,919	132,500	5,408,650,000	4.70
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	18,041	291,715.07	5,262,831,728	266,400	4,806,122,400	4.17
日本	投資証券	G L P 投資法人	31,493	132,716.1	4,179,628,174	143,700	4,525,544,100	3.93
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,993	340,823.59	4,087,497,376	335,500	4,023,651,500	3.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	25,194	220,893.75	5,565,197,207	155,800	3,925,225,200	3.41
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	23,898	224,141.67	5,356,537,783	142,200	3,398,295,600	2.95
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	28,391	197,177.51	5,598,066,881	114,200	3,242,252,200	2.82
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	16,284	162,918.84	2,652,970,461	176,700	2,877,382,800	2.50
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,202	661,584.39	2,779,977,636	653,000	2,743,906,000	2.38
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,310	470,172.9	3,907,136,874	329,000	2,733,990,000	2.37
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	36,971	90,496.04	3,345,729,133	67,100	2,480,754,100	2.15
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,262	269,303.71	2,224,987,262	286,500	2,367,063,000	2.06
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,912	778,879.17	3,046,975,337	598,000	2,339,376,000	2.03

日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,336	525,352.18	3,328,631,460	366,500	2,322,144,000	2.02
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	14,548	167,261.27	2,433,317,083	145,500	2,116,734,000	1.84
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,756	158,251.23	1,860,401,527	160,700	1,889,189,200	1.64
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,918	799,908.75	2,334,133,752	629,000	1,835,422,000	1.59
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,733	78,631.51	3,202,897,378	44,850	1,826,875,050	1.59
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,505	339,189.96	1,867,240,775	326,000	1,794,630,000	1.56
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,598	452,157.87	1,626,864,036	469,000	1,687,462,000	1.47
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,491	449,893.87	2,020,473,384	350,000	1,571,850,000	1.37
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	11,696	172,775.97	2,020,787,824	133,300	1,559,076,800	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,646	139,754.27	1,907,086,799	114,000	1,555,644,000	1.35
日本	投資証券	日本リート投資法人	4,107	445,899.19	1,831,307,997	378,500	1,554,499,500	1.35
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	15,479	97,221.35	1,504,889,330	98,900	1,530,873,100	1.33
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	55,464	57,742.66	3,202,639,350	27,280	1,513,057,920	1.31
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,249	202,798.08	1,672,881,408	181,300	1,495,543,700	1.30

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.54
合計	96.54

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,326	円	4,100,792,260	3,956,526,000	3.44

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

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

#### グローバルREITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------



投資証券	アメリカ	67,200,033,744	75.27
	オーストラリア	5,767,734,422	6.46
	イギリス	4,476,989,414	5.01
	シンガポール	3,763,828,361	4.22
	フランス	2,050,302,989	2.30
	カナダ	1,658,049,269	1.86
	香港	1,509,656,987	1.69
	ベルギー	1,082,644,053	1.21
	スペイン	479,133,540	0.54
	ニュージーランド	388,125,795	0.43
	ドイツ	252,422,234	0.28
	ガーンジー	210,730,785	0.24
	オランダ	160,282,655	0.18
	アイルランド	122,530,682	0.14
	イスラエル	61,022,259	0.07
	マン島	14,733,095	0.02
	イタリア	13,082,559	0.01
	韓国	11,630,863	0.01
	小計	89,222,933,706	99.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		57,972,868	0.06
合計(純資産総額)		89,280,906,574	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		424,796,000	0.48

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	581,052	9,226.93	5,361,329,495	10,005.66	5,813,812,531	6.51

アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	69,410	59,887.53	4,156,793,752	74,555.92	5,174,926,789	5.80
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	206,375	13,288.54	2,742,424,450	15,704.75	3,241,069,123	3.63
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	118,010	22,365.24	2,639,322,764	21,633.96	2,553,023,702	2.86
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	109,481	21,332.55	2,335,509,941	17,100.49	1,872,179,392	2.10
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	275,480	8,507.26	2,343,582,610	6,545.35	1,803,113,321	2.02
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	320,234	8,108.74	2,596,694,293	5,520.59	1,767,880,682	1.98
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	268,881	7,591.48	2,041,206,118	5,989.42	1,610,441,508	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	96,180	16,354.78	1,573,003,480	16,682.20	1,604,494,400	1.80
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	240,798	14,482.49	3,487,354,631	6,424.91	1,547,107,284	1.73
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	51,875	31,842.04	1,651,805,885	26,759.91	1,388,170,632	1.55
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,258,689	996.56	1,254,370,166	1,099.50	1,383,932,961	1.55
香港	投資証券	LINK REIT	1,656,600	1,124.26	1,862,462,052	790.59	1,309,691,394	1.47
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	420,980	3,046.87	1,282,673,685	2,817.28	1,186,021,060	1.33
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	293,024	5,776.09	1,692,535,390	3,952.80	1,158,266,088	1.30
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	89,224	13,790.68	1,230,460,226	12,651.97	1,128,860,246	1.26
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	72,523	15,891.62	1,152,508,492	14,896.13	1,080,312,101	1.21
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	287,667	3,666.30	1,054,675,324	3,745.26	1,077,390,556	1.21
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	113,400	13,865.28	1,572,322,940	9,436.83	1,070,136,840	1.20
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	387,474	3,412.19	1,322,135,685	2,751.69	1,066,209,377	1.19
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	101,400	11,149.19	1,130,528,146	10,454.06	1,060,042,353	1.19
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	868,400	1,099.80	955,071,891	1,123.85	975,955,161	1.09
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	142,581	6,994.10	997,226,519	6,720.62	958,233,433	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	230,610	4,835.79	1,115,181,568	4,134.52	953,463,617	1.07
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	135,570	8,532.04	1,156,688,880	6,696.96	907,908,006	1.02
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	408,717	2,079.98	850,125,541	1,951.66	797,680,503	0.89
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	76,819	11,297.91	867,894,635	9,951.90	764,495,121	0.86
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	363,546	2,455.91	892,838,790	2,083.93	757,604,925	0.85
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	569,131	1,712.35	974,554,895	1,293.58	736,219,837	0.82
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	4,209,693	249.70	1,051,174,286	169.81	714,860,597	0.80

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.94
合計	99.94

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

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

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

#### 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：2017年8月25日  
作成基準日：2020年5月29日

**基準価額・純資産の推移**


基準価額	10,196円
純資産総額	0.43億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年5月	0円
2018年11月	0円
2019年5月	0円
2019年11月	0円
2020年5月	0円
設定後 分配金合計額	0円

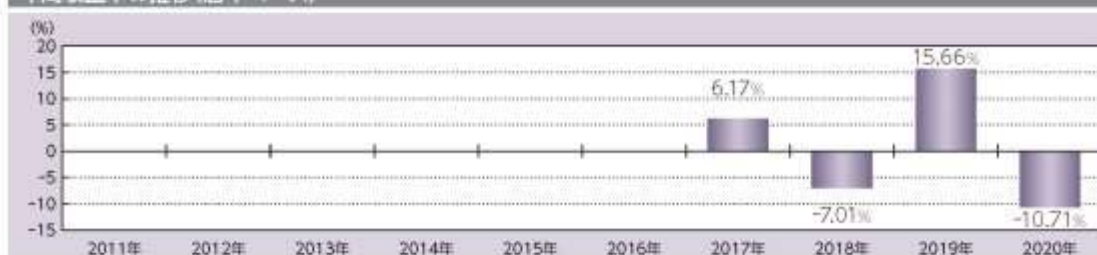
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	13.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・ハードウェア	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
グローバルREITインデックスマザーファンド	13.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.9%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
国内株式インデックスマザーファンド	13.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.4%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.2%
新興国株式インデックスマザーファンド	12.6%	ALIBABA GROUP HOLDING SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	0.8%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.7%
新興国債券インデックスマザーファンド	12.4%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.8%
		BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	国債	-	10.000%	2023/01/01	0.2%
J-REITインデックスマザーファンド	12.1%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.8%
外国債券インデックスマザーファンド	11.5%	T 2.375% 05/15/29	アメリカ	国債	-	2.375%	2029/05/15	0.1%
		T 1.625% 08/15/29	アメリカ	国債	-	1.625%	2029/08/15	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	10.5%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.2%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**


※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと

引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

**< 基準価額の算出頻度 >**

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

**< 主要な投資対象資産の評価方法 >**

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。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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。（2017年 8月25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5月11日から11月10日まで及び11月11日から翌年5月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2017年11月10日までとします。

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

## （５）【その他】

### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

#### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

#### (2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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、知っ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。

上記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。

上記 から 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 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

#### (1) 投資信託約款の変更等

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

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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ものを除きます。）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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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、知っ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。

上記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。

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。

上記からまでの規定は、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。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、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 >

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。

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っている受益者に対して交付します。

## < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益

権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2019年11月12日から2020年5月11日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2019年11月11日現在)	第6期 (2020年5月11日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	388,683	744,838
親投資信託受益証券	32,057,162	38,502,325
未収入金	362,973	121,588
流動資産合計	32,808,818	39,368,751
資産合計	32,808,818	39,368,751
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	379,536	299,999
未払受託者報酬	7,812	9,670
未払委託者報酬	70,226	86,928
その他未払費用	721	910
流動負債合計	458,295	397,507
負債合計	458,295	397,507
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	28,946,438	39,427,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,404,085	455,996
(分配準備積立金)	1,988,308	2,130,143
元本等合計	32,350,523	38,971,244
純資産合計	32,350,523	38,971,244
負債純資産合計	32,808,818	39,368,751

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2019年5月11日	自	2019年11月12日
	至	2019年11月11日	至	2020年5月11日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		2,062,246		4,385,151
<b>営業収益合計</b>		<b>2,062,246</b>		<b>4,385,151</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		20		49
受託者報酬		7,812		9,670
委託者報酬		70,226		86,928
その他費用		721		910
<b>営業費用合計</b>		<b>78,779</b>		<b>97,557</b>
営業利益又は営業損失（ ）		1,983,467		4,482,708
経常利益又は経常損失（ ）		1,983,467		4,482,708
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,983,467		4,482,708
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（ ）		167,302		124,189
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,055,849		3,404,085
剰余金増加額又は欠損金減少額		737,685		1,050,485
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		737,685		1,050,485
剰余金減少額又は欠損金増加額		205,614		552,047
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		205,614		552,047
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,404,085		455,996

## (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5月11日から11月10日まで、及び11月11日から翌年5月10日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第6期計算期間は2019年11月12日から2020年5月11日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2019年11月11日現在)	第6期 (2020年5月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,946,438口	39,427,240口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 - 円	元本の欠損 455,996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 1.1176円 (1万口当たり純資産額) (11,176円)	1口当たり純資産額 0.9884円 (1万口当たり純資産額) (9,884円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2019年 5月11日 至 2019年11月11日			第6期 自 2019年11月12日 至 2020年 5月11日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	412,737円	費用控除後の配当等収益額	A	414,140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	1,175,064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	1,415,777円	収益調整金額	C	2,621,485円
分配準備積立金額	D	400,507円	分配準備積立金額	D	1,716,003円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,404,085円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,751,628円
当ファンドの期末残存口数	F	28,946,438口	当ファンドの期末残存口数	F	39,427,240口



第5期 自 2019年 5月11日 至 2019年11月11日			第6期 自 2019年11月12日 至 2020年 5月11日		
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,175円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,205円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2019年11月12日 至 2020年 5月11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6期 (2020年 5月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第6期 (2020年 5月11日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第5期 自 2019年 5月11日 至 2019年11月11日	第6期 自 2019年11月12日 至 2020年 5月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	22,420,915円	28,946,438円
期中追加設定元本額	10,577,572円	15,251,653円
期中一部解約元本額	4,052,049円	4,770,851円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 (2019年11月11日現在)	第6期 (2020年 5月11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	1,926,748	4,261,884
合計	1,926,748	4,261,884

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

#### （４）【附属明細表】

##### 第１ 有価証券明細表

###### （１）株式

該当事項はありません。

###### （２）株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	2,832,618	4,772,678	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	3,404,616	5,093,305	
	新興国株式インデックス マザーファンド	2,045,162	4,969,130	
	国内株式インデックス マザーファンド	3,568,760	4,989,126	
	外国株式インデックス マザーファンド	2,117,164	5,225,372	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,983,065	4,218,650	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,580,913	4,513,822	
	新興国債券インデックス マザーファンド	3,051,815	4,720,242	
合計		21,584,113	38,502,325	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

##### 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### （参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 5月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,830,337,958
株式	289,806,798,310
派生商品評価勘定	269,816,250
未収入金	1,066,200
未収配当金	3,558,559,835
差入委託証拠金	405,890,500
流動資産合計	296,872,469,053
資産合計	296,872,469,053
負債の部	
流動負債	
前受金	269,842,100
未払金	514,158,232
未払解約金	55,281,460
未払利息	2,464
流動負債合計	839,284,256
負債合計	839,284,256
純資産の部	
元本等	
元本	211,758,250,803
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	84,274,933,994
元本等合計	296,033,184,797
純資産合計	296,033,184,797
負債純資産合計	296,872,469,053

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2020年 5月11日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 5月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	211,758,250,803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	<p>1口当たり純資産額 1.3980円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,980円)</p>

## （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 5月11日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>

	2020年 5月11日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月12日
期首元本額	207,370,772,902円
期中追加設定元本額	25,983,792,993円
期中一部解約元本額	21,596,315,092円
期末元本額	211,758,250,803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)	587,912,410円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,026,293,718円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,199,044円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,665,215,631円
世界経済インデックスファンド	2,208,482,313円
日本株式インデックス・オープン	4,290,044,457円
DCマイセレクション25	7,573,779,790円
DCマイセレクション50	20,068,491,005円
DCマイセレクション75	17,986,661,101円
DC日本株式インデックス・オープン	5,813,970,363円
DCマイセレクションS25	3,180,179,093円
DCマイセレクションS50	8,406,145,511円
DCマイセレクションS75	5,212,452,337円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,945,722,903円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	339,568,257円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	771,167,404円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	505,624,047円
DC世界経済インデックスファンド	2,864,000,593円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,060,461,968円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	16,353,756円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	36,718,016円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,561,470円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	262,757,766円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,765,336円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	75,093,855円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	262,532,624円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	55,956,109円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	310,926,544円

区分	2020年 5月11日現在
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,783,796,468円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	690,584,126円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,123,698,985円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	634,585,271円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	41,068,017円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	790,586,029円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	36,710,849円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	470,942,073円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	588,612,135円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	57,142,713円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	856,905,603円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,930,543,113円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,083,479,799円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	5,521,747,548円
分散投資コア戦略ファンドS	15,342,693,791円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	317,113,050円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	345,720,241円
コア投資戦略ファンド(切替型)	561,696,405円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	206,684,480円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,053,840円
SMT インデックスバランス・オープン	68,157,086円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,521,725,889円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	21,438,233円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	73,795,961円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	12,856,302円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,568,760円
グローバル経済コア	269,676,296円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	17,479,009円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	47,341,612円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,181,735円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	239,188,128円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,642,992円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	105,228円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	138,083円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	74,311円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	43,647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)	51,325,982,973円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	565,411,619円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	27,047,587円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	18,358,483円



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		9,715,684,703
合計		9,715,684,703

(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 5月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,549,397,900	-	5,819,240,000	269,842,100
	合計	5,549,397,900	-	5,819,240,000	269,842,100

## (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ではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,600	2,582.00	17,041,200	
日本水産	189,200	479.00	90,626,800	
マルハニチロ	27,300	2,317.00	63,254,100	
カネコ種苗	5,700	1,429.00	8,145,300	
サカタのタネ	22,600	3,600.00	81,360,000	
ホクト	14,400	1,964.00	28,281,600	
ホクリヨウ	2,900	594.00	1,722,600	
住石ホールディングス	38,200	114.00	4,354,800	

日鉄鉱業	4,300	4,535.00	19,500,500
三井松島ホールディングス	7,300	871.00	6,358,300
国際石油開発帝石	759,200	697.00	529,162,400
石油資源開発	24,700	1,898.00	46,880,600
K & O エナジーグループ	9,200	1,562.00	14,370,400
ヒノキヤグループ	4,700	1,791.00	8,417,700
ショーボンドホールディングス	29,500	4,490.00	132,455,000
ミライト・ホールディングス	56,200	1,449.00	81,433,800
タマホーム	10,200	1,380.00	14,076,000
サンヨーホームズ	1,600	615.00	984,000
日本アクア	7,500	635.00	4,762,500
ファーストコーポレーション	5,800	497.00	2,882,600
ベステラ	3,300	1,008.00	3,326,400
T A T E R U	39,000	117.00	4,563,000
キャンディル	3,100	501.00	1,553,100
スペースバリューホールディングス	23,100	365.00	8,431,500
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,079.00	3,884,400
第一カッター興業	2,300	1,712.00	3,937,600
明豊ファシリティワークス	6,100	600.00	3,660,000
安藤・間	112,700	715.00	80,580,500
東急建設	55,400	588.00	32,575,200
コムシスホールディングス	67,100	2,992.00	200,763,200
ピーアールホールディングス	20,600	494.00	10,176,400
高松コンストラクショングループ	11,800	2,347.00	27,694,600
東建コーポレーション	5,800	7,370.00	42,746,000
ソネック	1,900	761.00	1,445,900
ヤマウラ	8,200	770.00	6,314,000
大成建設	145,700	3,535.00	515,049,500
大林組	437,000	952.00	416,024,000
清水建設	443,500	875.00	388,062,500
飛島建設	12,500	1,108.00	13,850,000
長谷工コーポレーション	169,200	1,208.00	204,393,600
松井建設	17,200	667.00	11,472,400
銭高組	1,900	3,405.00	6,469,500
鹿島建設	343,100	1,167.00	400,397,700
不動テトラ	11,400	1,406.00	16,028,400
大末建設	5,100	757.00	3,860,700
鉄建建設	9,500	2,227.00	21,156,500
西松建設	33,700	2,238.00	75,420,600
三井住友建設	105,600	464.00	48,998,400
大豊建設	9,800	2,365.00	23,177,000
前田建設工業	109,500	892.00	97,674,000

佐田建設	9,400	401.00	3,769,400	
ナカノフドー建設	11,900	369.00	4,391,100	
奥村組	23,700	2,437.00	57,756,900	
東鉄工業	18,700	2,780.00	51,986,000	
イチケン	3,100	1,271.00	3,940,100	
富士ピー・エス	6,400	522.00	3,340,800	
浅沼組	4,900	3,580.00	17,542,000	
戸田建設	181,500	652.00	118,338,000	
熊谷組	20,300	2,538.00	51,521,400	
北野建設	2,700	2,566.00	6,928,200	
植木組	1,900	2,488.00	4,727,200	
矢作建設工業	19,300	805.00	15,536,500	
ピーエス三菱	14,400	557.00	8,020,800	
日本ハウスホールディングス	29,800	290.00	8,642,000	
大東建託	47,700	11,495.00	548,311,500	
新日本建設	18,600	771.00	14,340,600	
N I P P O	36,200	2,478.00	89,703,600	
東亜道路工業	2,700	2,941.00	7,940,700	
前田道路	38,600	2,077.00	80,172,200	
日本道路	4,200	6,680.00	28,056,000	
東亜建設工業	13,600	1,470.00	19,992,000	
日本国土開発	42,500	569.00	24,182,500	
若築建設	7,900	1,205.00	9,519,500	
東洋建設	49,000	449.00	22,001,000	
五洋建設	173,200	562.00	97,338,400	
世紀東急工業	21,000	808.00	16,968,000	
福田組	5,100	4,240.00	21,624,000	
住友林業	110,700	1,337.00	148,005,900	
日本基礎技術	14,700	405.00	5,953,500	
巴コーポレーション	19,400	393.00	7,624,200	
大和ハウス工業	432,400	2,778.50	1,201,423,400	
ライト工業	25,000	1,440.00	36,000,000	
積水ハウス	478,100	1,880.50	899,067,050	
日特建設	11,400	727.00	8,287,800	
北陸電気工事	7,600	914.00	6,946,400	
ユアテック	25,000	620.00	15,500,000	
日本リーテック	9,100	2,000.00	18,200,000	
四電工	2,400	2,309.00	5,541,600	
中電工	17,600	2,220.00	39,072,000	
関電工	62,200	924.00	57,472,800	
きんでん	103,800	1,761.00	182,791,800	
東京エネシス	14,500	757.00	10,976,500	

トーエネック	4,400	3,425.00	15,070,000
住友電設	12,300	2,366.00	29,101,800
日本電設工業	24,000	2,123.00	50,952,000
協和エクシオ	66,300	2,665.00	176,689,500
新日本空調	11,600	2,246.00	26,053,600
九電工	30,700	3,035.00	93,174,500
三機工業	31,500	1,323.00	41,674,500
日揮ホールディングス	134,500	1,065.00	143,242,500
中外炉工業	4,700	1,584.00	7,444,800
ヤマト	14,000	635.00	8,890,000
太平電業	10,600	2,409.00	25,535,400
高砂熱学工業	38,000	1,714.00	65,132,000
三晃金属工業	1,900	2,136.00	4,058,400
朝日工業社	2,900	2,900.00	8,410,000
明星工業	28,300	790.00	22,357,000
大気社	21,200	3,185.00	67,522,000
ダイダン	10,400	2,790.00	29,016,000
日比谷総合設備	14,100	1,841.00	25,958,100
フィル・カンパニー	2,500	2,864.00	7,160,000
OSJBホールディングス	68,900	251.00	17,293,900
東洋エンジニアリング	18,400	387.00	7,120,800
レイズネクスト	23,400	1,205.00	28,197,000
日本製粉	40,900	1,719.00	70,307,100
日清製粉グループ本社	158,000	1,709.00	270,022,000
日東富士製粉	1,000	5,890.00	5,890,000
昭和産業	12,800	3,270.00	41,856,000
鳥越製粉	12,400	902.00	11,184,800
中部飼料	17,100	1,623.00	27,753,300
フィード・ワン	93,900	185.00	17,371,500
東洋精糖	2,400	1,203.00	2,887,200
日本甜菜製糖	7,300	1,729.00	12,621,700
三井製糖	12,300	2,205.00	27,121,500
塩水港精糖	15,100	209.00	3,155,900
日新製糖	6,600	1,910.00	12,606,000
森永製菓	32,800	4,460.00	146,288,000
中村屋	3,600	3,970.00	14,292,000
江崎グリコ	41,500	4,840.00	200,860,000
名糖産業	6,700	1,265.00	8,475,500
井村屋グループ	7,900	1,929.00	15,239,100
不二家	7,800	2,024.00	15,787,200
山崎製パン	104,800	1,874.00	196,395,200
第一屋製パン	2,400	914.00	2,193,600

モロゾフ	2,400	5,600.00	13,440,000	
亀田製菓	8,000	5,100.00	40,800,000	
寿スピリッツ	13,500	4,920.00	66,420,000	
カルビー	63,700	3,270.00	208,299,000	
森永乳業	25,900	4,100.00	106,190,000	
六甲バター	9,300	1,406.00	13,075,800	
ヤクルト本社	96,200	6,420.00	617,604,000	
明治ホールディングス	92,500	7,550.00	698,375,000	
雪印メグミルク	33,700	2,488.00	83,845,600	
プリマハム	21,900	2,417.00	52,932,300	
日本ハム	53,500	3,770.00	201,695,000	
林兼産業	4,600	588.00	2,704,800	
丸大食品	14,900	1,986.00	29,591,400	
S Foods	11,200	2,400.00	26,880,000	
柿安本店	4,800	2,400.00	11,520,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	90,100	637.00	57,393,700	
サッポロホールディングス	47,700	2,071.00	98,786,700	
アサヒグループホールディングス	292,900	3,813.00	1,116,827,700	
キリンホールディングス	593,200	2,077.50	1,232,373,000	
宝ホールディングス	103,700	823.00	85,345,100	
オエノンホールディングス	36,900	395.00	14,575,500	
養命酒製造	4,300	1,918.00	8,247,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	98,200	2,061.00	202,390,200	
サントリー食品インターナショナル	93,600	4,285.00	401,076,000	
ダイトーグループホールディングス	7,200	4,485.00	32,292,000	
伊藤園	42,500	6,090.00	258,825,000	
キーコーヒー	13,700	2,274.00	31,153,800	
ユニカフェ	3,600	917.00	3,301,200	
ジャパンフーズ	2,000	1,153.00	2,306,000	
日清オイリオグループ	18,000	3,590.00	64,620,000	
不二製油グループ本社	34,100	2,555.00	87,125,500	
かどや製油	1,500	3,755.00	5,632,500	
J - オイルミルズ	7,200	4,200.00	30,240,000	
キッコーマン	100,700	4,795.00	482,856,500	
味の素	308,900	1,899.50	586,755,550	
キューピー	77,900	2,136.00	166,394,400	
ハウス食品グループ本社	52,300	3,515.00	183,834,500	
カゴメ	53,100	2,770.00	147,087,000	
焼津水産化学工業	6,800	934.00	6,351,200	
アリアケジャパン	12,800	6,240.00	79,872,000	
ピエトロ	1,800	1,610.00	2,898,000	
エバラ食品工業	3,400	2,227.00	7,571,800	

やまみ	1,200	2,040.00	2,448,000	
ニチレイ	66,600	2,698.00	179,686,800	
東洋水産	72,000	5,080.00	365,760,000	
イトアンド	4,800	1,773.00	8,510,400	
大冷	1,800	1,845.00	3,321,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,800	1,144.00	8,923,200	
日清食品ホールディングス	59,500	8,810.00	524,195,000	
永谷園ホールディングス	6,800	2,205.00	14,994,000	
一正蒲鉾	5,400	946.00	5,108,400	
フジッコ	15,100	1,940.00	29,294,000	
ロック・フィールド	15,100	1,314.00	19,841,400	
日本たばこ産業	807,600	2,033.00	1,641,850,800	
ケンコーマヨネーズ	7,800	2,000.00	15,600,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,200	1,675.00	15,410,000	
なとり	7,800	1,790.00	13,962,000	
イフジ産業	2,400	788.00	1,891,200	
ピクルスコーポレーション	3,000	2,188.00	6,564,000	
北の達人コーポレーション	48,800	533.00	26,010,400	
ユーグレナ	60,300	666.00	40,159,800	
ミヨシ油脂	5,400	1,140.00	6,156,000	
理研ビタミン	13,200	2,138.00	28,221,600	
片倉工業	20,200	1,047.00	21,149,400	
ゲンゼ	10,100	3,775.00	38,127,500	
東洋紡	54,300	1,384.00	75,151,200	
ユニチカ	41,400	338.00	13,993,200	
富士紡ホールディングス	6,700	3,090.00	20,703,000	
倉敷紡績	13,700	2,476.00	33,921,200	
シキボウ	7,200	1,058.00	7,617,600	
日本毛織	45,400	951.00	43,175,400	
トーア紡コーポレーション	5,400	490.00	2,646,000	
帝国繊維	15,500	2,281.00	35,355,500	
帝人	111,600	1,688.00	188,380,800	
東レ	989,100	509.50	503,946,450	
サカイオーベックス	3,800	1,931.00	7,337,800	
住江織物	3,000	1,860.00	5,580,000	
日本フェルト	8,700	467.00	4,062,900	
イチカワ	2,300	1,381.00	3,176,300	
日東製網	1,600	1,420.00	2,272,000	
アツギ	11,600	628.00	7,284,800	
ダイニック	5,200	742.00	3,858,400	
セーレン	33,900	1,306.00	44,273,400	
ソトー	5,700	917.00	5,226,900	

東海染工	2,100	1,114.00	2,339,400
小松マテーレ	22,700	714.00	16,207,800
ワコールホールディングス	35,700	2,205.00	78,718,500
ホギメディカル	15,600	3,400.00	53,040,000
クラウドシアホールディングス	4,000	418.00	1,672,000
T S Iホールディングス	46,400	438.00	20,323,200
マツオカコーポレーション	4,000	2,024.00	8,096,000
ワールド	19,500	1,358.00	26,481,000
三陽商会	7,400	981.00	7,259,400
ナイガイ	5,600	416.00	2,329,600
オンワードホールディングス	82,700	349.00	28,862,300
ルックホールディングス	5,000	832.00	4,160,000
ゴールドウイン	24,800	5,910.00	146,568,000
デサント	26,800	1,425.00	38,190,000
キング	6,900	494.00	3,408,600
ヤマトインターナショナル	12,700	348.00	4,419,600
特種東海製紙	8,700	4,115.00	35,800,500
王子ホールディングス	570,500	586.00	334,313,000
日本製紙	60,400	1,575.00	95,130,000
三菱製紙	15,500	385.00	5,967,500
北越コーポレーション	81,400	431.00	35,083,400
中越パルプ工業	5,800	1,365.00	7,917,000
巴川製紙所	4,000	876.00	3,504,000
大王製紙	60,200	1,472.00	88,614,400
阿波製紙	3,500	512.00	1,792,000
レンゴー	129,000	877.00	113,133,000
トーモク	8,400	1,772.00	14,884,800
ザ・パック	10,300	3,335.00	34,350,500
クラレ	214,900	1,113.00	239,183,700
旭化成	904,600	766.60	693,466,360
共和レザー	7,400	671.00	4,965,400
昭和電工	97,200	2,357.00	229,100,400
住友化学	1,002,700	340.00	340,918,000
住友精化	6,000	2,984.00	17,904,000
日産化学	75,800	4,045.00	306,611,000
ラサ工業	4,800	1,371.00	6,580,800
クレハ	11,700	4,430.00	51,831,000
多木化学	5,300	5,660.00	29,998,000
テイカ	10,000	1,589.00	15,890,000
石原産業	24,500	681.00	16,684,500
片倉コープアグリ	3,500	1,175.00	4,112,500
日本曹達	20,200	2,822.00	57,004,400

東ソー	211,000	1,345.00	283,795,000
トクヤマ	39,300	2,351.00	92,394,300
セントラル硝子	27,900	1,896.00	52,898,400
東亜合成	85,700	1,003.00	85,957,100
大阪ソーダ	13,900	2,500.00	34,750,000
関東電化工業	32,400	899.00	29,127,600
デンカ	49,800	2,677.00	133,314,600
信越化学工業	234,300	12,120.00	2,839,716,000
日本カーバイド工業	4,600	1,125.00	5,175,000
堺化学工業	8,800	1,863.00	16,394,400
第一稀元素化学工業	14,800	760.00	11,248,000
エア・ウォーター	126,900	1,514.00	192,126,600
大陽日酸	131,200	1,661.00	217,923,200
日本化学工業	4,200	2,379.00	9,991,800
東邦アセチレン	2,000	1,285.00	2,570,000
日本パーカライズニング	68,800	1,146.00	78,844,800
高压ガス工業	21,600	789.00	17,042,400
チタン工業	1,700	1,757.00	2,986,900
四国化成工業	21,000	1,075.00	22,575,000
戸田工業	3,200	1,399.00	4,476,800
ステラ ケミファ	7,400	2,382.00	17,626,800
保土谷化学工業	5,100	3,685.00	18,793,500
日本触媒	21,200	5,130.00	108,756,000
大日精化工業	12,100	2,357.00	28,519,700
カネカ	35,300	2,847.00	100,499,100
三菱瓦斯化学	127,000	1,350.00	171,450,000
三井化学	123,900	2,133.00	264,278,700
J S R	127,200	1,986.00	252,619,200
東京応化工業	23,400	4,580.00	107,172,000
大阪有機化学工業	12,600	1,757.00	22,138,200
三菱ケミカルホールディングス	912,400	621.70	567,239,080
K Hネオケム	24,100	1,997.00	48,127,700
ダイセル	177,700	887.00	157,619,900
住友ベークライト	21,500	2,887.00	62,070,500
積水化学工業	293,500	1,438.00	422,053,000
日本ゼオン	123,100	968.00	119,160,800
アイカ工業	40,900	3,020.00	123,518,000
宇部興産	68,900	1,832.00	126,224,800
積水樹脂	24,600	2,273.00	55,915,800
タキロンシーアイ	29,500	643.00	18,968,500
旭有機材	7,700	1,350.00	10,395,000
ニチバン	7,200	1,451.00	10,447,200



リケンテクノス	34,300	429.00	14,714,700
大倉工業	6,400	1,588.00	10,163,200
積水化成成品工業	18,300	644.00	11,785,200
群栄化学工業	3,100	2,646.00	8,202,600
タイガースポリマー	7,200	426.00	3,067,200
ミライアル	4,800	1,149.00	5,515,200
ダイキアクシス	4,800	748.00	3,590,400
ダイキョーニシカワ	28,800	570.00	16,416,000
竹本容器	4,900	769.00	3,768,100
森六ホールディングス	7,300	1,529.00	11,161,700
日本化薬	84,500	1,038.00	87,711,000
カーリットホールディングス	14,600	508.00	7,416,800
日本精化	11,000	1,350.00	14,850,000
扶桑化学工業	13,800	3,430.00	47,334,000
トリケミカル研究所	3,000	9,600.00	28,800,000
A D E K A	62,800	1,427.00	89,615,600
日油	51,400	3,560.00	182,984,000
新日本理化	22,600	184.00	4,158,400
ハリマ化成グループ	11,300	954.00	10,780,200
花王	333,700	8,450.00	2,819,765,000
第一工業製薬	5,100	4,755.00	24,250,500
石原ケミカル	3,700	1,911.00	7,070,700
日華化学	4,600	898.00	4,130,800
ニイタカ	2,800	2,759.00	7,725,200
三洋化成工業	8,100	4,380.00	35,478,000
有機合成薬品工業	10,500	355.00	3,727,500
大日本塗料	15,400	967.00	14,891,800
日本ペイントホールディングス	112,600	6,500.00	731,900,000
関西ペイント	153,300	2,105.00	322,696,500
神東塗料	10,700	183.00	1,958,100
中国塗料	38,800	808.00	31,350,400
日本特殊塗料	10,200	927.00	9,455,400
藤倉化成	18,400	506.00	9,310,400
太陽ホールディングス	10,000	4,445.00	44,450,000
D I C	57,600	2,509.00	144,518,400
サカタインクス	29,800	993.00	29,591,400
東洋インキ S C ホールディングス	28,900	1,993.00	57,597,700
T & K T O K A	10,600	726.00	7,695,600
富士フイルムホールディングス	267,200	5,213.00	1,392,913,600
資生堂	276,900	6,503.00	1,800,680,700
ライオン	181,200	2,335.00	423,102,000
高砂香料工業	8,700	2,211.00	19,235,700

マンダム	31,300	2,129.00	66,637,700
ミルボン	18,600	4,930.00	91,698,000
ファンケル	56,400	2,867.00	161,698,800
コーセー	26,200	13,440.00	352,128,000
コタ	8,000	1,199.00	9,592,000
シーボン	1,800	2,175.00	3,915,000
ポーラ・オルビスホールディングス	59,500	1,975.00	117,512,500
ノエビアホールディングス	11,800	5,030.00	59,354,000
アジュバンコスメジャパン	3,100	947.00	2,935,700
エステー	9,000	1,559.00	14,031,000
アグロ カネショウ	5,800	1,444.00	8,375,200
コニシ	22,900	1,492.00	34,166,800
長谷川香料	24,000	2,118.00	50,832,000
星光PMC	8,000	668.00	5,344,000
小林製薬	39,000	9,720.00	379,080,000
荒川化学工業	12,500	1,360.00	17,000,000
メック	9,600	1,713.00	16,444,800
日本高純度化学	3,800	2,657.00	10,096,600
タカラバイオ	36,500	2,494.00	91,031,000
JCU	16,900	2,926.00	49,449,400
新田ゼラチン	8,700	703.00	6,116,100
OATアグリオ	2,400	1,075.00	2,580,000
デクセリアルズ	36,000	745.00	26,820,000
アース製薬	10,500	6,120.00	64,260,000
北興化学工業	14,300	574.00	8,208,200
大成ラミック	4,600	2,670.00	12,282,000
クミアイ化学工業	57,600	850.00	48,960,000
日本農薬	24,800	435.00	10,788,000
アキレス	9,600	1,639.00	15,734,400
有沢製作所	22,000	796.00	17,512,000
日東電工	96,200	5,420.00	521,404,000
レック	14,900	1,363.00	20,308,700
三光合成	15,900	313.00	4,976,700
きもと	23,700	145.00	3,436,500
藤森工業	12,500	3,310.00	41,375,000
前澤化成工業	8,800	1,064.00	9,363,200
未来工業	7,500	1,914.00	14,355,000
ウェーブロックホールディングス	4,800	741.00	3,556,800
JSP	8,200	1,416.00	11,611,200
エフピコ	15,300	7,950.00	121,635,000
天馬	9,300	1,520.00	14,136,000
信越ポリマー	25,000	844.00	21,100,000

東リ	34,700	260.00	9,022,000
ニフコ	51,200	2,112.00	108,134,400
バルカー	11,300	1,867.00	21,097,100
ユニ・チャーム	268,600	3,914.00	1,051,300,400
ショーエイコーポレーション	2,100	740.00	1,554,000
協和キリン	140,200	2,582.00	361,996,400
武田薬品工業	1,159,400	3,764.00	4,363,981,600
アステラス製薬	1,208,300	1,805.00	2,180,981,500
大日本住友製薬	103,300	1,519.00	156,912,700
塩野義製薬	178,200	5,636.00	1,004,335,200
わかもと製薬	16,600	240.00	3,984,000
あすか製薬	15,900	1,126.00	17,903,400
日本新薬	36,500	7,090.00	258,785,000
ピオフェルミン製薬	2,400	2,353.00	5,647,200
中外製薬	145,300	12,725.00	1,848,942,500
科研製薬	23,900	5,760.00	137,664,000
エーザイ	166,800	7,440.00	1,240,992,000
ロート製薬	71,500	3,050.00	218,075,000
小野薬品工業	320,000	2,631.50	842,080,000
久光製薬	36,800	5,060.00	186,208,000
持田製薬	19,300	4,165.00	80,384,500
参天製薬	259,600	1,916.00	497,393,600
扶桑薬品工業	4,900	2,370.00	11,613,000
日本ケミファ	1,800	2,573.00	4,631,400
ツムラ	43,200	2,950.00	127,440,000
日医工	39,500	1,454.00	57,433,000
キッセイ薬品工業	24,700	2,612.00	64,516,400
生化学工業	27,000	1,114.00	30,078,000
栄研化学	24,500	1,840.00	45,080,000
日水製薬	5,900	1,238.00	7,304,200
鳥居薬品	8,700	2,969.00	25,830,300
JCRファーマ	9,800	10,720.00	105,056,000
東和薬品	17,800	2,290.00	40,762,000
富士製薬工業	9,500	1,153.00	10,953,500
沢井製薬	28,600	6,060.00	173,316,000
ゼリア新薬工業	25,300	2,063.00	52,193,900
第一三共	398,800	7,635.00	3,044,838,000
キョーリン製薬ホールディングス	30,700	2,240.00	68,768,000
大幸薬品	17,000	1,706.00	29,002,000
ダイト	8,400	3,995.00	33,558,000
大塚ホールディングス	265,500	4,242.00	1,126,251,000
大正製薬ホールディングス	29,500	6,820.00	201,190,000

ペプチドリーム	70,800	4,260.00	301,608,000
日本コークス工業	117,700	60.00	7,062,000
ニチレキ	16,500	1,484.00	24,486,000
ユシロ化学工業	7,800	1,151.00	8,977,800
ビーピー・カストロール	5,000	1,177.00	5,885,000
富士石油	37,200	177.00	6,584,400
MORESCO	5,000	939.00	4,695,000
出光興産	154,600	2,464.00	380,934,400
JXTGホールディングス	2,096,400	381.10	798,938,040
コスモエネルギーホールディングス	40,300	1,607.00	64,762,100
横浜ゴム	80,700	1,405.00	113,383,500
TOYO TIRE	80,000	1,299.00	103,920,000
ブリヂストン	401,400	3,422.00	1,373,590,800
住友ゴム工業	125,200	1,054.00	131,960,800
藤倉コンポジット	12,200	373.00	4,550,600
オカモト	8,500	4,275.00	36,337,500
フコク	6,100	619.00	3,775,900
ニッタ	15,700	2,099.00	32,954,300
住友理工	27,000	578.00	15,606,000
三ツ星ベルト	18,300	1,502.00	27,486,600
バンドー化学	24,500	658.00	16,121,000
日東紡績	20,700	5,120.00	105,984,000
AGC	137,800	2,750.00	378,950,000
日本板硝子	66,700	380.00	25,346,000
石塚硝子	2,600	2,139.00	5,561,400
日本山村硝子	5,800	866.00	5,022,800
日本電気硝子	56,000	1,622.00	90,832,000
オハラ	5,500	929.00	5,109,500
住友大阪セメント	26,400	3,675.00	97,020,000
太平洋セメント	88,000	2,263.00	199,144,000
日本ヒューム	14,000	659.00	9,226,000
日本コンクリート工業	30,100	262.00	7,886,200
三谷セキサン	6,500	4,800.00	31,200,000
アジアパイルホールディングス	19,800	434.00	8,593,200
東海カーボン	146,000	867.00	126,582,000
日本カーボン	7,200	3,410.00	24,552,000
東洋炭素	8,200	1,569.00	12,865,800
ノリタケカンパニーリミテド	7,700	3,585.00	27,604,500
TOTO	99,600	4,000.00	398,400,000
日本碍子	167,300	1,430.00	239,239,000
日本特殊陶業	106,000	1,644.00	174,264,000
MARUWA	5,400	7,840.00	42,336,000

品川リフラクトリーズ	3,700	2,317.00	8,572,900
黒崎播磨	2,800	4,025.00	11,270,000
ヨータイ	11,100	605.00	6,715,500
イソライト工業	7,200	464.00	3,340,800
東京窯業	17,800	300.00	5,340,000
ニッカトー	6,400	601.00	3,846,400
フジミインコーポレーテッド	12,400	3,065.00	38,006,000
クニミネ工業	5,700	1,059.00	6,036,300
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,191.00	2,858,400
ニチアス	38,200	2,220.00	84,804,000
ニチハ	19,400	2,293.00	44,484,200
日本製鉄	616,800	983.50	606,622,800
神戸製鋼所	252,400	376.00	94,902,400
中山製鋼所	19,300	384.00	7,411,200
合同製鐵	7,500	2,080.00	15,600,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	372,300	748.00	278,480,400
東京製鐵	67,200	776.00	52,147,200
共英製鋼	15,600	1,417.00	22,105,200
大和工業	29,300	2,172.00	63,639,600
東京鐵鋼	5,700	1,263.00	7,199,100
大阪製鐵	7,400	1,237.00	9,153,800
淀川製鋼所	18,600	1,770.00	32,922,000
丸一鋼管	44,800	2,525.00	113,120,000
モリ工業	4,200	2,378.00	9,987,600
大同特殊鋼	22,600	3,635.00	82,151,000
日本高周波鋼業	5,300	384.00	2,035,200
日本冶金工業	11,400	1,775.00	20,235,000
山陽特殊製鋼	9,500	1,050.00	9,975,000
愛知製鋼	7,800	2,846.00	22,198,800
日立金属	148,500	1,072.00	159,192,000
日本金属	3,200	649.00	2,076,800
大平洋金属	9,400	1,654.00	15,547,600
新日本電工	89,200	157.00	14,004,400
栗本鐵工所	6,800	1,850.00	12,580,000
虹技	2,100	1,157.00	2,429,700
三菱製鋼	10,300	751.00	7,735,300
日亜鋼業	20,400	273.00	5,569,200
日本精線	2,300	2,968.00	6,826,400
エンビプロ・ホールディングス	6,000	594.00	3,564,000
シンニッタン	21,700	269.00	5,837,300
新家工業	3,200	1,113.00	3,561,600
大紀アルミニウム工業所	22,800	590.00	13,452,000

日本軽金属ホールディングス	349,300	174.00	60,778,200
三井金属鉱業	37,200	2,139.00	79,570,800
東邦亜鉛	7,100	1,444.00	10,252,400
三菱マテリアル	91,100	2,275.00	207,252,500
住友金属鉱山	176,200	2,868.00	505,341,600
DOWAホールディングス	34,900	3,120.00	108,888,000
古河機械金属	24,600	1,090.00	26,814,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	998.00	14,371,200
東邦チタニウム	24,800	637.00	15,797,600
UACJ	21,000	1,785.00	37,485,000
CKサンエツ	2,900	2,995.00	8,685,500
古河電気工業	42,900	2,081.00	89,274,900
住友電気工業	515,300	1,134.00	584,350,200
フジクラ	166,700	329.00	54,844,300
昭和電線ホールディングス	16,000	1,216.00	19,456,000
東京特殊電線	2,100	2,461.00	5,168,100
タツタ電線	27,500	549.00	15,097,500
カナレ電気	2,300	1,650.00	3,795,000
平河ヒューテック	7,000	1,069.00	7,483,000
リョービ	17,000	1,331.00	22,627,000
アーレスティ	18,300	394.00	7,210,200
アサヒホールディングス	24,200	2,638.00	63,839,600
稲葉製作所	7,800	1,369.00	10,678,200
宮地エンジニアリンググループ	4,200	1,650.00	6,930,000
トーカロ	38,300	1,126.00	43,125,800
アルファC o	4,900	945.00	4,630,500
SUMCO	165,000	1,639.00	270,435,000
川田テクノロジーズ	2,800	5,100.00	14,280,000
RS Technologies	3,900	2,917.00	11,376,300
信和	7,900	724.00	5,719,600
東洋製罐グループホールディングス	87,800	1,111.00	97,545,800
ホッカンホールディングス	7,600	1,572.00	11,947,200
コロナ	7,600	980.00	7,448,000
横河ブリッジホールディングス	25,600	1,880.00	48,128,000
駒井ハルテック	2,600	1,535.00	3,991,000
高田機工	1,300	2,260.00	2,938,000
三和ホールディングス	129,900	860.00	111,714,000
文化シャッター	40,600	808.00	32,804,800
三協立山	17,700	927.00	16,407,900
アルインコ	10,000	948.00	9,480,000
東洋シャッター	3,300	700.00	2,310,000
LIXILグループ	203,300	1,401.00	284,823,300

日本ファイルコン	10,500	524.00	5,502,000	
ノーリツ	28,600	1,268.00	36,264,800	
長府製作所	14,000	2,346.00	32,844,000	
リンナイ	26,800	8,800.00	235,840,000	
ダイニチ工業	7,400	696.00	5,150,400	
日東精工	19,000	474.00	9,006,000	
三洋工業	1,800	1,882.00	3,387,600	
岡部	27,900	788.00	21,985,200	
ジーテクト	17,100	1,136.00	19,425,600	
東プレ	25,700	1,334.00	34,283,800	
高周波熱錬	26,500	599.00	15,873,500	
東京製綱	9,900	570.00	5,643,000	
サンコール	10,300	412.00	4,243,600	
モリテック スチール	10,700	291.00	3,113,700	
パイオラックス	20,400	1,633.00	33,313,200	
エイチワン	13,500	566.00	7,641,000	
日本発條	147,800	730.00	107,894,000	
中央発條	1,700	2,752.00	4,678,400	
アドバネクス	2,000	1,371.00	2,742,000	
立川ブラインド工業	6,100	1,098.00	6,697,800	
三益半導体工業	10,800	2,192.00	23,673,600	
日本ドライケミカル	3,500	1,425.00	4,987,500	
日本製鋼所	41,900	1,367.00	57,277,300	
三浦工業	59,700	4,440.00	265,068,000	
タクマ	46,800	1,230.00	57,564,000	
ツガミ	28,700	1,023.00	29,360,100	
オークマ	16,100	4,410.00	71,001,000	
芝浦機械	15,600	2,209.00	34,460,400	
アマダ	171,000	981.00	167,751,000	
アイダエンジニアリング	36,200	731.00	26,462,200	
滝澤鉄工所	4,300	1,084.00	4,661,200	
F U J I	59,300	1,792.00	106,265,600	
牧野フライス製作所	16,200	3,450.00	55,890,000	
オーエスジー	63,800	1,462.00	93,275,600	
ダイジェット工業	1,700	1,241.00	2,109,700	
旭ダイヤモンド工業	36,400	503.00	18,309,200	
D M G 森精機	87,300	1,205.00	105,196,500	
ソディック	32,500	787.00	25,577,500	
ディスコ	18,700	25,060.00	468,622,000	
日東工器	7,600	1,987.00	15,101,200	
日進工具	5,400	2,785.00	15,039,000	
パンチ工業	12,700	365.00	4,635,500	

富士ダイス	6,200	598.00	3,707,600
豊和工業	7,800	723.00	5,639,400
OKK	5,900	494.00	2,914,600
東洋機械金属	10,000	414.00	4,140,000
津田駒工業	2,800	806.00	2,256,800
エンシュウ	3,400	1,027.00	3,491,800
島精機製作所	21,800	1,668.00	36,362,400
オプトラン	15,400	3,090.00	47,586,000
NCホールディングス	4,300	539.00	2,317,700
イワキポンプ	8,800	987.00	8,685,600
フリュー	13,500	890.00	12,015,000
ヤマシンフィルタ	30,000	861.00	25,830,000
日阪製作所	17,100	735.00	12,568,500
やまびこ	26,800	871.00	23,342,800
平田機工	6,500	5,380.00	34,970,000
ペガサスミシン製造	14,200	336.00	4,771,200
マルマエ	5,200	894.00	4,648,800
タツモ	6,500	1,248.00	8,112,000
ナプテスコ	81,200	3,300.00	267,960,000
三井海洋開発	14,700	1,669.00	24,534,300
レオン自動機	13,600	1,322.00	17,979,200
SMC	43,700	51,120.00	2,233,944,000
ホソカワミクロン	4,900	5,110.00	25,039,000
ユニオンツール	5,200	2,866.00	14,903,200
オイレス工業	17,900	1,374.00	24,594,600
日精エー・エス・ビー機械	4,000	3,080.00	12,320,000
サトーホールディングス	19,700	2,300.00	45,310,000
技研製作所	12,100	4,070.00	49,247,000
日本エアテック	4,700	1,150.00	5,405,000
カワタ	4,200	751.00	3,154,200
日精樹脂工業	11,700	970.00	11,349,000
オカダアイヨン	4,400	885.00	3,894,000
ワイエイシイホールディングス	5,900	461.00	2,719,900
小松製作所	631,200	2,099.00	1,324,888,800
住友重機械工業	79,800	2,322.00	185,295,600
日立建機	55,900	2,599.00	145,284,100
日工	19,300	586.00	11,309,800
巴工業	6,000	1,894.00	11,364,000
井関農機	14,000	1,202.00	16,828,000
TOWA	14,200	959.00	13,617,800
丸山製作所	2,900	1,347.00	3,906,300
北川鉄工所	6,300	1,640.00	10,332,000



ローツェ	6,100	4,795.00	29,249,500
タカキタ	5,000	532.00	2,660,000
クボタ	739,400	1,365.00	1,009,281,000
荏原実業	3,500	2,259.00	7,906,500
三菱化工機	4,900	1,600.00	7,840,000
月島機械	25,800	1,255.00	32,379,000
帝国電機製作所	11,500	1,305.00	15,007,500
新東工業	33,200	779.00	25,862,800
澁谷工業	12,200	2,685.00	32,757,000
アイチ コーポレーション	24,200	703.00	17,012,600
小森コーポレーション	35,500	774.00	27,477,000
鶴見製作所	10,800	1,873.00	20,228,400
住友精密工業	2,100	2,204.00	4,628,400
日本ギア工業	5,800	268.00	1,554,400
酒井重工業	2,700	2,105.00	5,683,500
荏原製作所	57,700	2,431.00	140,268,700
石井鐵工所	1,900	2,423.00	4,603,700
西島製作所	14,200	739.00	10,493,800
北越工業	14,400	1,026.00	14,774,400
ダイキン工業	177,500	14,050.00	2,493,875,000
オルガノ	5,000	5,860.00	29,300,000
トーヨーカネツ	6,100	1,941.00	11,840,100
栗田工業	75,500	3,080.00	232,540,000
椿本チエイン	19,900	2,624.00	52,217,600
大同工業	6,800	635.00	4,318,000
木村化工機	11,900	442.00	5,259,800
アネスト岩田	21,800	851.00	18,551,800
ダイフク	71,200	7,420.00	528,304,000
サムコ	3,500	1,871.00	6,548,500
加藤製作所	7,700	1,228.00	9,455,600
油研工業	2,400	1,413.00	3,391,200
タダノ	67,400	826.00	55,672,400
フジテック	50,700	1,587.00	80,460,900
C K D	38,200	1,876.00	71,663,200
キトー	10,600	1,124.00	11,914,400
平和	38,900	1,930.00	75,077,000
理想科学工業	12,400	1,510.00	18,724,000
S A N K Y O	31,000	3,030.00	93,930,000
日本金銭機械	15,500	595.00	9,222,500
マースグループホールディングス	8,900	1,704.00	15,165,600
フクシマガリレイ	8,600	3,250.00	27,950,000
オーイズミ	6,000	416.00	2,496,000

ダイコク電機	6,500	1,295.00	8,417,500
竹内製作所	23,400	1,709.00	39,990,600
アマノ	36,500	2,269.00	82,818,500
J U K I	19,400	648.00	12,571,200
蛇の目ミシン工業	12,900	447.00	5,766,300
マックス	21,300	1,657.00	35,294,100
グローリー	35,800	2,514.00	90,001,200
新晃工業	13,000	1,401.00	18,213,000
大和冷機工業	20,200	970.00	19,594,000
セガサミーホールディングス	138,300	1,381.00	190,992,300
日本ピストンリング	5,100	1,181.00	6,023,100
リケン	6,500	2,793.00	18,154,500
T P R	18,800	1,307.00	24,571,600
ツバキ・ナカシマ	28,500	816.00	23,256,000
ホシザキ	40,700	8,380.00	341,066,000
大豊工業	11,500	558.00	6,417,000
日本精工	262,500	793.00	208,162,500
N T N	322,900	220.00	71,038,000
ジェイテクト	133,800	816.00	109,180,800
不二越	13,000	3,355.00	43,615,000
日本トムソン	41,500	394.00	16,351,000
T H K	81,100	2,688.00	217,996,800
ユーシン精機	10,900	701.00	7,640,900
前澤給装工業	5,100	2,108.00	10,750,800
イーグル工業	17,300	726.00	12,559,800
前澤工業	9,500	353.00	3,353,500
日本ピラー工業	14,100	1,295.00	18,259,500
キッツ	56,600	710.00	40,186,000
マキタ	181,700	3,450.00	626,865,000
日立造船	110,800	362.00	40,109,600
三菱重工業	233,600	2,742.50	640,648,000
I H I	100,500	1,381.00	138,790,500
スター精密	21,500	1,227.00	26,380,500
日清紡ホールディングス	93,000	770.00	71,610,000
イビデン	85,500	2,854.00	244,017,000
コニカミノルタ	305,600	406.00	124,073,600
ブラザー工業	170,400	1,924.00	327,849,600
ミネベアミツミ	258,900	1,875.00	485,437,500
日立製作所	669,600	3,268.00	2,188,252,800
三菱電機	1,393,600	1,362.00	1,898,083,200
富士電機	84,000	2,758.00	231,672,000
東洋電機製造	5,100	1,274.00	6,497,400

安川電機	150,000	3,520.00	528,000,000
シンフォニアテクノロジー	18,100	1,075.00	19,457,500
明電舎	25,700	1,739.00	44,692,300
オリジン	3,800	1,489.00	5,658,200
山洋電気	6,800	4,805.00	32,674,000
デンヨー	11,900	2,008.00	23,895,200
東芝テック	17,500	3,555.00	62,212,500
芝浦メカトロニクス	2,600	2,981.00	7,750,600
マブチモーター	38,700	3,275.00	126,742,500
日本電産	335,400	6,242.00	2,093,566,800
トレックス・セミコンダクター	8,400	1,083.00	9,097,200
東光高岳	8,200	963.00	7,896,600
ダイヘン	15,300	3,275.00	50,107,500
ヤーマン	23,300	715.00	16,659,500
JVCケンウッド	116,300	175.00	20,352,500
ミマキエンジニアリング	13,500	420.00	5,670,000
第一精工	5,900	2,219.00	13,092,100
日新電機	32,800	1,095.00	35,916,000
大崎電気工業	27,900	524.00	14,619,600
オムロン	124,900	6,720.00	839,328,000
日東工業	20,500	1,830.00	37,515,000
I D E C	20,200	1,706.00	34,461,200
正興電機製作所	3,800	926.00	3,518,800
不二電機工業	2,700	1,251.00	3,377,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,800	1,599.00	74,833,200
サクサホールディングス	3,300	1,762.00	5,814,600
メルコホールディングス	5,000	2,617.00	13,085,000
テクノメディカ	3,400	1,881.00	6,395,400
日本電気	169,100	4,290.00	725,439,000
富士通	134,300	10,610.00	1,424,923,000
沖電気工業	56,700	1,087.00	61,632,900
岩崎通信機	6,100	843.00	5,142,300
電気興業	6,700	2,642.00	17,701,400
サンケン電気	15,200	2,315.00	35,188,000
ナカヨ	2,800	1,356.00	3,796,800
アイホン	7,900	1,593.00	12,584,700
ルネサスエレクトロニクス	667,100	590.00	393,589,000
セイコーエプソン	173,000	1,206.00	208,638,000
ワコム	94,800	457.00	43,323,600
アルバック	25,700	3,005.00	77,228,500
アクセル	6,400	733.00	4,691,200
E I Z O	10,800	3,565.00	38,502,000

日本信号	35,600	1,070.00	38,092,000
京三製作所	32,800	515.00	16,892,000
能美防災	18,600	2,075.00	38,595,000
ホーチキ	10,400	1,343.00	13,967,200
星和電機	7,600	600.00	4,560,000
エレコム	15,500	4,470.00	69,285,000
パナソニック	1,592,300	820.40	1,306,322,920
シャープ	161,300	1,134.00	182,914,200
アンリツ	89,800	2,205.00	198,009,000
富士通ゼネラル	37,900	1,861.00	70,531,900
ソニー	873,000	7,059.00	6,162,507,000
TDK	67,300	9,550.00	642,715,000
帝国通信工業	6,500	1,197.00	7,780,500
タムラ製作所	46,800	462.00	21,621,600
アルプスアルパイン	123,700	1,263.00	156,233,100
池上通信機	4,400	890.00	3,916,000
鈴木	7,500	729.00	5,467,500
日本トリム	2,000	3,395.00	6,790,000
ローランド ディー・ジー	8,000	1,419.00	11,352,000
フォスター電機	14,700	1,225.00	18,007,500
SMK	3,600	2,628.00	9,460,800
ヨコオ	9,200	2,613.00	24,039,600
ホシデン	38,600	890.00	34,354,000
ヒロセ電機	21,600	12,120.00	261,792,000
日本航空電子工業	32,000	1,494.00	47,808,000
TOA	15,100	724.00	10,932,400
マクセルホールディングス	30,500	1,019.00	31,079,500
古野電気	18,500	842.00	15,577,000
ユニデンホールディングス	3,900	1,935.00	7,546,500
スミダコーポレーション	11,400	714.00	8,139,600
アイコム	7,700	2,600.00	20,020,000
リオン	6,000	2,307.00	13,842,000
本多通信工業	13,000	419.00	5,447,000
横河電機	127,900	1,507.00	192,745,300
新電元工業	5,000	2,507.00	12,535,000
アズビル	88,000	2,836.00	249,568,000
東亜ディーケーケー	7,400	881.00	6,519,400
日本光電工業	57,700	3,860.00	222,722,000
チノー	4,900	1,400.00	6,860,000
共和電業	14,800	387.00	5,727,600
日本電子材料	5,600	972.00	5,443,200
堀場製作所	27,600	5,850.00	161,460,000

アドバンテスト	103,600	5,300.00	549,080,000
小野測器	6,700	500.00	3,350,000
エスベック	12,600	1,777.00	22,390,200
キーエンス	126,300	39,990.00	5,050,737,000
日置電機	7,400	3,215.00	23,791,000
シスメックス	99,700	7,450.00	742,765,000
日本マイクロニクス	24,700	924.00	22,822,800
メガチップス	13,200	1,593.00	21,027,600
O B A R A G R O U P	8,300	2,940.00	24,402,000
澤藤電機	1,900	2,510.00	4,769,000
原田工業	7,100	847.00	6,013,700
コーセル	19,000	883.00	16,777,000
イリソ電子工業	11,800	3,355.00	39,589,000
オブテックスグループ	23,200	1,304.00	30,252,800
千代田インテグレ	6,700	1,773.00	11,879,100
アイ・オー・データ機器	5,000	1,013.00	5,065,000
レーザーテック	61,200	7,610.00	465,732,000
スタンレー電気	98,200	2,488.00	244,321,600
岩崎電気	5,700	1,543.00	8,795,100
ウシオ電機	77,300	1,159.00	89,590,700
岡谷電機産業	12,300	319.00	3,923,700
ヘリオス テクノ ホールディング	14,200	337.00	4,785,400
エノモト	4,600	1,083.00	4,981,800
日本セラミック	14,400	2,032.00	29,260,800
遠藤照明	7,800	575.00	4,485,000
古河電池	10,700	567.00	6,066,900
双信電機	8,100	346.00	2,802,600
山一電機	10,400	1,563.00	16,255,200
図研	9,200	2,621.00	24,113,200
日本電子	27,600	3,430.00	94,668,000
カシオ計算機	123,300	1,695.00	208,993,500
ファナック	132,400	17,835.00	2,361,354,000
日本シイエムケイ	33,800	441.00	14,905,800
エンプラス	7,300	2,344.00	17,111,200
大真空	5,300	1,800.00	9,540,000
ローム	61,900	7,130.00	441,347,000
浜松ホトニクス	100,100	4,705.00	470,970,500
三井ハイテック	15,700	1,320.00	20,724,000
新光電気工業	47,100	1,375.00	64,762,500
京セラ	196,100	5,776.00	1,132,673,600
太陽誘電	62,100	3,140.00	194,994,000
村田製作所	409,400	6,051.00	2,477,279,400

双葉電子工業	22,500	1,016.00	22,860,000
北陸電気工業	6,100	942.00	5,746,200
ニチコン	47,900	718.00	34,392,200
日本ケミコン	10,600	1,273.00	13,493,800
K O A	21,500	948.00	20,382,000
市光工業	21,800	512.00	11,161,600
小糸製作所	83,600	4,170.00	348,612,000
ミツバ	26,600	482.00	12,821,200
S C R E E Nホールディングス	24,200	5,350.00	129,470,000
キャノン電子	14,900	1,571.00	23,407,900
キャノン	750,200	2,253.00	1,690,200,600
リコー	354,700	773.00	274,183,100
象印マホービン	41,100	1,645.00	67,609,500
M U T O Hホールディングス	2,100	1,353.00	2,841,300
東京エレクトロン	88,400	22,720.00	2,008,448,000
トヨタ紡織	40,600	1,380.00	56,028,000
芦森工業	3,000	856.00	2,568,000
ユニプレス	27,100	992.00	26,883,200
豊田自動織機	112,800	5,510.00	621,528,000
モリタホールディングス	24,400	1,657.00	40,430,800
三櫻工業	17,800	734.00	13,065,200
デンソー	306,800	3,865.00	1,185,782,000
東海理化電機製作所	36,700	1,449.00	53,178,300
三井E & Sホールディングス	50,300	635.00	31,940,500
川崎重工業	108,400	1,680.00	182,112,000
名村造船所	44,800	175.00	7,840,000
日本車輛製造	5,100	2,641.00	13,469,100
三菱ロジスネクスト	18,400	1,072.00	19,724,800
近畿車輛	2,100	1,114.00	2,339,400
日産自動車	1,643,500	380.00	624,530,000
いすゞ自動車	403,800	894.30	361,118,340
トヨタ自動車	1,554,900	6,658.00	10,352,524,200
日野自動車	174,000	683.00	118,842,000
三菱自動車工業	515,800	309.00	159,382,200
エフテック	9,900	480.00	4,752,000
レシップホールディングス	5,500	487.00	2,678,500
G M B	2,600	663.00	1,723,800
ファルテック	2,500	685.00	1,712,500
武蔵精密工業	31,100	908.00	28,238,800
日産車体	27,200	906.00	24,643,200
新明和工業	37,500	1,114.00	41,775,000
極東開発工業	25,900	1,234.00	31,960,600

日信工業	28,300	2,217.00	62,741,100
トピー工業	11,500	1,319.00	15,168,500
ティラド	5,100	1,435.00	7,318,500
曙ブレーキ工業	76,500	199.00	15,223,500
タチエス	22,900	980.00	22,442,000
N O K	75,000	1,266.00	94,950,000
フタバ産業	38,900	506.00	19,683,400
K Y B	15,600	2,229.00	34,772,400
大同メタル工業	26,900	556.00	14,956,400
プレス工業	69,300	259.00	17,948,700
ミクニ	17,900	262.00	4,689,800
太平洋工業	29,300	1,009.00	29,563,700
ケーヒン	32,000	2,550.00	81,600,000
河西工業	18,900	541.00	10,224,900
アイシン精機	114,800	3,225.00	370,230,000
マツダ	410,000	632.00	259,120,000
今仙電機製作所	13,000	785.00	10,205,000
本田技研工業	1,097,200	2,614.00	2,868,080,800
スズキ	276,200	3,603.00	995,148,600
S U B A R U	432,600	2,220.50	960,588,300
安永	6,800	1,017.00	6,915,600
ヤマハ発動機	181,700	1,442.00	262,011,400
ショーワ	33,000	2,258.00	74,514,000
T B K	16,700	457.00	7,631,900
エクセディ	19,000	1,693.00	32,167,000
豊田合成	45,000	2,116.00	95,220,000
愛三工業	21,900	565.00	12,373,500
盟和産業	2,200	944.00	2,076,800
日本プラスト	11,100	467.00	5,183,700
ヨロズ	13,100	1,167.00	15,287,700
エフ・シー・シー	22,800	1,636.00	37,300,800
シマノ	52,200	18,030.00	941,166,000
テイ・エス テック	32,400	2,934.00	95,061,600
ジャムコ	7,100	691.00	4,906,100
テルモ	394,300	3,511.00	1,384,387,300
クリエートメディック	4,600	990.00	4,554,000
日機装	41,800	857.00	35,822,600
日本エム・ディ・エム	8,000	1,617.00	12,936,000
島津製作所	166,500	2,703.00	450,049,500
J M S	11,800	836.00	9,864,800
長野計器	10,100	814.00	8,221,400
ブイ・テクノロジー	6,500	4,215.00	27,397,500

東京計器	8,900	767.00	6,826,300
愛知時計電機	1,800	4,415.00	7,947,000
インターアクション	7,500	2,439.00	18,292,500
オーバル	12,600	231.00	2,910,600
東京精密	25,300	3,560.00	90,068,000
マニー	55,500	2,462.00	136,641,000
ニコン	212,800	994.00	211,523,200
トプコン	70,200	878.00	61,635,600
オリンパス	771,100	1,668.00	1,286,194,800
理研計器	12,300	1,977.00	24,317,100
タムロン	11,200	1,851.00	20,731,200
H O Y A	278,300	9,732.00	2,708,415,600
シード	6,000	810.00	4,860,000
ノーリツ鋼機	9,400	1,248.00	11,731,200
エー・アンド・デイ	12,700	785.00	9,969,500
朝日インテック	157,800	2,797.00	441,366,600
シチズン時計	163,300	386.00	63,033,800
リズム時計工業	4,400	630.00	2,772,000
大研医器	9,700	656.00	6,363,200
メニコン	19,700	4,495.00	88,551,500
シンシア	1,600	361.00	577,600
松風	6,300	1,619.00	10,199,700
セイコーホールディングス	19,700	1,874.00	36,917,800
ニプロ	96,500	1,229.00	118,598,500
中本パックス	3,500	1,485.00	5,197,500
スノーピーク	7,400	916.00	6,778,400
パラマウントベッドホールディングス	14,700	4,510.00	66,297,000
トランザクション	7,600	981.00	7,455,600
粧美堂	4,100	366.00	1,500,600
ニホンフラッシュ	13,000	1,243.00	16,159,000
前田工織	15,400	2,071.00	31,893,400
永大産業	18,200	283.00	5,150,600
アートネイチャー	14,900	693.00	10,325,700
バンダイナムコホールディングス	144,100	5,483.00	790,100,300
アイフィスジャパン	3,500	715.00	2,502,500
共立印刷	23,200	145.00	3,364,000
S H O E I	12,200	2,364.00	28,840,800
フランスベッドホールディングス	19,700	890.00	17,533,000
パイロットコーポレーション	22,700	3,700.00	83,990,000
萩原工業	7,700	1,334.00	10,271,800
トッパン・フォームズ	29,900	963.00	28,793,700
フジシールインターナショナル	31,200	1,870.00	58,344,000



タカラトミー	62,500	919.00	57,437,500
廣濟堂	9,700	800.00	7,760,000
エステールホールディングス	3,700	611.00	2,260,700
アーク	53,200	90.00	4,788,000
タカノ	5,400	713.00	3,850,200
プロネクサス	12,000	1,114.00	13,368,000
ホクシン	8,600	117.00	1,006,200
ウッドワン	4,700	1,069.00	5,024,300
大建工業	9,400	1,630.00	15,322,000
凸版印刷	196,700	1,554.00	305,671,800
大日本印刷	182,400	2,207.00	402,556,800
共同印刷	4,300	2,835.00	12,190,500
N I S S H A	28,600	821.00	23,480,600
光村印刷	1,200	1,601.00	1,921,200
TAKARA & COMPANY	6,700	1,871.00	12,535,700
アシックス	115,000	1,063.00	122,245,000
ツツミ	4,300	1,622.00	6,974,600
小松ウオール工業	4,200	1,884.00	7,912,800
ヤマハ	82,900	4,470.00	370,563,000
河合楽器製作所	4,300	3,065.00	13,179,500
クリナップ	13,000	529.00	6,877,000
ピジョン	84,200	4,095.00	344,799,000
オリバー	2,900	2,750.00	7,975,000
兼松サステック	900	1,514.00	1,362,600
キングジム	11,600	900.00	10,440,000
リンテック	33,100	2,409.00	79,737,900
イトーキ	29,600	345.00	10,212,000
任天堂	85,400	43,640.00	3,726,856,000
三菱鉛筆	22,900	1,413.00	32,357,700
タカラスタANDARD	28,800	1,591.00	45,820,800
コクヨ	66,800	1,349.00	90,113,200
ナカバヤシ	13,700	547.00	7,493,900
グローブライド	6,200	2,189.00	13,571,800
オカムラ	48,600	810.00	39,366,000
美津濃	12,600	1,926.00	24,267,600
東京電力ホールディングス	1,112,400	367.00	408,250,800
中部電力	426,300	1,432.00	610,461,600
関西電力	528,000	1,052.00	555,456,000
中国電力	201,000	1,438.00	289,038,000
北陸電力	127,400	727.00	92,619,800
東北電力	348,100	1,045.00	363,764,500
四国電力	125,500	809.00	101,529,500

九州電力	287,200	866.00	248,715,200	
北海道電力	130,400	419.00	54,637,600	
沖縄電力	25,800	2,087.00	53,844,600	
電源開発	110,900	2,002.00	222,021,800	
エフオン	7,500	539.00	4,042,500	
イーレックス	19,900	1,525.00	30,347,500	
レノバ	23,300	858.00	19,991,400	
東京瓦斯	268,000	2,515.50	674,154,000	
大阪瓦斯	270,400	2,043.00	552,427,200	
東邦瓦斯	68,500	5,550.00	380,175,000	
北海道瓦斯	7,500	1,570.00	11,775,000	
広島ガス	28,700	359.00	10,303,300	
西部瓦斯	15,700	2,627.00	41,243,900	
静岡ガス	39,600	956.00	37,857,600	
メタウォーター	6,700	4,335.00	29,044,500	
SBSホールディングス	12,000	1,913.00	22,956,000	
東武鉄道	145,200	3,675.00	533,610,000	
相鉄ホールディングス	44,600	2,838.00	126,574,800	
東急	351,500	1,666.00	585,599,000	
京浜急行電鉄	179,000	1,825.00	326,675,000	
小田急電鉄	207,300	2,397.00	496,898,100	
京王電鉄	72,300	5,830.00	421,509,000	
京成電鉄	97,000	3,180.00	308,460,000	
富士急行	19,000	3,270.00	62,130,000	
新京成電鉄	3,600	2,142.00	7,711,200	
東日本旅客鉄道	245,300	8,208.00	2,013,422,400	
西日本旅客鉄道	124,200	6,725.00	835,245,000	
東海旅客鉄道	115,900	17,920.00	2,076,928,000	
西武ホールディングス	187,000	1,321.00	247,027,000	
鴻池運輸	22,200	1,177.00	26,129,400	
西日本鉄道	38,600	2,665.00	102,869,000	
ハマキョウレックス	10,700	3,160.00	33,812,000	
サカイ引越センター	7,300	5,600.00	40,880,000	
近鉄グループホールディングス	132,000	5,300.00	699,600,000	
阪急阪神ホールディングス	176,000	3,915.00	689,040,000	
南海電気鉄道	62,600	2,507.00	156,938,200	
京阪ホールディングス	58,800	4,830.00	284,004,000	
神戸電鉄	3,100	3,835.00	11,888,500	
名古屋鉄道	108,500	3,155.00	342,317,500	
山陽電気鉄道	9,400	2,163.00	20,332,200	
日本通運	45,700	5,240.00	239,468,000	
ヤマトホールディングス	231,400	1,922.00	444,750,800	

山九	36,700	4,190.00	153,773,000	
丸運	7,500	227.00	1,702,500	
丸全昭和運輸	10,700	2,478.00	26,514,600	
センコーグループホールディングス	72,700	887.00	64,484,900	
トナミホールディングス	3,200	5,140.00	16,448,000	
ニッコンホールディングス	47,200	2,126.00	100,347,200	
日本石油輸送	1,400	3,105.00	4,347,000	
福山通運	16,900	3,770.00	63,713,000	
セイノーホールディングス	98,800	1,310.00	129,428,000	
エスライン	4,000	995.00	3,980,000	
神奈川中央交通	3,300	4,085.00	13,480,500	
日立物流	24,200	2,696.00	65,243,200	
丸和運輸機関	13,900	3,310.00	46,009,000	
C & F ロジホールディングス	13,300	1,396.00	18,566,800	
九州旅客鉄道	115,700	2,985.00	345,364,500	
S Gホールディングス	138,500	3,045.00	421,732,500	
日本郵船	111,100	1,448.00	160,872,800	
商船三井	84,000	1,920.00	161,280,000	
川崎汽船	40,600	1,121.00	45,512,600	
N S ユナイテッド海運	7,900	1,496.00	11,818,400	
飯野海運	65,500	325.00	21,287,500	
共栄タンカー	3,400	896.00	3,046,400	
乾汽船	7,600	1,194.00	9,074,400	
日本航空	233,400	1,967.00	459,097,800	
A N Aホールディングス	241,200	2,418.00	583,221,600	
パスコ	2,600	1,566.00	4,071,600	
トランコム	3,700	6,620.00	24,494,000	
日新	11,400	1,626.00	18,536,400	
三菱倉庫	41,900	2,485.00	104,121,500	
三井倉庫ホールディングス	15,100	1,460.00	22,046,000	
住友倉庫	47,500	1,275.00	60,562,500	
澁澤倉庫	7,200	2,216.00	15,955,200	
東陽倉庫	23,800	340.00	8,092,000	
日本トランスシティ	29,000	489.00	14,181,000	
ケイヒン	2,500	1,275.00	3,187,500	
中央倉庫	8,000	1,056.00	8,448,000	
川西倉庫	2,400	1,025.00	2,460,000	
安田倉庫	10,800	858.00	9,266,400	
ファイズホールディングス	2,800	1,104.00	3,091,200	
東洋埠頭	4,000	1,294.00	5,176,000	
宇徳	11,300	462.00	5,220,600	
上組	73,600	1,973.00	145,212,800	

サンリツ	3,100	560.00	1,736,000
キムラユニティー	3,500	1,004.00	3,514,000
キューソー流通システム	3,300	1,754.00	5,788,200
近鉄エクスプレス	28,000	1,546.00	43,288,000
東海運	7,500	257.00	1,927,500
エーアイティー	9,300	752.00	6,993,600
内外トランスライン	4,600	1,131.00	5,202,600
日本コンセプト	4,200	1,441.00	6,052,200
N E C ネットズエスアイ	13,000	4,785.00	62,205,000
クロスキャット	3,800	1,050.00	3,990,000
システナ	48,900	1,604.00	78,435,600
デジタルアーツ	6,800	7,430.00	50,524,000
日鉄ソリューションズ	20,600	2,725.00	56,135,000
キューブシステム	7,600	740.00	5,624,000
エイジア	2,700	1,374.00	3,709,800
コア	6,000	1,176.00	7,056,000
ラクーンホールディングス	6,500	685.00	4,452,500
ソリトンシステムズ	6,200	1,312.00	8,134,400
ソフトクリエイイトホールディングス	6,100	1,850.00	11,285,000
T I S	136,900	2,123.00	290,638,700
ネオス	5,500	668.00	3,674,000
電算システム	5,300	3,215.00	17,039,500
グリー	84,500	439.00	37,095,500
コーエーテクモホールディングス	28,100	2,975.00	83,597,500
三菱総合研究所	5,900	4,115.00	24,278,500
電算	1,600	2,052.00	3,283,200
A G S	8,100	752.00	6,091,200
ファインデックス	11,800	901.00	10,631,800
ブレインパッド	3,600	5,650.00	20,340,000
K L a b	26,500	743.00	19,689,500
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	16,800	943.00	15,842,400
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	2,151.00	4,517,100
ネクソン	381,500	1,694.00	646,261,000
アイスタイル	39,200	310.00	12,152,000
エムアップホールディングス	4,000	2,585.00	10,340,000
エイチーム	9,800	780.00	7,644,000
エニグモ	13,200	911.00	12,025,200
テクノスジャパン	11,200	500.00	5,600,000
コロプラ	45,100	935.00	42,168,500
ブロードリーフ	68,300	539.00	36,813,700
クロス・マーケティンググループ	7,000	310.00	2,170,000
デジタルハーツホールディングス	7,600	765.00	5,814,000

システム情報	10,500	903.00	9,481,500
メディアドゥホールディングス	4,400	3,910.00	17,204,000
じげん	34,600	357.00	12,352,200
エンカレッジ・テクノロジー	3,300	889.00	2,933,700
サイバーリンクス	2,300	1,298.00	2,985,400
フィックスターズ	14,800	1,300.00	19,240,000
CARTA HOLDINGS	6,900	875.00	6,037,500
オブティム	7,300	2,152.00	15,709,600
セレス	4,800	875.00	4,200,000
SHIFT	5,500	8,360.00	45,980,000
ティーガイア	12,300	2,208.00	27,158,400
セック	2,100	3,715.00	7,801,500
日本アジアグループ	14,400	250.00	3,600,000
テクマトリックス	9,700	2,732.00	26,500,400
プロシップ	4,200	1,243.00	5,220,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	33,100	1,699.00	56,236,900
GMOペイメントゲートウェイ	29,000	10,150.00	294,350,000
ザッパラス	6,700	346.00	2,318,200
システムリサーチ	3,800	1,770.00	6,726,000
インターネットイニシアティブ	20,300	3,805.00	77,241,500
さくらインターネット	15,100	588.00	8,878,800
ヴィンクス	4,100	1,107.00	4,538,700
GMOクラウド	2,600	3,305.00	8,593,000
SRAホールディングス	7,400	2,231.00	16,509,400
システムインテグレータ	4,700	746.00	3,506,200
朝日ネット	9,900	969.00	9,593,100
eBASE	16,600	1,056.00	17,529,600
アバント	13,300	996.00	13,246,800
アドソル日進	4,900	2,570.00	12,593,000
フリービット	7,400	834.00	6,171,600
コムチュア	15,500	2,223.00	34,456,500
サイバーコム	2,600	1,915.00	4,979,000
アステリア	8,900	458.00	4,076,200
アイル	7,700	1,711.00	13,174,700
マークライنز	7,000	1,787.00	12,509,000
メディカル・データ・ビジョン	10,700	832.00	8,902,400
ショーケース	3,700	542.00	2,005,400
モバイルファクトリー	3,300	1,116.00	3,682,800
テラスカイ	5,000	2,617.00	13,085,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,600	1,395.00	7,812,000
PCIホールディングス	5,500	913.00	5,021,500
パイブドHD	1,900	1,567.00	2,977,300

アイピーシー	2,500	986.00	2,465,000
ネオジャパン	2,800	1,256.00	3,516,800
P R T I M E S	1,300	2,360.00	3,068,000
ランドコンピュータ	2,300	1,100.00	2,530,000
ダブルスタンダード	1,800	4,250.00	7,650,000
オープンドア	7,000	1,166.00	8,162,000
マイネット	4,400	910.00	4,004,000
アカツキ	4,900	4,300.00	21,070,000
ベネフィットジャパン	1,200	1,641.00	1,969,200
U b i c o mホールディングス	3,200	1,342.00	4,294,400
L I N E	31,300	5,310.00	166,203,000
カナミックネットワーク	12,900	744.00	9,597,600
ノムラシステムコーポレーション	3,700	394.00	1,457,800
チェンジ	4,800	4,260.00	20,448,000
シンクロ・フード	6,800	314.00	2,135,200
オークネット	8,700	1,090.00	9,483,000
セグエグループ	3,300	892.00	2,943,600
エイトレッド	2,400	1,929.00	4,629,600
A O I T Y O H o l d i n g s	14,400	466.00	6,710,400
マクロミル	28,300	723.00	20,460,900
ビーグリー	2,800	1,473.00	4,124,400
オロ	3,700	3,255.00	12,043,500
ユーザーローカル	1,400	3,030.00	4,242,000
テモナ	3,300	729.00	2,405,700
ニーズウェル	3,000	668.00	2,004,000
サインポスト	3,000	1,490.00	4,470,000
ソルクシーズ	6,200	678.00	4,203,600
フェイス	5,200	635.00	3,302,000
プロトコーポレーション	12,500	971.00	12,137,500
ハイマックス	1,700	1,953.00	3,320,100
野村総合研究所	193,900	2,557.00	495,802,300
サイバネットシステム	10,100	679.00	6,857,900
C Eホールディングス	7,800	418.00	3,260,400
日本システム技術	2,400	1,270.00	3,048,000
インテージホールディングス	17,400	810.00	14,094,000
東邦システムサイエンス	3,900	924.00	3,603,600
ソースネクスト	65,700	339.00	22,272,300
インフォコム	15,100	2,583.00	39,003,300
H E R O Z	2,000	3,735.00	7,470,000
ラクスル	11,000	2,725.00	29,975,000
F I G	15,800	263.00	4,155,400
システムサポート	1,600	2,990.00	4,784,000

イーソル	6,700	1,303.00	8,730,100
アルテリア・ネットワークス	15,300	2,138.00	32,711,400
東海ソフト	1,200	1,266.00	1,519,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,014.00	2,636,400
フォーカスシステムズ	8,800	801.00	7,048,800
クレスコ	8,500	1,480.00	12,580,000
フジ・メディア・ホールディングス	132,000	1,112.00	146,784,000
オービック	47,400	16,870.00	799,638,000
ジャストシステム	22,300	6,870.00	153,201,000
TDCソフト	12,300	860.00	10,578,000
Zホールディングス	1,878,400	437.00	820,860,800
トレンドマイクロ	60,800	5,370.00	326,496,000
IDホールディングス	5,400	1,520.00	8,208,000
日本オラクル	27,700	12,030.00	333,231,000
アルファシステムズ	4,300	3,505.00	15,071,500
フューチャー	16,600	1,632.00	27,091,200
CAC Holdings	9,100	1,187.00	10,801,700
SBテクノロジー	5,000	2,620.00	13,100,000
トーセ	4,000	781.00	3,124,000
オービックビジネスコンサルタント	14,000	5,050.00	70,700,000
伊藤忠テクノソリューションズ	62,400	3,350.00	209,040,000
アイティフォー	16,900	708.00	11,965,200
東計電算	2,100	3,895.00	8,179,500
エクスネット	2,400	981.00	2,354,400
大塚商会	74,000	4,780.00	353,720,000
サイボウズ	16,100	2,164.00	34,840,400
ソフトブレーン	8,600	464.00	3,990,400
電通国際情報サービス	8,500	4,515.00	38,377,500
ACCESS	13,100	885.00	11,593,500
デジタルガレージ	24,700	3,995.00	98,676,500
EMシステムズ	19,600	798.00	15,640,800
ウェザーニューズ	4,700	3,875.00	18,212,500
CIJ	9,600	808.00	7,756,800
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,566.00	4,362,200
日本エンタープライズ	15,000	235.00	3,525,000
WOWOW	6,700	2,533.00	16,971,100
スカラ	9,600	562.00	5,395,200
インテリジェント ウェイブ	8,400	619.00	5,199,600
IMAGICA GROUP	12,300	386.00	4,747,800
ネットワンシステムズ	52,200	3,130.00	163,386,000
システムソフト	33,000	75.00	2,475,000
アルゴグラフィックス	11,700	3,480.00	40,716,000

マーベラス	21,300	582.00	12,396,600
エイベックス	23,800	901.00	21,443,800
日本ユニシス	42,800	3,165.00	135,462,000
兼松エレクトロニクス	7,500	3,770.00	28,275,000
東京放送ホールディングス	83,300	1,677.00	139,694,100
日本テレビホールディングス	114,400	1,215.00	138,996,000
朝日放送グループホールディングス	14,000	713.00	9,982,000
テレビ朝日ホールディングス	37,700	1,637.00	61,714,900
スカパーJ S A Tホールディングス	90,600	411.00	37,236,600
テレビ東京ホールディングス	11,300	2,416.00	27,300,800
日本BS放送	4,900	1,057.00	5,179,300
ビジョン	13,100	854.00	11,187,400
スマートバリュー	3,900	835.00	3,256,500
ワイヤレスゲート	6,900	571.00	3,939,900
コネクシオ	7,900	1,555.00	12,284,500
クロップス	2,900	711.00	2,061,900
日本電信電話	1,828,000	2,419.50	4,422,846,000
K D D I	1,019,100	3,158.00	3,218,317,800
ソフトバンク	1,242,900	1,470.00	1,827,063,000
光通信	14,100	22,440.00	316,404,000
N T T ドコモ	1,010,200	3,079.00	3,110,405,800
エムティーアイ	13,700	576.00	7,891,200
G M O インターネット	54,000	2,334.00	126,036,000
ファイバーゲート	4,600	1,410.00	6,486,000
アйдママーケティングコミュニケーション	4,700	447.00	2,100,900
K A D O K A W A	37,000	1,656.00	61,272,000
学研ホールディングス	18,500	1,769.00	32,726,500
ゼンリン	27,500	1,332.00	36,630,000
昭文社ホールディングス	7,000	393.00	2,751,000
インプレスホールディングス	11,300	164.00	1,853,200
アイネット	7,200	1,553.00	11,181,600
松竹	9,100	12,800.00	116,480,000
東宝	80,800	3,695.00	298,556,000
東映	5,100	14,120.00	72,012,000
エヌ・ティ・ティ・データ	364,300	1,164.00	424,045,200
ピー・シー・エー	2,400	3,815.00	9,156,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,763.00	6,631,200
D T S	30,700	2,168.00	66,557,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58,400	4,675.00	273,020,000
シーイーシー	14,800	1,702.00	25,189,600
カブコン	64,500	3,585.00	231,232,500
アイ・エス・ビー	2,800	1,741.00	4,874,800



ジャステック	8,900	1,164.00	10,359,600
S C S K	31,600	4,845.00	153,102,000
日本システムウエア	4,600	2,181.00	10,032,600
アイネス	13,600	1,389.00	18,890,400
T K C	11,600	5,150.00	59,740,000
富士ソフト	17,600	3,920.00	68,992,000
N S D	44,100	1,617.00	71,309,700
コナミホールディングス	49,700	3,500.00	173,950,000
福井コンピュータホールディングス	5,500	2,930.00	16,115,000
J B C Cホールディングス	9,400	2,055.00	19,317,000
ミロク情報サービス	12,100	2,689.00	32,536,900
ソフトバンクグループ	1,085,000	4,685.00	5,083,225,000
ハウスイ	1,100	913.00	1,004,300
高千穂交易	5,300	940.00	4,982,000
カワニシホールディングス	1,600	1,269.00	2,030,400
伊藤忠食品	3,400	4,625.00	15,725,000
エレマテック	12,800	828.00	10,598,400
J A L U X	3,900	1,650.00	6,435,000
あらた	10,900	4,675.00	50,957,500
トーメンデバイス	2,100	3,810.00	8,001,000
東京エレクトロン デバイス	5,000	2,840.00	14,200,000
フィールズ	10,500	348.00	3,654,000
双日	758,000	250.00	189,500,000
アルフレッサ ホールディングス	152,500	2,092.00	319,030,000
横浜冷凍	35,900	893.00	32,058,700
ラサ商事	7,300	842.00	6,146,600
アルコニックス	14,600	1,184.00	17,286,400
神戸物産	47,400	5,160.00	244,584,000
ハイパー	2,100	596.00	1,251,600
あい ホールディングス	19,600	1,418.00	27,792,800
ディーブイエックス	4,900	915.00	4,483,500
ダイワボウホールディングス	11,700	7,080.00	82,836,000
マクニカ・富士エレホールディングス	32,700	1,589.00	51,960,300
ラクト・ジャパン	5,100	3,760.00	19,176,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,900	1,088.00	28,179,200
八洲電機	10,600	857.00	9,084,200
メディアスホールディングス	7,800	920.00	7,176,000
レスターホールディングス	14,300	1,806.00	25,825,800
ジュテックホールディングス	3,200	1,000.00	3,200,000
大光	5,900	701.00	4,135,900
O C H Iホールディングス	4,000	1,387.00	5,548,000
T O K A Iホールディングス	72,500	958.00	69,455,000

黒谷	3,800	439.00	1,668,200
C o m i n i x	2,400	744.00	1,785,600
三洋貿易	13,800	918.00	12,668,400
ビューティガレージ	2,200	1,712.00	3,766,400
ウイン・パートナーズ	9,900	917.00	9,078,300
ミタチ産業	4,100	618.00	2,533,800
シップヘルスケアホールディングス	22,000	4,770.00	104,940,000
明治電機工業	4,300	1,291.00	5,551,300
デリカフーズホールディングス	4,900	623.00	3,052,700
スターティアホールディングス	3,100	591.00	1,832,100
コメダホールディングス	29,900	1,811.00	54,148,900
ピーバンドットコム	1,400	967.00	1,353,800
アセンテック	1,500	3,000.00	4,500,000
富士興産	4,200	413.00	1,734,600
協栄産業	1,500	1,146.00	1,719,000
小野建	12,300	1,187.00	14,600,100
南陽	3,000	1,451.00	4,353,000
佐島電機	9,300	841.00	7,821,300
エコートレーディング	3,200	508.00	1,625,600
伯東	8,400	984.00	8,265,600
コンドーテック	10,600	977.00	10,356,200
中山福	7,900	473.00	3,736,700
ナガイレーベン	18,200	2,556.00	46,519,200
三菱食品	15,100	2,575.00	38,882,500
松田産業	10,000	1,393.00	13,930,000
第一興商	20,400	3,585.00	73,134,000
メディバルホールディングス	148,100	2,094.00	310,121,400
S P K	5,900	1,329.00	7,841,100
萩原電気ホールディングス	5,100	2,197.00	11,204,700
アズワン	9,000	9,980.00	89,820,000
スズデン	4,800	1,199.00	5,755,200
尾家産業	4,000	1,440.00	5,760,000
シモジマ	8,400	1,216.00	10,214,400
ドウシシャ	13,000	1,518.00	19,734,000
小津産業	3,000	1,944.00	5,832,000
高速	8,200	1,444.00	11,840,800
たけびし	4,800	1,399.00	6,715,200
リックス	3,100	1,488.00	4,612,800
丸文	12,200	519.00	6,331,800
ハピネット	11,500	1,098.00	12,627,000
橋本総業ホールディングス	2,800	1,848.00	5,174,400
日本ライフライン	40,700	1,304.00	53,072,800

タカショー	8,900	474.00	4,218,600
マルカ	4,900	1,858.00	9,104,200
I D O M	37,100	471.00	17,474,100
進和	8,100	1,757.00	14,231,700
エスケイジャパン	3,000	311.00	933,000
ダイترون	5,800	1,608.00	9,326,400
シークス	17,500	975.00	17,062,500
田中商事	4,200	703.00	2,952,600
オーハシテクニカ	7,700	1,480.00	11,396,000
白銅	4,900	1,333.00	6,531,700
伊藤忠商事	960,000	2,235.00	2,145,600,000
丸紅	1,428,600	497.50	710,728,500
高島	2,200	1,566.00	3,445,200
長瀬産業	77,200	1,317.00	101,672,400
蝶理	8,800	1,729.00	15,215,200
豊田通商	153,200	2,600.00	398,320,000
三共生興	20,800	473.00	9,838,400
兼松	51,200	1,190.00	60,928,000
ツカモトコーポレーション	2,500	1,113.00	2,782,500
三井物産	1,206,400	1,639.00	1,977,289,600
日本紙パルプ商事	7,800	3,680.00	28,704,000
カメイ	17,900	1,065.00	19,063,500
東都水産	1,800	2,937.00	5,286,600
O U Gホールディングス	2,200	2,700.00	5,940,000
スターゼン	5,100	4,390.00	22,389,000
山善	53,600	938.00	50,276,800
椿本興業	2,500	3,320.00	8,300,000
住友商事	866,000	1,326.50	1,148,749,000
内田洋行	5,400	5,780.00	31,212,000
三菱商事	963,100	2,417.00	2,327,812,700
第一実業	6,700	3,650.00	24,455,000
キャノンマーケティングジャパン	34,000	2,147.00	72,998,000
西華産業	7,800	1,153.00	8,993,400
佐藤商事	11,300	885.00	10,000,500
菱洋エレクトロ	13,900	2,467.00	34,291,300
東京産業	12,500	510.00	6,375,000
ユアサ商事	13,000	3,020.00	39,260,000
神鋼商事	3,500	1,828.00	6,398,000
トルク	8,300	287.00	2,382,100
阪和興業	25,700	1,793.00	46,080,100
正栄食品工業	8,900	3,875.00	34,487,500
カナデン	11,200	1,260.00	14,112,000

菱電商事	9,900	1,400.00	13,860,000
フルサト工業	7,600	1,400.00	10,640,000
岩谷産業	30,500	3,735.00	113,917,500
ナイス	5,800	817.00	4,738,600
昭光通商	4,400	590.00	2,596,000
ニチモウ	2,100	1,774.00	3,725,400
極東貿易	4,000	1,415.00	5,660,000
イワキ	18,000	450.00	8,100,000
三愛石油	33,800	1,139.00	38,498,200
稲畑産業	30,200	1,205.00	36,391,000
G S Iクレオス	3,400	1,070.00	3,638,000
明和産業	12,700	512.00	6,502,400
クワザワ	4,900	520.00	2,548,000
ヤマエ久野	10,000	1,310.00	13,100,000
ワキタ	29,300	990.00	29,007,000
東邦ホールディングス	44,000	2,198.00	96,712,000
サンゲツ	37,400	1,588.00	59,391,200
ミツウロコグループホールディングス	20,200	1,173.00	23,694,600
シナネンホールディングス	5,700	2,750.00	15,675,000
伊藤忠エネクス	30,400	814.00	24,745,600
サンリオ	38,600	1,770.00	68,322,000
サンワテクノス	9,700	811.00	7,866,700
リョーサン	15,200	2,444.00	37,148,800
新光商事	21,500	888.00	19,092,000
トーホー	6,200	1,805.00	11,191,000
三信電気	7,400	1,566.00	11,588,400
東陽テクニカ	14,700	1,055.00	15,508,500
モスフードサービス	18,000	2,844.00	51,192,000
加賀電子	13,700	2,054.00	28,139,800
ソーダニッカ	14,200	616.00	8,747,200
立花エレテック	10,200	1,568.00	15,993,600
フォーバル	6,000	1,170.00	7,020,000
P A L T A C	22,000	5,300.00	116,600,000
三谷産業	18,100	409.00	7,402,900
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,500	2,100.00	5,250,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,955.00	2,346,000
国際紙パルプ商事	32,600	316.00	10,301,600
ヤマタネ	6,900	1,249.00	8,618,100
丸紅建材リース	1,400	1,445.00	2,023,000
日鉄物産	9,800	3,425.00	33,565,000
泉州電業	4,200	2,536.00	10,651,200
トラスコ中山	28,600	2,475.00	70,785,000

オートボックスセブン	50,900	1,321.00	67,238,900
モリト	10,000	676.00	6,760,000
加藤産業	19,800	3,635.00	71,973,000
北恵	3,500	861.00	3,013,500
イノテック	7,100	969.00	6,879,900
イエローハット	25,900	1,494.00	38,694,600
J Kホールディングス	12,400	755.00	9,362,000
日伝	12,400	2,055.00	25,482,000
北沢産業	10,400	279.00	2,901,600
杉本商事	7,400	1,780.00	13,172,000
因幡電機産業	39,100	2,287.00	89,421,700
東テク	4,600	2,200.00	10,120,000
ミスミグループ本社	172,000	2,640.00	454,080,000
アルテック	11,000	205.00	2,255,000
タキヒヨー	4,200	1,707.00	7,169,400
蔵王産業	2,700	1,435.00	3,874,500
スズケン	58,100	3,975.00	230,947,500
ジェコス	9,500	904.00	8,588,000
グローセル	13,800	428.00	5,906,400
ローソン	34,700	5,570.00	193,279,000
サンエー	11,500	4,160.00	47,840,000
カワチ薬品	10,700	2,404.00	25,722,800
エービーシー・マート	21,500	5,930.00	127,495,000
ハードオフコーポレーション	5,700	679.00	3,870,300
アスクル	14,400	3,420.00	49,248,000
ゲオホールディングス	24,800	1,367.00	33,901,600
アダストリア	19,100	1,709.00	32,641,900
ジーフット	8,300	473.00	3,925,900
くら寿司	7,200	4,760.00	34,272,000
キャンドウ	6,600	1,896.00	12,513,600
パルグループホールディングス	14,200	1,360.00	19,312,000
エディオン	63,200	976.00	61,683,200
サーラコーポレーション	28,200	564.00	15,904,800
ワッツ	6,300	683.00	4,302,900
ハローズ	5,200	2,890.00	15,028,000
フジオフードシステム	11,700	1,460.00	17,082,000
あみやき亭	3,000	3,085.00	9,255,000
ひらまつ	25,200	164.00	4,132,800
大黒天物産	3,300	4,090.00	13,497,000
ハニーズホールディングス	12,200	1,218.00	14,859,600
ファーマライズホールディングス	3,600	669.00	2,408,400
アルペン	10,600	1,657.00	17,564,200

ハブ	4,200	693.00	2,910,600
クオールホールディングス	20,400	1,205.00	24,582,000
ジーンズホールディングス	7,300	6,340.00	46,282,000
ビックカメラ	81,600	1,045.00	85,272,000
D C Mホールディングス	76,200	1,096.00	83,515,200
MonotaRO	97,600	3,670.00	358,192,000
東京一番フーズ	3,900	476.00	1,856,400
D Dホールディングス	5,400	985.00	5,319,000
きちりホールディングス	4,000	609.00	2,436,000
アークランドサービスホールディングス	10,100	1,847.00	18,654,700
J . フロント リテイリング	164,100	943.00	154,746,300
ドトール・日レスホールディングス	22,000	1,777.00	39,094,000
マツモトキヨシホールディングス	56,800	3,610.00	205,048,000
ブロンコビリー	7,300	2,209.00	16,125,700
Z O Z O	94,500	1,950.00	184,275,000
トレジャー・ファクトリー	4,300	715.00	3,074,500
物語コーポレーション	3,700	7,720.00	28,564,000
ココカラファイン	14,400	4,950.00	71,280,000
三越伊勢丹ホールディングス	240,200	690.00	165,738,000
H a m e e	5,000	1,404.00	7,020,000
ウエルシアホールディングス	40,800	7,500.00	306,000,000
クリエイトSDホールディングス	23,200	3,075.00	71,340,000
丸善C H Iホールディングス	16,000	381.00	6,096,000
ティーライフ	2,200	942.00	2,072,400
チムニー	4,300	1,837.00	7,899,100
シュッピン	9,600	829.00	7,958,400
ネクステージ	19,900	831.00	16,536,900
ジョイフル本田	40,300	1,282.00	51,664,600
鳥貴族	4,100	1,859.00	7,621,900
麒麟堂ホールディングス	5,500	2,024.00	11,132,000
ホットランド	9,300	1,182.00	10,992,600
すかいらーくホールディングス	153,900	1,778.00	273,634,200
S F Pホールディングス	7,900	1,584.00	12,513,600
綿半ホールディングス	5,200	1,823.00	9,479,600
ヨシックス	2,300	2,113.00	4,859,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	40,100	1,011.00	40,541,100
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	512.00	3,430,400
B E E N O S	6,500	1,030.00	6,695,000
あさひ	10,400	1,369.00	14,237,600
日本調剤	8,400	1,680.00	14,112,000
コスモス薬品	6,100	28,020.00	170,922,000
トーエル	6,900	707.00	4,878,300

オンリー	2,700	584.00	1,576,800	
セブン&アイ・ホールディングス	537,000	3,457.00	1,856,409,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	74,100	755.00	55,945,500	
ツルハホールディングス	29,900	13,890.00	415,311,000	
サンマルクホールディングス	10,900	1,905.00	20,764,500	
フェリシモ	3,200	980.00	3,136,000	
トリドールホールディングス	34,100	1,369.00	46,682,900	
TOKYO BASE	13,000	378.00	4,914,000	
ウイルプラスホールディングス	2,000	695.00	1,390,000	
JMホールディングス	10,500	2,443.00	25,651,500	
サツドラホールディングス	2,100	2,035.00	4,273,500	
アレンザホールディングス	7,100	886.00	6,290,600	
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,749.00	5,072,100	
パロックジャパンリミテッド	9,800	625.00	6,125,000	
クスリのアオキホールディングス	12,300	8,140.00	100,122,000	
力の源ホールディングス	6,500	705.00	4,582,500	
スシローグローバルホールディングス	75,400	2,030.00	153,062,000	
LIXILビバ	13,600	2,047.00	27,839,200	
メディカルシステムネットワーク	13,600	470.00	6,392,000	
はるやまホールディングス	6,700	777.00	5,205,900	
ノジマ	24,500	1,938.00	47,481,000	
カッパ・クリエイト	19,200	1,412.00	27,110,400	
ライトオン	10,300	532.00	5,479,600	
良品計画	182,400	1,429.00	260,649,600	
三城ホールディングス	15,300	270.00	4,131,000	
アドヴァン	21,100	1,102.00	23,252,200	
アルビス	5,300	2,065.00	10,944,500	
コナカ	16,700	336.00	5,611,200	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,572.00	2,829,600	
G-7ホールディングス	8,200	2,416.00	19,811,200	
イオン北海道	18,300	789.00	14,438,700	
コジマ	24,000	422.00	10,128,000	
ヒマラヤ	5,000	782.00	3,910,000	
コーナン商事	19,600	2,694.00	52,802,400	
エコス	5,100	1,896.00	9,669,600	
ワタミ	16,400	1,147.00	18,810,800	
マルシェ	3,900	622.00	2,425,800	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	301,700	2,034.00	613,657,800	
西松屋チェーン	30,300	867.00	26,270,100	
ゼンショーホールディングス	65,800	2,307.00	151,800,600	
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,626.00	14,308,800	

ハークスレイ	3,000	1,028.00	3,084,000
サイゼリヤ	20,400	2,375.00	48,450,000
V Tホールディングス	57,400	306.00	17,564,400
魚力	3,900	1,509.00	5,885,100
フジ・コーポレーション	3,700	1,873.00	6,930,100
ユナイテッドアローズ	14,500	1,789.00	25,940,500
ハイデイ日高	19,900	1,812.00	36,058,800
京都きもの友禅	9,500	233.00	2,213,500
コロワイド	45,600	1,650.00	75,240,000
ピーシーデポコーポレーション	18,500	572.00	10,582,000
壱番屋	9,700	4,800.00	46,560,000
P L A N T	3,800	605.00	2,299,000
スギホールディングス	27,400	6,270.00	171,798,000
薬王堂ホールディングス	6,000	2,648.00	15,888,000
スクロール	21,700	350.00	7,595,000
ヨンドシーホールディングス	14,100	1,716.00	24,195,600
ファミリーマート	109,700	1,861.00	204,151,700
木曽路	18,000	2,394.00	43,092,000
S R Sホールディングス	16,400	927.00	15,202,800
タカキュー	12,000	133.00	1,596,000
ケーヨー	28,400	588.00	16,699,200
上新電機	16,200	2,196.00	35,575,200
日本瓦斯	21,700	3,815.00	82,785,500
ロイヤルホールディングス	24,100	1,947.00	46,922,700
いなげや	17,100	1,649.00	28,197,900
島忠	25,900	2,819.00	73,012,100
チヨダ	14,600	1,081.00	15,782,600
ライフコーポレーション	10,500	3,040.00	31,920,000
リンガーハット	17,000	2,322.00	39,474,000
M r M a x H D	19,300	431.00	8,318,300
テンアライド	12,600	385.00	4,851,000
A O K Iホールディングス	27,700	692.00	19,168,400
オークワ	21,600	1,368.00	29,548,800
コメリ	21,300	2,304.00	49,075,200
青山商事	28,600	946.00	27,055,600
しまむら	16,000	7,100.00	113,600,000
はせがわ	7,700	406.00	3,126,200
高島屋	100,100	1,014.00	101,501,400
松屋	27,900	644.00	17,967,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	65,200	865.00	56,398,000
近鉄百貨店	5,300	2,753.00	14,590,900
丸井グループ	125,900	1,822.00	229,389,800



アクシアル リテイリング	11,400	3,940.00	44,916,000
イオン	528,200	2,213.00	1,168,906,600
イズミ	28,000	3,320.00	92,960,000
平和堂	27,900	1,824.00	50,889,600
フジ	16,700	1,746.00	29,158,200
ヤオコー	15,600	6,460.00	100,776,000
ゼビオホールディングス	16,800	934.00	15,691,200
ケーズホールディングス	132,600	1,215.00	161,109,000
Olympicグループ	7,400	661.00	4,891,400
日産東京販売ホールディングス	21,000	215.00	4,515,000
シルバーライフ	1,900	2,122.00	4,031,800
一家ダイニングプロジェクト	1,400	644.00	901,600
Genky DrugStores	6,100	2,425.00	14,792,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	652.00	2,216,800
ブックオフグループホールディングス	8,000	819.00	6,552,000
アインホールディングス	16,900	6,300.00	106,470,000
元気寿司	3,500	2,527.00	8,844,500
ヤマダ電機	418,500	521.00	218,038,500
アークランドサカモト	21,700	1,094.00	23,739,800
ニトリホールディングス	59,400	16,850.00	1,000,890,000
グルメ杵屋	10,000	970.00	9,700,000
愛眼	10,900	216.00	2,354,400
ケーユーホールディングス	7,400	790.00	5,846,000
吉野家ホールディングス	45,200	2,376.00	107,395,200
松屋フーズホールディングス	6,600	3,960.00	26,136,000
サガミホールディングス	18,500	1,313.00	24,290,500
関西スーパーマーケット	11,600	1,060.00	12,296,000
王将フードサービス	10,100	6,060.00	61,206,000
プレナス	15,500	1,874.00	29,047,000
ミニストップ	10,300	1,523.00	15,686,900
アークス	28,100	2,035.00	57,183,500
バローホールディングス	30,500	2,028.00	61,854,000
ベルク	6,800	5,940.00	40,392,000
大庄	7,500	1,327.00	9,952,500
ファーストリテイリング	18,400	53,580.00	985,872,000
サンドラッグ	51,700	3,655.00	188,963,500
サックスパー ホールディングス	12,000	564.00	6,768,000
ヤマザワ	3,300	1,718.00	5,669,400
やまや	2,900	2,238.00	6,490,200
ベルーナ	29,800	522.00	15,555,600
島根銀行	3,600	488.00	1,756,800
じもとホールディングス	92,900	93.00	8,639,700

めぶきフィナンシャルグループ	714,200	232.00	165,694,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,600	1,044.00	19,418,400
九州フィナンシャルグループ	300,700	439.00	132,007,300
ゆうちょ銀行	389,400	1,030.00	401,082,000
富山第一銀行	32,800	272.00	8,921,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	785,000	326.00	255,910,000
西日本フィナンシャルホールディングス	91,500	616.00	56,364,000
関西みらいフィナンシャルグループ	80,700	362.00	29,213,400
三十三フィナンシャルグループ	12,700	1,517.00	19,265,900
第四北越フィナンシャルグループ	23,900	2,281.00	54,515,900
新生銀行	100,900	1,340.00	135,206,000
あおぞら銀行	81,900	1,952.00	159,868,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,402,000	423.80	3,984,567,600
りそなホールディングス	1,508,300	328.30	495,174,890
三井住友トラスト・ホールディングス	259,800	3,058.00	794,468,400
三井住友フィナンシャルグループ	952,200	2,816.00	2,681,395,200
千葉銀行	458,700	493.00	226,139,100
群馬銀行	264,000	335.00	88,440,000
武蔵野銀行	20,500	1,360.00	27,880,000
千葉興業銀行	37,700	238.00	8,972,600
筑波銀行	57,100	167.00	9,535,700
七十七銀行	46,400	1,382.00	64,124,800
青森銀行	10,600	2,313.00	24,517,800
秋田銀行	8,800	1,508.00	13,270,400
山形銀行	15,400	1,280.00	19,712,000
岩手銀行	9,000	2,512.00	22,608,000
東邦銀行	122,900	237.00	29,127,300
東北銀行	6,600	908.00	5,992,800
みちのく銀行	8,800	1,091.00	9,600,800
ふくおかフィナンシャルグループ	115,800	1,629.00	188,638,200
静岡銀行	340,400	650.00	221,260,000
十六銀行	17,200	1,902.00	32,714,400
スルガ銀行	140,600	376.00	52,865,600
八十二銀行	331,700	359.00	119,080,300
山梨中央銀行	16,000	822.00	13,152,000
大垣共立銀行	27,100	2,170.00	58,807,000
福井銀行	11,800	1,586.00	18,714,800
北國銀行	14,200	3,020.00	42,884,000
清水銀行	5,700	1,783.00	10,163,100
富山銀行	2,600	2,239.00	5,821,400
滋賀銀行	27,600	2,545.00	70,242,000
南都銀行	22,900	2,225.00	50,952,500

百五銀行	123,700	305.00	37,728,500
京都銀行	49,200	3,680.00	181,056,000
紀陽銀行	48,700	1,565.00	76,215,500
ほくほくフィナンシャルグループ	91,500	873.00	79,879,500
広島銀行	202,900	446.00	90,493,400
山陰合同銀行	81,500	541.00	44,091,500
中国銀行	118,300	988.00	116,880,400
鳥取銀行	4,700	1,138.00	5,348,600
伊予銀行	196,100	582.00	114,130,200
百十四銀行	14,600	1,938.00	28,294,800
四国銀行	20,900	850.00	17,765,000
阿波銀行	22,400	2,258.00	50,579,200
大分銀行	7,900	2,162.00	17,079,800
宮崎銀行	9,200	2,311.00	21,261,200
佐賀銀行	8,300	1,165.00	9,669,500
沖縄銀行	12,600	3,065.00	38,619,000
琉球銀行	31,700	1,013.00	32,112,100
セブン銀行	459,100	282.00	129,466,200
みずほフィナンシャルグループ	18,676,300	123.30	2,302,787,790
高知銀行	5,000	721.00	3,605,000
山口フィナンシャルグループ	171,600	572.00	98,155,200
長野銀行	4,500	1,146.00	5,157,000
名古屋銀行	10,300	2,294.00	23,628,200
北洋銀行	207,200	189.00	39,160,800
愛知銀行	5,000	3,170.00	15,850,000
中京銀行	5,600	2,076.00	11,625,600
大光銀行	4,700	1,506.00	7,078,200
愛媛銀行	19,200	1,104.00	21,196,800
トマト銀行	5,300	1,006.00	5,331,800
京葉銀行	58,600	516.00	30,237,600
栃木銀行	66,400	158.00	10,491,200
北日本銀行	4,300	1,923.00	8,268,900
東和銀行	24,100	657.00	15,833,700
福島銀行	12,900	169.00	2,180,100
大東銀行	7,100	597.00	4,238,700
トモニホールディングス	106,300	341.00	36,248,300
フィデアホールディングス	133,400	108.00	14,407,200
池田泉州ホールディングス	158,100	171.00	27,035,100
F P G	42,700	546.00	23,314,200
マーキュリアインベストメント	6,400	587.00	3,756,800
S B Iホールディングス	153,600	2,164.00	332,390,400
ジャフコ	21,200	3,495.00	74,094,000

大和証券グループ本社	1,103,200	433.10	477,795,920
野村ホールディングス	2,418,800	424.10	1,025,813,080
岡三証券グループ	117,600	327.00	38,455,200
丸三証券	41,200	417.00	17,180,400
東洋証券	50,500	123.00	6,211,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	158,600	232.00	36,795,200
光世証券	3,600	515.00	1,854,000
水戸証券	40,600	196.00	7,957,600
いちよし証券	26,100	478.00	12,475,800
松井証券	78,700	774.00	60,913,800
だいこう証券ビジネス	6,900	918.00	6,334,200
マネックスグループ	101,700	231.00	23,492,700
極東証券	18,800	524.00	9,851,200
岩井コスモホールディングス	13,200	952.00	12,566,400
藍澤証券	24,900	695.00	17,305,500
マネーパートナーズグループ	15,500	204.00	3,162,000
スパークス・グループ	64,400	192.00	12,364,800
かんぽ生命保険	48,700	1,378.00	67,108,600
S O M P Oホールディングス	258,400	3,263.00	843,159,200
アニコム ホールディングス	11,400	3,970.00	45,258,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	359,400	2,996.00	1,076,762,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	112,900	2,081.00	234,944,900
第一生命ホールディングス	777,800	1,332.00	1,036,029,600
東京海上ホールディングス	486,000	4,507.00	2,190,402,000
T & Dホールディングス	410,800	909.00	373,417,200
アドバンスクリエイト	2,900	2,069.00	6,000,100
全国保証	38,700	3,440.00	133,128,000
ジェイリース	3,800	233.00	885,400
イントラスト	4,800	658.00	3,158,400
日本モーゲージサービス	2,800	1,708.00	4,782,400
C a s a	4,800	1,200.00	5,760,000
アルヒ	21,900	1,371.00	30,024,900
プレミアグループ	7,500	1,770.00	13,275,000
クレディセゾン	96,300	1,238.00	119,219,400
芙蓉総合リース	14,400	5,700.00	82,080,000
みずほリース	21,200	2,116.00	44,859,200
東京センチュリー	27,700	3,815.00	105,675,500
日本証券金融	60,600	482.00	29,209,200
アイフル	209,700	245.00	51,376,500
リコーリース	10,800	2,917.00	31,503,600
イオンフィナンシャルサービス	84,100	1,118.00	94,023,800
アコム	276,300	444.00	122,677,200

ジャックス	15,200	1,830.00	27,816,000
オリエントコーポレーション	371,800	121.00	44,987,800
日立キャピタル	32,400	2,111.00	68,396,400
アプラスフィナンシャル	65,900	64.00	4,217,600
オリックス	859,700	1,319.50	1,134,374,150
三菱UFJリース	348,800	512.00	178,585,600
九州リースサービス	6,700	453.00	3,035,100
日本取引所グループ	394,500	2,099.00	828,055,500
イー・ギャランティ	14,700	1,842.00	27,077,400
アサックス	7,100	638.00	4,529,800
NECキャピタルソリューション	5,600	1,913.00	10,712,800
いちご	181,600	288.00	52,300,800
日本駐車場開発	149,700	130.00	19,461,000
スター・マイカ・ホールディングス	8,300	1,526.00	12,665,800
ADワークスグループ	25,500	178.00	4,539,000
ヒューリック	295,300	1,039.00	306,816,700
三栄建築設計	7,100	1,151.00	8,172,100
野村不動産ホールディングス	84,400	1,901.00	160,444,400
三重交通グループホールディングス	31,600	497.00	15,705,200
サムティ	20,800	1,466.00	30,492,800
ディア・ライフ	23,700	439.00	10,404,300
日本商業開発	10,000	1,455.00	14,550,000
ハウスコム	3,700	1,323.00	4,895,100
日本管理センター	10,800	1,074.00	11,599,200
サンセイランディック	6,500	765.00	4,972,500
フージャースホールディングス	27,400	622.00	17,042,800
オープンハウス	40,700	2,440.00	99,308,000
東急不動産ホールディングス	377,300	555.00	209,401,500
飯田グループホールディングス	115,900	1,475.00	170,952,500
イーランド	5,000	659.00	3,295,000
ムゲンエステート	13,400	487.00	6,525,800
ハウズドゥ	6,700	895.00	5,996,500
シーアールイー	4,900	1,195.00	5,855,500
グッドコムアセット	4,500	1,542.00	6,939,000
ジェイ・エス・ビー	3,700	2,401.00	8,883,700
テンポイノベーション	5,600	705.00	3,948,000
パーク24	74,900	1,877.00	140,587,300
パラカ	4,700	1,675.00	7,872,500
三井不動産	678,800	1,996.50	1,355,224,200
三菱地所	964,100	1,795.50	1,731,041,550
平和不動産	25,800	2,951.00	76,135,800
東京建物	146,300	1,280.00	187,264,000

ダイビル	37,200	1,013.00	37,683,600
京阪神ビルディング	23,600	1,448.00	34,172,800
住友不動産	309,600	2,991.50	926,168,400
テオオーシー	29,700	697.00	20,700,900
東京楽天地	2,700	4,280.00	11,556,000
スターツコーポレーション	19,600	2,101.00	41,179,600
フジ住宅	19,500	499.00	9,730,500
空港施設	18,100	431.00	7,801,100
明和地所	11,900	433.00	5,152,700
ゴールドクレスト	12,000	1,673.00	20,076,000
エスリード	6,700	1,390.00	9,313,000
日神グループホールディングス	24,800	406.00	10,068,800
日本エスコン	24,900	758.00	18,874,200
タカラレーベン	62,800	368.00	23,110,400
A V A N T I A	10,400	731.00	7,602,400
イオンモール	70,200	1,524.00	106,984,800
毎日コムネット	5,800	811.00	4,703,800
ファースト住建	7,900	925.00	7,307,500
カチタス	34,900	2,126.00	74,197,400
トーセイ	20,700	1,017.00	21,051,900
穴吹興産	4,200	1,579.00	6,631,800
サンフロンティア不動産	21,100	914.00	19,285,400
エフ・ジェー・ネクスト	14,300	812.00	11,611,600
インテリックス	3,900	567.00	2,211,300
ランドビジネス	4,600	304.00	1,398,400
日本社宅サービス	6,000	1,038.00	6,228,000
グランディハウス	16,100	354.00	5,699,400
日本空港ビルデング	44,300	4,255.00	188,496,500
日本工営	9,000	3,060.00	27,540,000
L I F U L L	46,900	384.00	18,009,600
ジェイエイシーリクルートメント	9,100	1,226.00	11,156,600
日本M&Aセンター	100,600	3,660.00	368,196,000
メンバーズ	4,000	1,833.00	7,332,000
中広	2,100	524.00	1,100,400
UTグループ	21,000	1,830.00	38,430,000
アイティメディア	5,500	959.00	5,274,500
タケエイ	12,900	880.00	11,352,000
E・Jホールディングス	2,400	1,577.00	3,784,800
ビーネックグループ	16,900	756.00	12,776,400
コシダカホールディングス	32,400	505.00	16,362,000
アルトナー	3,400	696.00	2,366,400
パソナグループ	14,600	1,185.00	17,301,000

C D S	3,400	1,381.00	4,695,400
リンクアンドモチベーション	29,800	379.00	11,294,200
G C A	16,300	690.00	11,247,000
エス・エム・エス	41,500	2,432.00	100,928,000
サニーサイドアップグループ	4,800	780.00	3,744,000
パーソルホールディングス	133,200	1,319.00	175,690,800
リニカル	6,600	973.00	6,421,800
クックパッド	46,900	306.00	14,351,400
エスクリ	4,500	457.00	2,056,500
アイ・ケイ・ケイ	6,700	625.00	4,187,500
学情	4,800	1,301.00	6,244,800
スタジオアリス	6,800	1,577.00	10,723,600
シミックホールディングス	6,600	1,559.00	10,289,400
エプロ	3,000	955.00	2,865,000
N J S	3,000	1,750.00	5,250,000
総合警備保障	53,000	5,160.00	273,480,000
カカクコム	98,400	2,493.00	245,311,200
アイロムグループ	4,700	1,917.00	9,009,900
セントケア・ホールディング	8,900	420.00	3,738,000
サイネックス	2,500	621.00	1,552,500
ルネサンス	7,500	1,189.00	8,917,500
ディップ	18,800	2,554.00	48,015,200
オプトホールディング	7,300	1,527.00	11,147,100
ツクイ	31,700	482.00	15,279,400
キャリアデザインセンター	3,200	906.00	2,899,200
ベネフィット・ワン	48,500	2,000.00	97,000,000
エムスリー	293,600	3,695.00	1,084,852,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,900	361.00	3,212,900
プラス	2,000	462.00	924,000
アウトソーシング	76,500	624.00	47,736,000
ウェルネット	13,700	655.00	8,973,500
ワールドホールディングス	4,600	1,546.00	7,111,600
ディー・エヌ・エー	65,400	1,334.00	87,243,600
博報堂D Yホールディングス	185,300	1,209.00	224,027,700
ぐるなび	23,400	686.00	16,052,400
タカミヤ	14,400	455.00	6,552,000
ジャパンベストレスキューシステム	10,500	727.00	7,633,500
ファンコミュニケーションズ	36,900	464.00	17,121,600
ライク	4,500	1,750.00	7,875,000
ビジネス・ブレークスルー	5,900	421.00	2,483,900
エスプール	34,400	743.00	25,559,200
W D Bホールディングス	6,100	2,564.00	15,640,400

手間いらず	900	4,775.00	4,297,500
ティア	8,000	523.00	4,184,000
C D G	1,500	1,454.00	2,181,000
バリューコマース	7,500	2,473.00	18,547,500
インフォーマート	146,100	808.00	118,048,800
J Pホールディングス	42,300	280.00	11,844,000
エコナックホールディングス	25,600	94.00	2,406,400
E P Sホールディングス	18,200	1,130.00	20,566,000
レグス	3,400	945.00	3,213,000
プレステージ・インターナショナル	50,000	870.00	43,500,000
アミューズ	7,300	2,279.00	16,636,700
ドリームインキュベータ	4,200	1,301.00	5,464,200
クイック	8,400	1,091.00	9,164,400
T A C	8,700	203.00	1,766,100
ケネディクス	124,400	503.00	62,573,200
電通グループ	137,300	2,358.00	323,753,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,300	698.00	3,699,400
ぴあ	3,900	3,330.00	12,987,000
イオンファンタジー	5,200	1,978.00	10,285,600
シーティーエス	15,200	696.00	10,579,200
ネクシィーズグループ	4,200	1,062.00	4,460,400
みらかホールディングス	37,300	3,050.00	113,765,000
アルプス技研	11,900	1,812.00	21,562,800
ダイオーズ	2,700	1,092.00	2,948,400
日本空調サービス	14,100	719.00	10,137,900
オリエンタルランド	141,600	14,280.00	2,022,048,000
ダスキン	33,100	2,779.00	91,984,900
明光ネットワークジャパン	17,000	827.00	14,059,000
ファルコホールディングス	7,400	1,600.00	11,840,000
ラウンドワン	37,300	952.00	35,509,600
リゾートトラスト	61,200	1,210.00	74,052,000
ビー・エム・エル	17,200	3,040.00	52,288,000
ワタベウェディング	2,500	389.00	972,500
りらいあコミュニケーションズ	24,200	1,198.00	28,991,600
リソー教育	61,300	283.00	17,347,900
早稲田アカデミー	5,900	1,000.00	5,900,000
ユー・エス・エス	149,200	1,759.00	262,442,800
東京個別指導学院	4,900	586.00	2,871,400
サイバーエージェント	82,100	4,435.00	364,113,500
楽天	620,800	993.00	616,454,400
クリーク・アンド・リバー社	7,000	1,008.00	7,056,000
テー・オー・ダブリュー	21,700	308.00	6,683,600



山田コンサルティンググループ	8,700	1,196.00	10,405,200
セントラルスポーツ	5,000	2,490.00	12,450,000
フルキャストホールディングス	13,400	1,539.00	20,622,600
エン・ジャパン	23,700	2,646.00	62,710,200
リソルホールディングス	1,500	3,435.00	5,152,500
テクノプロ・ホールディングス	26,600	6,320.00	168,112,000
アトラ	3,600	269.00	968,400
インターワークス	2,900	397.00	1,151,300
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	6,630.00	35,802,000
K e e P e r 技研	5,000	1,586.00	7,930,000
ファーストロジック	2,800	567.00	1,587,600
三機サービス	2,700	1,153.00	3,113,100
G u n o s y	8,400	955.00	8,022,000
デザインワン・ジャパン	4,600	219.00	1,007,400
イー・ガーディアン	5,900	1,988.00	11,729,200
リブセンス	9,000	282.00	2,538,000
ジャパンマテリアル	41,000	1,547.00	63,427,000
ベクトル	16,800	777.00	13,053,600
ウチヤマホールディングス	7,000	353.00	2,471,000
チャーム・ケア・コーポレーション	11,500	917.00	10,545,500
ライクキッズ	2,500	653.00	1,632,500
キャリアリンク	4,600	501.00	2,304,600
I B J	9,300	880.00	8,184,000
アサンテ	5,400	1,562.00	8,434,800
N・フィールド	9,500	516.00	4,902,000
バリューHR	5,400	1,460.00	7,884,000
M&Aキャピタルパートナーズ	10,800	3,315.00	35,802,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,443.00	7,503,600
E R Iホールディングス	3,900	676.00	2,636,400
アビスト	2,100	2,148.00	4,510,800
シグマクシス	9,200	1,657.00	15,244,400
ウィルグループ	8,900	691.00	6,149,900
エスクロー・エージェント・ジャパン	19,100	198.00	3,781,800
リクルートホールディングス	953,900	3,312.00	3,159,316,800
エラン	7,900	1,760.00	13,904,000
土木管理総合試験所	6,200	334.00	2,070,800
ネットマーケティング	5,300	725.00	3,842,500
日本郵政	1,091,600	866.40	945,762,240
ベルシステム24ホールディングス	22,400	1,272.00	28,492,800
鎌倉新書	10,100	1,137.00	11,483,700
S M N	3,000	891.00	2,673,000
一蔵	1,800	389.00	700,200

LITALICO	4,600	2,410.00	11,086,000
グローバルキッズCOMPANY	2,600	665.00	1,729,000
エアトリ	7,000	1,080.00	7,560,000
アトラエ	4,100	2,758.00	11,307,800
ストライク	5,100	4,360.00	22,236,000
ソラスト	36,900	1,162.00	42,877,800
セラク	4,300	924.00	3,973,200
インソース	5,600	2,680.00	15,008,000
ペイカレント・コンサルティング	8,100	6,410.00	51,921,000
Orchestra Holdings	2,900	910.00	2,639,000
アイモバイル	4,900	671.00	3,287,900
キャリアインデックス	5,900	334.00	1,970,600
MS - Japan	4,500	829.00	3,730,500
船場	2,300	936.00	2,152,800
グレイステクノロジー	6,200	3,235.00	20,057,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,100	2,713.00	38,253,300
フルテック	2,000	1,280.00	2,560,000
グリーンズ	3,700	482.00	1,783,400
ツナググループ・ホールディングス	2,500	473.00	1,182,500
GameWith	4,200	671.00	2,818,200
ソウルドアウト	2,800	2,175.00	6,090,000
MS&Consulting	2,700	607.00	1,638,900
ミダック	1,900	1,185.00	2,251,500
日総工産	9,200	571.00	5,253,200
キュービーネットホールディングス	5,500	1,998.00	10,989,000
RPAホールディングス	10,300	847.00	8,724,100
スプリックス	3,900	968.00	3,775,200
マネジメントソリューションズ	5,900	1,049.00	6,189,100
and factory	1,400	1,119.00	1,566,600
カーブスホールディングス	36,800	613.00	22,558,400
フォーラムエンジニアリング	7,100	764.00	5,424,400
アドバンテッジリスクマネジメント	6,900	815.00	5,623,500
リログループ	72,900	2,359.00	171,971,100
東祥	8,400	1,205.00	10,122,000
エイチ・アイ・エス	20,800	1,721.00	35,796,800
ラックランド	3,200	1,995.00	6,384,000
共立メンテナンス	22,100	3,190.00	70,499,000
イチネンホールディングス	15,000	1,164.00	17,460,000
建設技術研究所	9,300	1,785.00	16,600,500
スペース	8,800	1,022.00	8,993,600
長大	5,500	874.00	4,807,000
燦ホールディングス	5,900	1,287.00	7,593,300

スバル興業	800	7,870.00	6,296,000	
東京テアトル	5,300	1,225.00	6,492,500	
タナベ経営	2,700	1,232.00	3,326,400	
ナガワ	4,300	7,510.00	32,293,000	
よみうりランド	2,900	3,420.00	9,918,000	
東京都競馬	8,800	3,710.00	32,648,000	
カナモト	21,900	2,207.00	48,333,300	
東京ドーム	54,100	846.00	45,768,600	
西尾レントオール	12,300	2,263.00	27,834,900	
トランス・コスモス	12,700	2,202.00	27,965,400	
乃村工藝社	57,200	861.00	49,249,200	
藤田観光	5,900	1,945.00	11,475,500	
KNT-CTホールディングス	8,300	1,045.00	8,673,500	
日本管財	14,300	1,843.00	26,354,900	
トーカイ	12,900	2,644.00	34,107,600	
白洋舎	1,600	2,804.00	4,486,400	
セコム	141,300	9,075.00	1,282,297,500	
セントラル警備保障	6,400	4,525.00	28,960,000	
丹青社	25,300	726.00	18,367,800	
メイテック	16,300	4,850.00	79,055,000	
応用地質	14,400	1,298.00	18,691,200	
船井総研ホールディングス	27,600	2,459.00	67,868,400	
進学会ホールディングス	5,500	528.00	2,904,000	
オオバ	9,800	674.00	6,605,200	
いであ	3,300	1,560.00	5,148,000	
学究社	4,000	1,126.00	4,504,000	
ベネッセホールディングス	44,400	3,140.00	139,416,000	
イオンディライト	16,500	3,190.00	52,635,000	
ナック	7,500	891.00	6,682,500	
ニチイ学館	19,100	1,455.00	27,790,500	
ダイセキ	22,400	2,506.00	56,134,400	
ステップ	5,000	1,398.00	6,990,000	
合計	163,299,900		289,806,798,310	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権 証券	千葉興業銀行第7回新株予約権	38,100	-	
	合計	38,100	-	

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 5月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,260,867,616
コール・ローン	248,065,345
株式	355,249,058,100
投資信託受益証券	257,803,195
投資証券	9,112,687,380
派生商品評価勘定	1,210,451,152
未収入金	1,848,004
未収配当金	438,951,881
差入委託証拠金	6,543,499,143
流動資産合計	380,323,231,816
資産合計	380,323,231,816
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	165,603
前受金	1,209,837,399
未払解約金	126,032,007
未払利息	215
流動負債合計	1,336,035,224
負債合計	1,336,035,224
純資産の部	
元本等	
元本	153,553,031,075
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	225,434,165,517
元本等合計	378,987,196,592
純資産合計	378,987,196,592
負債純資産合計	380,323,231,816

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 5月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	2020年 5月11日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2020年 5月11日現在
	(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 5月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	153,553,031,075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 2.4681円 (1万口当たり純資産額) (24,681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 5月11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 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2020年 5月11日現在
期首	2019年11月12日
期首元本額	142,021,697,341円
期中追加設定元本額	28,395,971,810円
期中一部解約元本額	16,864,638,076円
期末元本額	153,553,031,075円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	2,376,211,925円
S B I 資産設計オープン(分配型)	7,845,974円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,838,568,548円
世界経済インデックスファンド	8,260,878,432円
外国株式インデックス・オープン	823,061,391円
D C マイセレクション 2 5	1,000,588,414円
D C マイセレクション 5 0	5,227,733,512円
D C マイセレクション 7 5	4,993,718,361円
D C 外国株式インデックス・オープン	9,369,628,838円
D C マイセレクション S 2 5	421,129,633円
D C マイセレクション S 5 0	2,185,859,034円
D C マイセレクション S 7 5	1,566,785,931円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	91,019,959円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	226,028,517円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	145,840,220円
D C 世界経済インデックスファンド	10,564,212,029円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	2,170,306,807円
マイセレクション 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	9,367,228円
マイセレクション 7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	11,500,216円
外国株式インデックス・オープン V A 1(適格機関投資家専用)	37,988,432円
バランス 3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	43,212,849円
バランス 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	145,758,315円
バランス 2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	31,616,644円
バランス 5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	175,653,948円
バランス A ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	665,938,735円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	343,172,474円
バランス C ( 5 0 ) V A 1(適格機関投資家専用)	2,339,863,614円
世界バランス V A 1(適格機関投資家専用)	1,793,682,977円
世界バランス V A 2(適格機関投資家専用)	69,424,603円
バランス D ( 3 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	343,951,606円
グローバルバランスファンド V A 3 5(適格機関投資家専用)	8,613,717円
バランス E ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	107,261,652円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,831,201,256円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	2,098,893,228円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,044,055,869円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,264,957,748円



区分	2020年 5月11日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,503,070,291円
分散投資コア戦略ファンドA	2,131,926,291円
分散投資コア戦略ファンドS	6,114,617,930円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,130,553,628円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,297,770,195円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,178,678,308円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	746,355,893円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,129,729円
SMT インデックスバランス・オープン	242,513,792円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,251,074,322円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	37,379,914,692円
SMT 世界経済インデックス・オープン	118,251,297円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	392,026,296円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	78,481,163円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,117,164円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	68,239,753円
グローバル経済コア	1,000,978,616円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,818,388円
DCターゲット・イヤーフンド2055	932,513円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	475,028,107円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	78,721,853円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	359,651円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	477,432円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	254,475円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	148,591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）	1,188,693,683円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,232,336,971円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,783,594,894円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	134,465,869円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	108,510,773円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	402,638,376円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	822,817,503円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,435,960,593
投資信託受益証券	11,613,201
投資証券	1,213,018,270
合計	1,211,329,122

(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 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,041,373,107	-	14,251,210,506	1,209,837,399
合計		13,041,373,107	-	14,251,210,506	1,209,837,399

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2020年 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	73,733,850	-	74,179,100	445,250
	アメリカドル	26,587,500	-	26,735,000	147,500
	ユーロ	17,302,200	-	17,400,000	97,800
	オーストラリアドル	29,844,150	-	30,044,100	199,950
	売建	22,254,600	-	22,251,700	2,900
	カナダドル	22,254,600	-	22,251,700	2,900
	合計		95,988,450	-	96,430,800

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APACHE CORP	64,273	12.45	800,198.85	
	BAKER HUGHES CO	57,644	15.01	865,236.44	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	20.51	735,878.29	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	44.50	977,932.00	
	CHEVRON CORP	180,346	95.47	17,217,632.62	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	58.64	1,128,526.80	
	CONOCOPHILLIPS	104,738	43.08	4,512,113.04	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	15.09	115,393.23	
	DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	12.70	480,834.70	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	20,487	42.08	862,092.96	
	EOG RESOURCES INC	55,564	51.45	2,858,767.80	
	EXXON MOBIL	403,535	46.18	18,635,246.30	
	HALLIBURTON CO	97,620	10.70	1,044,534.00	
	HESS CORP	24,844	48.48	1,204,437.12	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	31.21	440,373.10	
	KINDER MORGAN INC	194,644	15.35	2,987,785.40	
	MARATHON OIL CORP	74,537	5.78	430,823.86	
	MARATHON PETROLEUM CORP	62,097	33.03	2,051,063.91	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	13.19	490,166.78	
	NOBLE ENERGY INC	67,291	10.03	674,928.73	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	85,461	15.02	1,283,624.22	
	ONEOK INC	36,957	31.33	1,157,862.81	
	PHILLIPS 66	42,441	77.06	3,270,503.46	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	89.99	1,425,801.56	
	SCHLUMBERGER	132,260	18.05	2,387,293.00	
	TARGA RESOURCES CORP	20,002	13.80	276,027.60	
	TECHNIPFMC PLC	55,005	7.92	435,639.60	
	VALERO ENERGY CORP	39,247	65.92	2,587,162.24	
	WILLIAMS COS	114,214	19.47	2,223,746.58	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	21,038	233.48	4,911,952.24	
	ALBEMARLE CORP	10,180	64.25	654,065.00	
	AMCOR PLC	153,458	8.97	1,376,518.26	
AVERY DENNISON CORP	7,457	109.26	814,751.82		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	19.61	345,253.66		
BALL CORP	29,134	64.56	1,880,891.04		

CELANESE CORP-SERIES A	11,053	82.72	914,304.16
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	29.03	553,631.13
CORTEVA INC	70,180	25.98	1,823,276.40
CROWN HOLDINGS INC	12,992	63.07	819,405.44
DOW INC	70,834	34.33	2,431,731.22
DUPONT DE NEMOURS INC	70,752	46.93	3,320,391.36
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	62.53	741,480.74
ECOLAB INC	24,761	197.76	4,896,735.36
FMC CORP	12,118	93.48	1,132,790.64
FREEMPORT-MCMORAN INC	138,927	9.21	1,279,517.67
INT'L PAPER CO	33,803	34.35	1,161,133.05
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,709	134.47	1,305,569.23
LINDE PLC	51,243	188.41	9,654,693.63
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	56.45	1,440,208.85
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	176.59	1,056,184.79
MOSAIC CO/THE	31,911	11.91	380,060.01
NEWMONT CORPORATION	78,251	64.55	5,051,102.05
NUCOR CORP	29,015	42.20	1,224,433.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	98.14	872,464.60
PPG INDUSTRIES INC	22,118	91.98	2,034,413.64
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	68.83	855,556.90
SEALED AIR CORP	14,689	29.64	435,381.96
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,930	549.68	4,358,962.40
STEEL DYNAMICS INC	18,273	25.37	463,586.01
VULCAN MATERIALS CO	12,657	101.11	1,279,749.27
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	43.52	150,361.60
WESTROCK CO	24,734	27.00	667,818.00
3 M COMPANY	55,862	148.51	8,296,065.62
ACUITY BRANDS INC	3,505	85.98	301,359.90
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	30.42	344,658.60
ALLEGION PLC	8,963	102.27	916,646.01
AMETEK INC	22,247	84.32	1,875,867.04
BOEING CO	51,941	133.44	6,931,007.04
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	18.36	1,387,116.36
CATERPILLAR	53,692	112.11	6,019,410.12
CUMMINS INC	13,652	161.29	2,201,931.08
DEERE&CO	29,071	137.00	3,982,727.00
DOVER CORP	13,872	92.23	1,279,414.56
EATON CORP	40,190	82.25	3,305,627.50
EMERSON ELECTRIC CO	59,226	56.10	3,322,578.60
FASTENAL CO	55,807	39.05	2,179,263.35
FLOWSERVE CORP	10,826	26.78	289,920.28

FORTIVE CORP	28,503	59.27	1,689,372.81
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	56.09	718,512.90
GENERAL DYNAMICS CORP	23,906	135.35	3,235,677.10
GENERAL ELECTRIC CO	848,526	6.29	5,337,228.54
GRAINGER (WW) INC	4,461	285.45	1,273,392.45
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	29.56	450,080.56
HEICO CORP	3,640	90.43	329,165.20
HEICO CORP-CLASS A	6,449	72.20	465,617.80
HONEYWELL INTL INC	69,406	136.91	9,502,375.46
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	12.62	461,261.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	180.58	636,002.76
IDEX CORP	6,916	154.70	1,069,905.20
ILLINOIS TOOL WORKS	31,233	161.01	5,028,825.33
INGERSOLL-RAND INC	31,562	29.17	920,663.54
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	79.97	961,719.22
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	45.50	914,550.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	21.75	445,875.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	75,045	29.80	2,236,341.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,485	180.95	3,887,710.75
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	191.48	552,419.80
LOCKHEED MARTIN CORP	24,659	378.40	9,330,965.60
MASCO CORP	27,698	42.14	1,167,193.72
MIDDLEBY CORP	4,364	64.35	280,823.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,557	327.65	5,097,251.05
OTIS WORLDWIDE CORP	37,775	52.95	2,000,186.25
OWENS CORNING	10,458	43.62	456,177.96
PACCAR INC	32,395	69.62	2,255,339.90
PARKER HANNIFIN CORP	12,505	161.00	2,013,305.00
PENTAIR PLC	13,583	35.10	476,763.30
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	147,006	58.67	8,624,842.02
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,244	192.45	2,163,907.80
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,116	358.36	3,625,169.76
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	36.71	507,625.88
SMITH (A.O.) CORP	12,146	44.79	544,019.34
SNAP-ON INC	4,900	127.33	623,917.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	20.49	173,775.69
STANLEY BLACK&DECKER	14,798	117.33	1,736,249.34
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	332.72	1,164,852.72
TEXTRON	21,534	27.30	587,878.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,309	84.39	1,967,046.51
TRANSDIGM GROUP INC	4,693	352.61	1,654,798.73
UNITED RENTALS INC	6,446	119.58	770,812.68

WABCO HOLDINGS INC	4,981	133.95	667,204.95
WABTEC CORP	17,764	57.32	1,018,232.48
XYLEM INC	17,545	63.00	1,105,335.00
CINTAS CORP	8,272	218.21	1,805,033.12
COPART INC	19,784	83.79	1,657,701.36
COSTAR GROUP INC	3,564	657.42	2,343,044.88
EQUIFAX INC	11,791	149.38	1,761,339.58
IHS MARKIT LTD	35,672	67.07	2,392,521.04
MANPOWER GROUP	5,123	71.84	368,036.32
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	14.15	493,113.35
REPUBLIC SERVICES INC	21,742	81.31	1,767,842.02
ROBERT HALF INTL INC	9,566	47.38	453,237.08
ROLLINS INC	14,566	42.29	615,996.14
TRANSUNION	16,944	79.11	1,340,439.84
VERISK ANALYTICS INC	14,560	159.57	2,323,339.20
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	92.67	2,282,369.43
WASTE MANAGEMENT INC	41,233	100.97	4,163,296.01
AMERCO	602	301.29	181,376.58
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	10.14	100,588.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	73.80	973,126.80
CSX CORP	71,794	66.11	4,746,301.34
DELTA AIR LINES INC	15,095	22.72	342,958.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	74.83	1,187,402.44
FEDEX CORP	24,100	120.44	2,902,604.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	103.25	858,936.75
KANSAS CITY SOUTHERN	9,654	136.63	1,319,026.02
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	37.73	403,711.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,343	174.75	4,428,689.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,106	152.76	1,391,032.56
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	27.20	311,848.00
UBER TECHNOLOGIES INC	38,449	32.79	1,260,742.71
UNION PACIFIC CORP	67,430	158.26	10,671,471.80
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	25.42	152,596.26
UNITED PARCEL SERVICE B	68,080	94.83	6,456,026.40
XPO LOGISTICS INC	8,001	68.40	547,268.40
APTIV PLC	24,462	68.15	1,667,085.30
AUTOLIV INC	10,139	61.14	619,898.46
BORGWARNER INC	19,890	29.39	584,567.10
FORD MOTOR COMPANY	375,147	5.24	1,965,770.28
GENERAL MOTORS CO	120,926	23.93	2,893,759.18
HARLEY-DAVIDSON	14,677	21.45	314,821.65
LEAR CORP	5,287	101.37	535,943.19

TESLA INC	12,916	819.42	10,583,628.72
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	15.01	173,320.47
DR HORTON INC	32,171	49.59	1,595,359.89
GARMIN LTD	12,758	81.34	1,037,735.72
HANESBRANDS INC	31,136	9.47	294,857.92
HASBRO INC	12,468	69.70	869,019.60
LEGGETT & PLATT INC	10,594	29.80	315,701.20
LENNAR CORP-CL A	28,545	54.01	1,541,715.45
LULULEMON ATHLETICA INC	10,596	237.99	2,521,742.04
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	84.86	429,561.32
NEWELL BRANDS INC	37,563	12.41	466,156.83
NIKE B	119,223	90.46	10,784,912.58
NVR INC	337	3,119.67	1,051,328.79
POLARIS INC	4,691	72.93	342,114.63
PULTE GROUP INC	21,959	29.88	656,134.92
PVH CORP	7,252	46.02	333,737.04
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	72.08	329,982.24
TAPESTRY INC	25,989	14.88	386,716.32
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	9.98	159,181.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	8.94	145,570.02
VF CORP	32,491	58.23	1,891,950.93
WHIRLPOOL CORP	6,079	112.60	684,495.40
ARAMARK	24,034	26.08	626,806.72
CARNIVAL CORPORATION	46,126	14.21	655,450.46
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,577	925.83	2,385,863.91
DARDEN RESTAURANTS INC	11,266	74.72	841,795.52
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	369.11	1,373,458.31
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,662	72.19	1,852,539.78
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	50.94	1,686,114.00
MARRIOTT INTL A	26,598	87.17	2,318,547.66
MCDONALD'S CORP	72,055	181.23	13,058,527.65
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	16.74	295,661.88
MGM RESORTS INTERNATIONAL	58,656	15.59	914,447.04
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	12.43	221,726.34
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	39.92	610,416.72
STARBUCKS CORP	113,355	77.87	8,826,953.85
VAIL RESORTS INC	3,574	178.04	636,314.96
WYNN RESORTS LTD	9,302	86.94	808,715.88
YUM BRANDS INC	29,166	86.18	2,513,525.88
ACTIVISION BLIZZARD INC	73,316	73.14	5,362,332.24
ALPHABET INC-CL A	28,573	1,384.34	39,554,746.82
ALPHABET INC-CL C	29,486	1,388.37	40,937,477.82

ALTICE USA INC- A	12,457	23.40	291,493.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14,344	515.28	7,391,176.32
COMCAST CORP-CL A	432,984	36.53	15,819,070.44
DISCOVERY INC - A	12,804	21.08	269,972.34
DISCOVERY INC-C	31,156	19.35	602,868.60
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	25.73	620,170.19
ELECTRONIC ARTS INC	27,876	116.62	3,250,899.12
FACEBOOK INC-A	229,762	212.35	48,789,960.70
FOX CORP - CLASS A	33,968	26.00	883,168.00
FOX CORP- CLASS B	15,092	25.73	388,317.16
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	234.87	1,836,918.27
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	17.32	586,004.88
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	127.11	1,296,649.11
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	21.74	337,317.84
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,106	21.39	900,647.34
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	30.71	574,062.03
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	32.89	501,013.37
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	33.18	211,821.12
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	41.96	530,248.52
MATCH GROUP INC	4,600	79.99	367,954.00
NETFLIX INC	41,798	435.55	18,205,118.90
NEWS CORP-CLASS A	33,479	10.93	365,925.47
OMNICOM GROUP	20,835	55.11	1,148,216.85
PINTEREST INC- CLASS A	32,190	19.79	637,040.10
ROKU INC	8,355	126.66	1,058,244.30
SIRIUS XM HOLDINGS INC	148,452	5.74	852,856.74
SNAP INC - A	67,334	18.23	1,227,498.82
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,751	129.85	1,396,017.35
THE WALT DISNEY CO	171,900	109.16	18,764,604.00
TRIPADVISOR INC	10,393	17.91	186,138.63
TWITTER INC	70,484	29.93	2,109,586.12
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	18.08	975,886.08
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	52.97	655,132.96
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	124.85	772,322.10
AMAZON.COM	40,314	2,379.61	95,931,597.54
AUTOZONE INC	2,285	1,057.90	2,417,301.50
BEST BUY COMPANY INC	22,720	78.63	1,786,473.60
BOOKING HOLDINGS INC	4,000	1,430.83	5,723,320.00
BURLINGTON STORES INC	6,004	179.07	1,075,136.28
CARMAX INC	15,777	76.69	1,209,938.13
DOLLAR GENERAL CORP	24,570	176.36	4,333,165.20
DOLLAR TREE INC	22,651	78.05	1,767,910.55



EBAY	73,924	42.15	3,115,896.60
EXPEDIA GROUP INC	13,383	69.27	927,040.41
GAP	21,891	8.10	177,317.10
GENUINE PARTS CO	13,937	76.44	1,065,344.28
GRUBHUB INC	8,261	46.82	386,780.02
HOME DEPOT	104,694	234.43	24,543,414.42
KOHL'S CORP	14,645	18.20	266,539.00
LKQ CORP	29,351	26.28	771,344.28
LOWES COMPANIES	73,381	114.23	8,382,311.63
MERCADOLIBRE INC	4,280	784.52	3,357,745.60
NORDSTROM INC	10,094	18.03	181,994.82
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,237	402.51	2,912,964.87
ROSS STORES INC	34,327	91.46	3,139,547.42
TARGET (DAYTON HUDSON)	48,428	115.83	5,609,415.24
TIFFANY & CO	10,426	128.56	1,340,366.56
TJX COMPANIES INC	115,530	48.51	5,604,360.30
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	107.21	1,202,038.52
ULTA BEAUTY INC	5,362	230.07	1,233,635.34
COSTCO WHOLESALE CORP	42,137	305.94	12,891,393.78
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	4.80	162,720.00
KROGER CO	76,549	33.34	2,552,143.66
SYSCO CORP	45,437	53.29	2,421,337.73
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,429	41.67	3,018,116.43
WALMART INC	135,634	122.94	16,674,843.96
ALTRIA GROUP INC	178,226	36.74	6,548,023.24
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	36.39	1,899,157.71
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	65.97	1,913,789.70
BUNGE LIMITED	13,606	36.53	497,027.18
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	51.26	813,444.94
COCA-COLA CO	388,189	46.11	17,899,394.79
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	22,612	39.40	890,912.80
CONAGRA BRANDS INC	45,992	33.52	1,541,651.84
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,999	166.06	2,656,793.94
GENERAL MILLS INC	57,694	59.76	3,447,793.44
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	133.19	1,850,808.24
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.24	1,282,896.68
INGREDION INC	5,835	84.11	490,781.85
JM SMUCKER CO	10,802	116.08	1,253,896.16
KELLOGG CO	24,092	63.68	1,534,178.56
KRAFT HEINZ CO/THE	64,187	29.56	1,897,367.72
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	61.54	795,342.96
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,808	164.03	1,936,866.24

MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	38.89	707,914.67
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	137,361	50.90	6,991,674.90
MONSTER BEVERAGE CORP	37,638	65.78	2,475,827.64
PEPSICO INC	132,991	134.23	17,851,381.93
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	148,405	72.00	10,685,160.00
TYSON FOODS INC	28,214	60.39	1,703,843.46
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	73.35	1,720,350.90
CLOROX COMPANY	11,988	204.05	2,446,151.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	77,689	69.37	5,389,285.93
COTY INC-CL A	30,534	5.20	158,776.80
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,244	173.15	3,678,398.60
KIMBERLY-CLARK CORP	32,715	138.51	4,531,354.65
PROCTER & GAMBLE CO	237,820	115.95	27,575,229.00
ABBOTT LABORATORIES	168,671	93.70	15,804,472.70
ABIOMED INC	4,421	187.07	827,036.47
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	210.03	1,493,943.39
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	88.09	1,286,466.36
ANTHEM INC	24,196	274.33	6,637,688.68
BAXTER INTERNATIONAL	46,293	88.08	4,077,487.44
BECTON DICKINSON & CO	25,805	254.48	6,566,856.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	133,021	38.18	5,078,741.78
CARDINAL HEALTH	27,968	49.88	1,395,043.84
CENTENE CORP	55,738	65.88	3,672,019.44
CERNER CORP	30,009	68.75	2,063,118.75
CIGNA CORP	35,629	189.27	6,743,500.83
CVS HEALTH CORP	124,114	63.12	7,834,075.68
DANAHER CORP	59,703	161.43	9,637,855.29
DAVITA INC	9,056	80.76	731,362.56
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	40.65	820,642.20
DEXCOM INC	8,558	405.50	3,470,269.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19,907	217.84	4,336,540.88
HCA HEALTHCARE INC	25,918	107.92	2,797,070.56
HENRY SCHEIN INC	14,096	54.03	761,606.88
HOLOGIC INC	24,459	51.99	1,271,623.41
HUMANA INC	12,640	377.50	4,771,600.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,195	287.90	2,359,340.50
INSULET CORP	5,923	217.63	1,289,022.49
INTUITIVE SURGICAL INC	11,028	537.77	5,930,527.56
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	167.26	1,476,404.02
MCKESSON CORP	15,443	135.97	2,099,784.71
MEDTRONIC PLC	127,849	99.03	12,660,886.47
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	112.22	1,446,964.68

RESMED INC	13,491	162.75	2,195,660.25
STERIS PLC	8,111	148.25	1,202,455.75
STRYKER CORP	32,154	192.08	6,176,140.32
TELEFLEX INC	4,427	340.30	1,506,508.10
THE COOPER COS INC	4,688	304.52	1,427,589.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	90,353	287.00	25,931,311.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	102.06	739,730.88
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	118.70	977,731.90
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	192.34	2,370,590.50
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,079	200.01	1,415,870.79
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,652	121.86	2,394,792.72
ABBVIE INC	141,058	83.96	11,843,229.68
AGILENT TECHNOLOGIES	29,560	79.71	2,356,227.60
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	97.34	2,017,468.84
ALLERGAN PLC	31,323	193.02	6,045,965.46
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	136.13	1,451,826.45
AMGEN	56,674	234.82	13,308,188.68
BEIGENE LTD-ADR	3,859	156.81	605,129.79
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	456.35	977,045.35
BIOGEN INC	17,218	314.02	5,406,796.36
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	95.20	1,634,679.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	223,587	61.05	13,649,986.35
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	19.84	715,450.24
EXACT SCIENCES CORP	13,278	82.01	1,088,928.78
GILEAD SCIENCES INC	120,680	77.49	9,351,493.20
ILLUMINA INC	14,031	309.87	4,347,785.97
INCYTE CORP	17,504	95.92	1,678,983.68
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	54.40	697,244.80
IQVIA HOLDINGS INC	15,762	137.65	2,169,639.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	110.44	548,997.24
JOHNSON & JOHNSON	251,260	148.70	37,362,362.00
LILLY (ELI) & CO	82,421	153.51	12,652,447.71
MERCK & CO	242,811	76.40	18,550,760.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	719.57	1,626,947.77
MYLAN NV	49,481	17.57	869,381.17
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	109.40	927,055.60
PERKINELMER INC	10,645	92.48	984,449.60
PERRIGO CO PLC	11,333	52.64	596,569.12
PFIZER	527,795	37.22	19,644,529.90
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,727	563.40	4,353,391.80
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	128.00	914,816.00
SEATTLE GENETICS INC	11,471	157.67	1,808,632.57

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	11.29	1,224,784.36
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,248	333.01	12,736,966.48
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,535	271.63	6,664,442.05
WATERS CORP	6,363	186.98	1,189,753.74
ZOETIS INC	45,448	125.47	5,702,360.56
BANK OF AMERICA CORP	821,173	23.57	19,355,047.61
CITIGROUP	208,268	46.32	9,646,973.76
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	22.20	888,222.00
COMERICA INC	14,360	33.89	486,660.40
EAST WEST BANCORP INC	13,827	35.09	485,189.43
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	18.09	1,229,392.39
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	103.91	1,649,259.52
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	8.65	856,453.80
JPMORGAN CHASE & CO	300,112	92.70	27,820,382.40
KEY CORP	94,322	11.28	1,063,952.16
M & T BANK CORP	11,742	104.87	1,231,383.54
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	12.06	442,843.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,823	105.03	4,392,669.69
REGIONS FINL CORP	92,434	10.32	953,918.88
SIGNATURE BANK	5,223	103.05	538,230.15
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	185.85	918,656.55
TRUIST FINANCIAL CORP	128,020	36.24	4,639,444.80
US BANCORP	141,597	34.75	4,920,495.75
WELLS FARGO & CO	386,720	25.43	9,834,289.60
ZIONS BANCORPORATION	15,186	30.72	466,513.92
ALLY FINANCIAL INC	36,028	15.78	568,521.84
AMERICAN EXPRESS	66,370	89.50	5,940,115.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	125.61	1,488,478.50
BANK NEW YORK CO	79,248	35.34	2,800,624.32
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	125,861	176.83	22,256,000.63
BLACKROCK INC	11,048	498.78	5,510,521.44
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,958	52.87	3,328,589.46
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44,494	62.20	2,767,526.80
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	100.18	1,063,110.16
CME GROUP INC	34,191	181.53	6,206,692.23
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,078	42.72	1,242,212.16
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	41.21	869,860.68
EATON VANCE CORP	10,061	37.33	375,577.13
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	17.85	717,837.75
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	276.08	1,002,998.64
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	19.20	500,544.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,411	185.39	5,637,895.29

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53,142	93.52	4,969,839.84
INVESCO LTD	30,943	7.98	246,925.14
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	14.10	362,454.60
KKR & CO INC -A	47,403	26.66	1,263,763.98
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	484.32	1,740,161.76
MOODY'S CORP	16,220	251.75	4,083,385.00
MORGAN STANLEY	115,860	40.08	4,643,668.80
MSCI INC	7,909	333.58	2,638,284.22
NASDAQ INC	10,979	107.59	1,181,230.61
NORTHERN TRUST CORP	19,520	75.99	1,483,324.80
PRICE T ROWE GROUP INC	21,808	114.06	2,487,420.48
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	66.83	799,821.44
S&P GLOBAL INC	23,319	297.65	6,940,900.35
SCHWAB (CHARLES) CORP	110,150	36.51	4,021,576.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	51.90	636,345.90
STATE STREET CORP	34,742	60.22	2,092,163.24
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	18.62	988,628.90
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	37.89	980,479.53
VOYA FINANCIAL INC	12,505	44.89	561,349.45
AFLAC	68,601	36.26	2,487,472.26
ALLEGHANY CORP	1,276	530.50	676,918.00
ALLSTATE CORP	30,932	100.79	3,117,636.28
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	65.74	461,034.62
AMERICAN INT'L GROUP	83,130	27.65	2,298,544.50
AON PLC	22,349	189.76	4,240,946.24
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	25.95	1,006,756.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	86.40	1,540,771.20
ASSURANT INC	5,819	98.80	574,917.20
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	27.30	364,373.10
BROWN & BROWN INC	22,945	37.60	862,732.00
CHUBB LTD	43,249	101.95	4,409,235.55
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	55.73	827,646.23
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	168.73	365,469.18
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	176.80	694,116.80
FNF GROUP	24,961	25.84	644,992.24
GLOBE LIFE INC	9,867	77.75	767,159.25
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	36.35	1,253,384.35
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	36.65	652,003.50
LOEWS CORP	25,707	31.02	797,431.14
MARKEL CORP	1,312	869.71	1,141,059.52
MARSH & MCLENNAN COS	48,167	103.98	5,008,404.66
METLIFE INC	74,667	35.22	2,629,771.74

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	38.21	1,016,959.15
PROGRESSIVE CORP	55,794	74.27	4,143,820.38
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,690	58.98	2,222,956.20
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	95.01	515,999.31
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,122	160.37	821,415.14
TRAVELERS COS INC/THE	24,049	97.34	2,340,929.66
UNUM GROUP	18,574	15.52	288,268.48
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	197.35	2,371,357.60
WR BERKLEY CORP	14,085	51.73	728,617.05
CBRE GROUP INC-A	30,208	41.60	1,256,652.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.11	405,657.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	104.18	467,143.12
WEYERHAEUSER CO	69,607	19.85	1,381,698.95
ACCENTURE PLC-CL A	60,578	188.56	11,422,587.68
ADOBE INC	46,170	367.51	16,967,936.70
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	15,447	101.15	1,562,464.05
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	47.18	189,474.88
ANSYS INC	8,044	263.02	2,115,732.88
AUTODESK INC	20,964	184.29	3,863,455.56
AUTOMATIC DATA PROCESS	41,287	146.00	6,027,902.00
BLACK KNIGHT INC	14,413	72.70	1,047,825.10
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	72.98	980,705.24
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	116.81	1,281,522.51
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,369	82.46	2,174,387.74
CDK GLOBAL INC	10,687	40.78	435,815.86
CHECK POINT SOFTWARE TECH	11,974	106.99	1,281,098.26
CITRIX SYSTEMS INC	12,443	150.98	1,878,644.14
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	52,296	57.16	2,989,239.36
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	109.06	338,086.00
DOCUSIGN INC	10,116	116.56	1,179,120.96
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	21.88	529,867.96
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	17.65	414,739.70
EPAM SYSTEMS INC	5,266	223.30	1,175,897.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	58,635	128.23	7,518,766.05
FISERV INC	55,147	104.78	5,778,302.66
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,052	240.00	1,932,480.00
FORTINET INC	13,898	136.84	1,901,802.32
GARTNER INC	8,569	122.58	1,050,388.02
GLOBAL PAYMENTS INC	28,687	175.04	5,021,372.48
GODADDY INC - CLASS A	16,351	75.05	1,227,142.55
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	97.24	770,432.52
INTL BUSINESS MACHINES CORP	84,481	122.99	10,390,318.19

INTUIT INC	24,837	280.36	6,963,301.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	182.79	1,345,334.40
LEIDOS HOLDINGS	12,829	102.70	1,317,538.30
MASTERCARD INC-CLASS A	85,613	282.44	24,180,535.72
MICROSOFT CORP	692,070	184.68	127,811,487.60
MONGODB INC	4,623	176.49	815,913.27
NORTONLIFELOCK INC	59,628	21.28	1,268,883.84
OKTA INC	10,083	169.38	1,707,858.54
ORACLE CORP	219,169	53.57	11,740,883.33
PALO ALTO NETWORKS INC	9,363	213.96	2,003,307.48
PAYCHEX INC	30,214	67.11	2,027,661.54
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	272.03	1,293,502.65
PAYPAL HOLDINGS INC	106,402	144.96	15,424,033.92
PTC INC	9,984	71.55	714,355.20
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,050	266.73	1,880,446.50
SABRE CORP	24,114	6.72	162,166.65
SALESFORCE.COM INC	79,469	175.90	13,978,597.10
SERVICENOW INC	17,998	377.26	6,789,925.48
SPLUNK INC	14,752	153.24	2,260,596.48
SQUARE INC - A	33,186	76.05	2,523,795.30
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	58.50	1,273,837.50
SYNOPSYS INC	14,359	160.17	2,299,881.03
TWILIO INC - A	11,282	179.69	2,027,262.58
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	330.23	1,226,143.99
VERISIGN INC	10,096	210.04	2,120,563.84
VISA INC-CLASS A SHARES	163,330	185.09	30,230,749.70
VMWARE INC-CLASS A	7,867	140.31	1,103,818.77
WESTERN UNION CO	38,757	19.93	772,427.01
WIX.COM LTD	5,010	159.95	801,349.50
WORKDAY INC-CLASS A	15,669	165.55	2,594,002.95
AMPHENOL CORPORATION	27,679	89.56	2,478,931.24
APPLE INC	424,286	310.13	131,583,817.18
ARISTA NETWORKS INC	4,940	218.01	1,076,969.40
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	65.46	513,140.94
CDW CORP/DE	13,742	108.54	1,491,556.68
CISCO SYSTEMS	404,599	42.99	17,393,711.01
COGNEX CORP	16,230	57.52	933,549.60
CORNING	72,399	21.62	1,565,266.38
DELL TECHNOLOGIES -C	15,558	43.65	679,106.70
F5 NETWORKS INC	5,350	149.02	797,257.00
FLEX LTD	48,956	10.01	490,049.56
FLIR SYSTEMS INC	11,686	48.09	561,979.74

HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	10.25	1,268,734.75
HP INC	141,556	15.66	2,216,766.96
IPG PHOTONICS CORP	3,207	152.06	487,656.42
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	23.68	741,278.72
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	100.69	1,774,560.56
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,366	131.27	2,148,364.82
NETAPP INC	20,586	44.90	924,311.40
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	51.06	1,166,006.16
TE CONNECTIVITY LTD	31,955	76.75	2,452,546.25
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	37.00	883,708.00
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	44.20	1,257,666.80
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	18.13	303,097.34
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	242.92	1,253,953.04
AT&T INC	696,675	29.79	20,753,948.25
CENTURYLINK INC	93,962	9.94	933,982.28
T-MOBILE US INC	41,028	98.52	4,042,078.56
VERIZON COMMUNICATIONS	394,419	57.00	22,481,883.00
AES CORP	61,761	12.87	794,864.07
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	47.99	1,159,246.44
AMEREN CORPORATION	23,120	70.86	1,638,283.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,150	79.86	3,765,399.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	118.03	1,997,303.66
ATMOS ENERGY CORP	11,419	97.33	1,111,411.27
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	18.59	895,331.58
CMS ENERGY CORP	26,742	55.29	1,478,565.18
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	74.18	2,354,844.10
DOMINION ENERGY INC	78,536	78.40	6,157,222.40
DTE ENERGY COMPANY	18,360	101.26	1,859,133.60
DUKE ENERGY CORP	69,920	81.78	5,718,057.60
EDISON INTL	33,630	57.05	1,918,591.50
ENERGY CORP	18,696	95.01	1,776,306.96
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	40.30	839,610.20
EVERGY INC	21,330	57.50	1,226,475.00
EVERSOURCE ENERGY	30,920	77.79	2,405,266.80
EXELON CORP	92,804	37.43	3,473,653.72
FIRSTENERGY CORP	50,559	40.60	2,052,695.40
NEXTERA ENERGY INC	46,622	229.73	10,710,472.06
NISOURCE INC	35,781	23.27	832,623.87
NRG ENERGY INC	23,078	32.77	756,266.06
OGE ENERGY CORP	19,225	31.05	596,936.25
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	73.87	795,727.64
PPL CORPORATION	69,111	26.11	1,804,488.21



	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	48.77	2,306,333.30
	SEMPRA ENERGY	26,914	124.23	3,343,526.22
	SOUTHERN CO	100,071	55.41	5,544,934.11
	UGI CORP	18,019	30.89	556,606.91
	VISTRA ENERGY CORP	35,087	18.90	663,144.30
	WEC ENERGY GROUP INC	30,120	85.68	2,580,681.60
	XCEL ENERGY INC	50,065	60.31	3,019,420.15
	ADVANCED MICRO DEVICES	100,963	53.19	5,370,221.97
	ANALOG DEVICES	35,161	109.83	3,861,732.63
	APPLIED MATERIALS	88,168	53.81	4,744,320.08
	BROADCOM INC	37,839	275.03	10,406,860.17
	INTEL CORP	414,846	59.67	24,753,860.82
	KLA CORP	15,075	171.50	2,585,362.50
	LAM RESEARCH CORP	13,850	265.40	3,675,790.00
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	60,583	26.85	1,626,653.55
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,878	54.12	1,400,517.36
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	89.70	2,049,106.80
	MICRON TECHNOLOGY	105,648	48.25	5,097,516.00
	NVIDIA CORP	55,452	312.50	17,328,750.00
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,067	104.84	2,837,704.28
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	17.12	616,251.52
	QORVO INC	10,609	103.00	1,092,727.00
	QUALCOMM	108,933	80.56	8,775,642.48
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,107	111.22	1,791,420.54
	TERADYNE INC	16,048	65.09	1,044,564.32
	TEXAS INSTRUMENTS	89,169	115.00	10,254,435.00
	XILINX INC	23,543	86.86	2,044,944.98
	アメリカドル 小計	28,685,388		2,384,971,895.83 (255,072,744,259)
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	14.97	614,698.14
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	122,328	22.84	2,793,971.52
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	5.38	520,063.08
	ENBRIDGE	193,997	44.65	8,661,966.05
	HUSKY ENERGY INC	31,439	4.09	128,585.51
	IMPERIAL OIL	24,763	21.20	524,975.60
	INTER PIPELINE LTD	35,455	11.02	390,714.10
	KEYERA CORP	18,607	20.79	386,839.53
	OVINTIV INC	23,486	8.05	189,062.30
	PARKLAND FUEL CORP	11,000	33.30	366,300.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	31.83	1,712,963.28
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	9.59	175,976.50
	SUNCOR ENERGY	147,329	23.83	3,510,850.07

TC ENERGY CORP	88,526	64.22	5,685,139.72
AGNICO EAGLE MINES	23,423	91.78	2,149,762.94
BARRICK GOLD CORP	170,934	38.13	6,517,713.42
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	44.00	578,116.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	8.89	505,841.00
FRANCO-NEVADA CORP	18,244	199.40	3,637,853.60
KINROSS GOLD CORP	125,340	9.79	1,227,078.60
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,848	59.78	1,604,973.44
LUNDIN MINING CORP	62,243	6.34	394,620.62
METHANEX CORP	7,099	22.16	157,313.84
NUTRIEN LTD	55,504	49.40	2,741,897.60
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	12.74	581,924.98
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	40.11	173,555.97
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	45,525	60.38	2,748,799.50
CAE INC	25,999	22.03	572,757.97
WSP GLOBAL INC	9,471	88.54	838,562.34
THOMSON REUTERS CORP	18,789	95.04	1,785,706.56
AIR CANADA	11,591	17.05	197,626.55
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69,824	114.14	7,969,711.36
CP RAILWAY LIMITED	13,160	319.16	4,200,145.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	55.25	1,545,784.50
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	19.22	339,405.98
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,485	71.97	1,834,155.45
QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.91	454,632.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	22.98	1,036,099.26
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	100.09	541,386.81
DOLLARAMA INC	26,700	43.95	1,173,465.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	84,121	40.50	3,406,900.50
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	30.97	472,385.41
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	69.26	1,240,238.82
METRO INC	24,937	57.67	1,438,116.79
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	97.89	673,776.87
SAPUTO INC	24,489	34.59	847,074.51
AURORA CANNABIS INC	53,000	0.91	48,230.00
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	23.37	649,686.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	21.34	349,976.00
CRONOS GROUP INC	15,900	7.52	119,568.00
BANK MONTREAL	61,534	68.34	4,205,233.56
BANK NOVA SCOTIA	116,919	52.95	6,190,861.05
CANADIAN IMPERIAL BANK	42,951	83.23	3,574,811.73
NATIONAL BANK OF CANADA	33,228	55.50	1,844,154.00
ROYAL BANK OF CANADA	137,232	85.34	11,711,378.88

	TORONTO-DOMINION BANK	173,449	57.03	9,891,796.47	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	126,501	46.50	5,882,296.50	
	CI FINANCIAL CORP	18,671	14.63	273,156.73	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	28.09	215,871.65	
	ONEX CORP	6,603	66.00	435,798.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	348.09	926,963.67	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	21.55	512,631.40	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	41.68	343,026.40	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	138.04	1,800,455.72	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	190,115	17.08	3,247,164.20	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	20.97	1,081,024.47	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	56,979	48.41	2,758,353.39	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.55	258,070.00	
	CGI INC - CL A	23,396	90.65	2,120,847.40	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,978	1,465.09	2,897,948.02	
	OPEN TEXT CORP	24,643	55.11	1,358,075.73	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,812	989.06	9,704,656.72	
	BCE INC	15,355	56.75	871,396.25	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	56.92	1,993,224.56	
	TELUS CORP	32,908	22.85	751,947.80	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.00	984,542.00	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	16.45	401,297.75	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	37.71	197,638.11	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.29	333,361.96	
	EMERA INC	23,704	54.41	1,289,734.64	
	FORTIS INC	42,633	53.25	2,270,207.25	
	HYDRO ONE LTD	32,299	25.57	825,885.43	
	カナダドル 小計	3,605,135		161,570,760.63 (12,398,940,170)	
ユーロ	ENI	248,488	8.63	2,144,699.92	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	10.26	504,730.44	
	NESTE OIL OYJ	40,117	31.28	1,254,859.76	
	OMV AG	14,984	30.94	463,604.96	
	REPSOL SA	133,012	8.63	1,148,425.60	
	TENARIS SA	40,648	6.23	253,237.04	
	TOTAL SA	229,526	32.98	7,570,915.11	
	VOPAK	6,360	49.87	317,173.20	
	AIR LIQUIDE	45,301	119.90	5,431,589.90	
	AKZO NOBEL	19,521	70.72	1,380,525.12	
	ARCELORMITTAL	66,229	10.29	681,761.32	
	ARKEMA	7,535	75.80	571,153.00	
	BASF SE	88,020	46.24	4,070,044.80	

COVESTRO AG	15,098	30.99	467,887.02
CRH PLC	80,003	27.08	2,166,481.24
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	22.36	441,699.44
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	35.06	202,015.72
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	44.25	656,360.25
KONINKLIJKE DSM NV	17,129	114.90	1,968,122.10
LANXESS	7,293	46.81	341,385.33
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	29.22	571,689.30
SOLVAY SA	6,906	73.76	509,386.56
STORA ENSO OYJ R	54,792	10.64	582,986.88
SYMRISE AG	12,476	95.10	1,186,467.60
THYSSEN KRUPP	33,044	5.28	174,472.32
UMICORE	17,605	36.97	650,856.85
UPM KYMMENE OYJ	50,623	25.33	1,282,280.59
VOESTALPINE AG	12,422	18.95	235,459.01
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,018	23.74	522,707.32
AIRBUS SE	56,107	56.07	3,145,919.49
ALSTOM	18,760	36.32	681,363.20
ANDRITZ AG	5,242	30.86	161,768.12
BOUYGUES ORD	19,381	27.61	535,109.41
BRENTAG AG	15,254	44.52	679,108.08
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	5.17	480,944.42
DASSAULT AVIATION SA	213	722.50	153,892.50
EIFFAGE	7,209	77.64	559,706.76
FERROVIAL SA	46,063	23.50	1,082,480.50
GEA GROUP AG	13,382	22.20	297,080.40
HOCHTIEF AG	2,222	70.95	157,650.90
KINGSPAN GROUP PLC	15,306	49.50	757,647.00
KION GROUP AG	5,887	45.96	270,566.52
KNORR-BREMSE AG	4,123	81.35	335,406.05
KONE OYJ-B	32,286	56.40	1,820,930.40
LEGRAND SA	24,584	59.90	1,472,581.60
LEONARDO SPA	35,425	6.10	216,092.50
METSO OYJ	9,561	26.41	252,506.01
MTU AERO ENGINES AG	4,753	124.20	590,322.60
PRYSMIAN SPA	21,155	18.14	383,751.70
SAFRAN SA	31,568	81.12	2,560,796.16
SAINT-GOBAIN	45,357	25.40	1,152,067.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,023	80.42	4,264,109.66
SIEMENS	73,180	88.33	6,463,989.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	13.60	341,387.20
THALES SA	9,665	69.92	675,776.80

VINCI S.A.	49,409	76.80	3,794,611.20
WARTSILA OYJ	34,386	6.70	230,661.28
BUREAU VERITAS SA	25,073	18.73	469,742.65
RANDSTAD NV	12,365	36.36	449,591.40
TELEPERFORMANCE	5,732	225.10	1,290,273.20
WOLTERS KLUWER	25,709	67.48	1,734,843.32
ADP	2,382	81.00	192,942.00
AENA SME SA	6,542	107.90	705,881.80
ATLANTIA SPA	51,427	13.95	717,406.65
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	7.77	181,009.61
DEUTSCHE POST AG-REG	91,789	26.78	2,458,109.42
FRAPORT AG	3,561	37.76	134,463.36
GETLINK	44,101	11.40	502,751.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,973	51.42	1,644,051.66
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	42.48	212,017.68
CONTINENTAL AG	9,928	79.12	785,503.36
DAIMLER AG	87,443	31.65	2,768,008.16
FAURECIA	5,945	32.90	195,590.50
FERRARI NV	11,268	146.45	1,650,198.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	111,379	7.77	865,414.83
MICHELIN	16,459	89.28	1,469,459.52
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	19.08	196,371.36
PEUGEOT SA	52,883	13.42	709,954.27
PIRELLI & C SPA	39,097	3.66	143,446.89
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	47.00	659,316.00
RENAULT SA	17,362	17.52	304,286.41
VALEO SA	19,350	20.70	400,545.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,999	128.92	2,320,431.08
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	139.00	451,889.00
ADIDAS AG	17,294	207.90	3,595,422.60
ESSILORLUXOTTICA	27,287	110.70	3,020,670.90
HERMES INTERNATIONAL	3,057	679.80	2,078,148.60
KERING	7,275	447.50	3,255,562.50
LVMH	26,576	352.25	9,361,396.00
MONCLER SPA	15,736	32.78	515,826.08
PUMA SE	7,720	60.10	463,972.00
SEB SA	2,075	112.00	232,400.00
ACCOR	17,931	22.97	411,875.07
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,262	114.05	828,231.10
SODEXO	8,135	65.46	532,517.10
ALTICE NV -A	50,000	3.74	187,000.00
BOLLORE	61,805	2.53	156,366.65

EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	9.22	110,490.57
JC DECAUX SA	9,522	19.10	181,870.20
PUBLICIS GROUPE	21,469	26.24	563,346.56
SES	31,369	6.14	192,605.66
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	35.54	177,628.92
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	73.90	688,082.90
VIVENDI	77,307	19.96	1,543,047.72
DELIVERY HERO SE	11,471	87.42	1,002,794.82
INDITEX	101,980	23.12	2,357,777.60
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	98.08	1,115,365.76
PROSUS	45,890	73.60	3,377,504.00
ZALANDO SE	13,985	53.40	746,799.00
CARREFOUR	59,235	13.29	787,529.32
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,810	35.30	205,093.00
COLRUYT SA	5,424	55.46	300,815.04
JERONIMO MARTINS	24,901	15.45	384,720.45
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	22.64	2,337,896.96
METRO AG	13,712	7.62	104,485.44
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,855	39.96	2,911,650.07
DANONE (GROUPE)	59,282	64.06	3,797,604.92
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	64,414	7.19	463,394.31
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	69.95	748,534.95
HEINEKEN NV	24,387	75.00	1,829,025.00
KERRY GROUP PLC-A	14,641	101.50	1,486,061.50
PERNOD-RICARD	19,918	136.70	2,722,790.60
REMY COINTREAU	2,382	100.30	238,914.60
BEIERSDORF AG	9,190	94.28	866,433.20
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	71.30	726,547.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,238	79.60	1,372,144.80
LOREAL	24,042	253.50	6,094,647.00
UNILEVER NV	140,583	45.00	6,326,235.00
BIOMERIEUX	4,175	120.90	504,757.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	95.30	326,879.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	71.78	1,434,523.30
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,407	40.17	1,623,149.19
KONINKLIJKE PHILIPS	87,231	39.60	3,454,347.60
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	286.40	929,654.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,846	40.84	606,310.64
BAYER	94,130	57.99	5,458,598.70
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	563.20	652,185.60
GALAPAGOS NV	4,368	201.40	879,715.20
GRIFOLS SA	27,685	29.22	808,955.70

IPSEN	2,722	68.50	186,457.00
MERCK KGAA	12,078	106.10	1,281,475.80
ORION OYJ-CLASS B	9,854	45.33	446,681.82
QIAGEN N.V.	21,801	39.45	860,049.45
RECORDATI SPA	11,472	41.40	474,940.80
SANOFI	107,940	89.57	9,668,185.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	236.00	708,944.00
UCB (GROUPE)	12,416	84.30	1,046,668.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	53,189	6.81	362,642.60
AIB GROUP PLC	70,200	1.08	76,167.00
BANCO BILBAO VIZCAYA	647,435	2.72	1,765,555.24
BANCO DE SABADELL SA	449,651	0.33	148,879.44
BANCO SANTANDER SA	1,599,817	1.99	3,196,434.36
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	1.64	138,096.00
BANKIA SA	110,053	0.91	100,148.23
BANKINTER SA	58,881	3.51	206,907.83
BNP PARIBAS	110,192	28.81	3,175,182.48
CAIXABANK	328,697	1.65	542,350.05
COMMERZBANK AG	80,494	3.24	261,122.53
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	7.26	780,181.38
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	19.61	540,451.60
FINECOBANK SPA	53,120	9.67	514,095.36
ING GROEP NV-CVA	377,830	5.07	1,915,598.10
INTESA SANPAOLO	1,460,677	1.41	2,065,397.27
KBC GROEP NV	24,002	48.81	1,171,537.62
MEDIOBANCA	53,990	5.19	280,532.04
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	15.83	197,716.70
SOCIETE GENERALE	79,076	13.26	1,049,180.36
UNICREDIT SPA	185,348	6.58	1,219,589.84
AMUNDI SA	6,226	60.00	373,560.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	190,535	6.53	1,245,527.29
DEUTSCHE BOERSE	18,261	148.55	2,712,671.55
EURAZEO SA	3,357	44.30	148,715.10
EXOR NV	10,345	48.50	501,732.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,222	71.04	584,090.88
NATIXIS	69,996	2.17	152,171.30
WENDEL	2,023	75.15	152,028.45
AEGON	166,267	2.19	365,621.13
AGEAS	16,065	32.66	524,682.90
ALLIANZ SE-REG	39,899	157.68	6,291,274.32
ASSICURAZIONI GENERALI	109,307	12.97	1,418,258.32
AXA	185,927	16.22	3,016,851.50

CNP ASSURANCES	11,830	9.21	108,954.30
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	139.00	804,671.00
MAPFRE SA	90,939	1.61	146,957.42
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,866	191.05	2,649,099.30
NN GROUP NV	27,631	25.75	711,498.25
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.39	340,566.93
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	30.06	1,294,834.50
SCOR SE	13,354	24.20	323,166.80
AROUNDTOWN SA	111,346	5.07	564,969.60
DEUTSCHE WOHNEN SE	33,768	38.39	1,296,353.52
VONOVIA SE	49,525	48.60	2,406,915.00
ADYEN NV	1,040	981.00	1,020,240.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	40.69	1,704,259.96
ATOS SE	9,750	66.14	644,865.00
CAPGEMINI SA	15,470	88.96	1,376,211.20
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	140.35	1,756,480.25
EDENRED	22,756	39.43	897,269.08
SAP SE	93,897	107.74	10,116,462.78
WIRECARD AG	11,369	84.18	957,042.42
WORLDLINE SA	12,702	66.14	840,110.28
INGENICO GROUP	6,281	123.50	775,703.50
NOKIA OYJ	545,632	3.29	1,797,584.62
CELLNEX TELECOM SA	24,602	51.20	1,259,622.40
DEUTSCHE TELEKOM	319,355	13.66	4,362,389.30
ELISA A	15,574	54.62	850,651.88
ILIAD SA	1,253	143.30	179,554.90
KPN (KON.)	354,332	2.11	749,766.51
ORANGE	188,105	10.72	2,017,426.12
PROXIMUS	13,141	18.18	238,903.38
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.34	294,982.99
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.34	164,034.28
TELEFONICA	438,199	4.21	1,847,008.78
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.74	183,623.51
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	31.95	303,940.35
E.ON SE	216,142	9.17	1,982,454.42
ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	7.20	441,496.80
ENAGAS	25,299	20.59	520,906.41
ENDESA	31,750	20.28	643,890.00
ENEL	784,622	6.20	4,864,656.40
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	4.12	972,905.21
ENGIE	171,054	9.79	1,675,987.09
FORTUM OYJ	41,901	15.59	653,236.59



	IBERDROLA SA	590,508	8.80	5,196,470.40
	NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	16.63	502,127.47
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.50	614,296.00
	RWE STAMM	56,470	27.13	1,532,031.10
	SNAM SPA	203,694	4.02	820,072.04
	SUEZ	28,043	10.30	288,983.11
	TERNA SPA	130,230	5.77	752,208.48
	UNIPER SE	20,192	25.22	509,242.24
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	19.63	1,034,116.54
	VERBUND AG	7,463	44.66	333,297.58
	ASML HOLDING NV	40,714	278.40	11,334,777.60
	INFINEON TECHNOLOGIES	122,254	18.31	2,238,470.74
	STMICROELECTRONICS	66,237	23.38	1,548,621.06
	ユーロ 小計	18,373,486		317,279,728.92 (36,804,448,554)
イギリスポンド	BP PLC	1,938,116	3.15	6,122,508.44
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	399,839	13.20	5,280,273.83
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	357,320	12.63	4,515,095.52
	ANGLO AMERICAN PLC	96,044	14.67	1,408,965.48
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.05	288,927.64
	BHP GROUP PLC	202,849	13.76	2,792,419.33
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,429	49.66	666,884.14
	EVRAZ PLC	43,000	2.70	116,100.00
	GLENCORE PLC	1,033,004	1.48	1,530,705.32
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	19.55	329,378.40
	MONDI PLC	47,780	13.61	650,285.80
	RIO TINTO PLC REG	107,837	37.25	4,017,467.43
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	22.16	931,185.36
	BAE SYSTEMS PLC	308,746	5.12	1,581,397.01
	BUNZL PLC	33,283	17.30	575,962.31
	DCC PLC	9,127	58.28	531,921.56
	FERGUSON PLC	22,288	57.00	1,270,416.00
	MEGGITT PLC	66,268	2.57	170,772.63
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	0.96	392,146.56
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	2.87	427,850.77
	SMITHS GROUP PLC	37,146	12.50	464,325.00
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	93.70	679,793.50
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	9.62	178,908.83
	EXPERIAN PLC	87,481	26.01	2,275,380.81
	G4S PLC	132,555	0.96	128,525.32
	INTERTEK GROUP PLC	15,404	47.22	727,376.88
	RELX PLC	185,932	18.59	3,456,475.88

RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	4.82	872,919.18
EASYJET PLC	11,633	5.31	61,817.76
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.30	512,057.45
BURBERRY GROUP PLC	40,410	13.85	559,678.50
PERSIMMON PLC	31,506	22.82	718,966.92
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.51	411,035.32
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	42.68	452,365.32
CARNIVAL PLC	26,721	9.37	250,375.77
COMPASS GROUP PLC	151,733	12.87	1,952,803.71
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,615	97.50	449,962.50
GVC HOLDINGS PLC	59,240	7.92	469,654.72
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	35.94	576,513.54
TUI AG-DI	37,945	2.65	100,554.25
WHITBREAD PLC	11,623	28.58	332,185.34
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	4.79	466,946.15
INFORMA PLC	117,961	4.54	535,896.82
ITV PLC	295,435	0.73	216,612.94
PEARSON	66,305	4.49	298,107.28
WPP PLC	113,065	6.05	684,043.25
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	5.54	177,344.00
KINGFISHER PLC	170,994	1.56	267,007.13
MARKS & SPENCER GROUP PLC	205,228	0.95	195,212.87
NEXT PLC	13,238	48.82	646,279.16
OCADO GROUP PLC	44,612	18.64	831,567.68
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.87	391,725.65
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.92	285,841.54
TESCO	919,600	2.37	2,182,210.80
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	36,715	17.66	648,386.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO	219,338	29.77	6,529,692.26
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	18.96	340,611.40
DIAGEO	224,511	27.78	6,236,915.58
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	16.27	1,487,338.32
RECKITT BENCKISER PLC	67,934	66.48	4,516,252.32
UNILEVER PLC	106,209	40.83	4,336,513.47
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	16.57	1,376,570.32
ASTRAZENECA	125,500	85.59	10,741,545.00
GLAXOSMITHKLINE	477,503	16.74	7,996,265.23
BARCLAYS	1,669,454	1.05	1,759,938.40
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,941,394	4.12	8,012,133.03
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.31	2,076,419.23
ROYAL BANK OF SCOTLAND	479,086	1.14	546,637.12
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	4.13	1,053,177.84

	3I GROUP PLC	88,121	7.65	674,125.65
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.05	497,838.95
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	30,265	78.28	2,369,144.20
	M&G PLC	229,107	1.31	301,504.81
	SCHRODERS PLC	11,794	27.91	329,170.54
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	8.49	380,017.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.19	512,152.76
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	24.15	392,558.25
	AVIVA PIC	381,270	2.47	942,880.71
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.80	319,084.29
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.05	1,127,864.90
	PRUDENTIAL	246,816	11.23	2,771,743.68
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	3.93	340,613.56
	AVEVA GROUP PLC	6,717	39.10	262,634.70
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	4.76	138,610.98
	SAGE GROUP PLC	111,321	6.42	714,680.82
	HALMA PLC	37,159	22.33	829,760.47
	BT GROUP PLC	817,227	1.04	857,679.73
	VODAFONE GROUP PLC	2,514,733	1.12	2,839,636.50
	CENTRICA PLC	440,558	0.39	175,826.69
	NATIONAL GRID PLC	334,044	9.21	3,077,213.32
	SEVERN TRENT PLC	25,000	24.17	604,250.00
	SSE PLC	100,354	12.35	1,239,873.67
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.99	604,099.39
	イギリスポンド 小計	28,179,667		136,372,497.29 (18,117,086,264)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.88	311,163.23
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	638.50	519,100.50
	GIVAUDAN-REG	864	3,322.00	2,870,208.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,534	39.65	1,884,723.10
	SIKA AG-BR	12,290	166.75	2,049,357.50
	ABB LTD	176,891	17.76	3,141,584.16
	GEBERIT AG-REG	3,423	432.70	1,481,132.10
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	210.00	443,520.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	214.20	807,105.60
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	41.64	550,647.36
	SGS SA	586	2,180.00	1,277,480.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	136.80	693,165.60
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	48,793	55.76	2,720,697.68
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	187.15	464,693.45
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	36.26	142,791.88
	DUFREY AG-REG	3,825	27.66	105,799.50

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,852.00	518,560.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	81,800.00	818,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,830.00	814,320.00
	NESTLE SA - REGISTERED	283,950	105.00	29,814,750.00
	ALCON INC	39,316	52.68	2,071,166.88
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	186.70	952,916.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	744.00	754,416.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,985	445.80	3,113,913.00
	NOVARTIS	205,324	82.69	16,978,241.56
	ROCHE HOLDING GENUSS	67,131	341.25	22,908,453.75
	VIFOR PHARMA AG	4,486	152.85	685,685.10
	CREDIT SUISSE GROUP AG	241,636	8.15	1,970,299.94
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	37.58	795,831.66
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	68.85	233,883.45
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,811	788.40	1,427,792.40
	UBS GROUP AG	370,150	9.61	3,560,102.70
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	138.80	666,934.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,265	333.00	1,087,245.00
	SWISS RE LTD	28,362	66.40	1,883,236.80
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,328	291.30	4,173,746.40
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	94.30	703,289.40
	TEMENOS AG - REG	6,511	132.05	859,777.55
	SWISSCOM	2,441	500.00	1,220,500.00
	スイスフラン 小計	1,662,054		117,476,232.05 (12,945,880,771)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	226.20	3,895,616.40
	BOLIDEN AB	23,903	199.00	4,756,697.00
	ALFA LAVAL AB	25,639	187.00	4,794,493.00
	ASSA ABLOY AB-B	101,748	187.45	19,072,662.60
	ATLAS COPCO A	63,684	344.60	21,945,506.40
	ATLAS COPCO B	36,538	312.00	11,399,856.00
	EPIROC AB-A	53,833	101.35	5,455,974.55
	EPIROC AB-B	29,972	101.40	3,039,160.80
	SANDVIK AB	100,730	150.00	15,109,500.00
	SKANSKA B	28,530	184.70	5,269,491.00
	SKF AB-B	35,405	156.70	5,547,963.50
	VOLVO B	153,020	126.65	19,379,983.00
	SECURITAS B	22,844	120.00	2,741,280.00
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	137.95	2,506,551.50
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	58.30	2,256,909.60
	HENNES & MAURITZ B	77,319	132.45	10,240,901.55
	ICA GRUPPEN AB	7,959	415.90	3,310,148.10

	SWEDISH MATCH AB	16,014	620.20	9,931,882.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	312.60	17,844,771.00	
	NORDEA BANK ABP	309,938	59.60	18,472,304.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	75.38	11,737,419.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	87.44	13,149,751.84	
	SWEDBANK AB-A	86,716	108.30	9,391,342.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	203.00	3,408,776.00	
	INVESTOR AB-B SHS	43,938	483.60	21,248,416.80	
	KINNEVIK AB - B	23,604	221.00	5,216,484.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	418.20	3,044,496.00	
	ERICSSON (LM) B	298,755	83.62	24,981,893.10	
	HEXAGON AB-B SHS	26,504	472.90	12,533,741.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	8,677	239.80	2,080,744.60	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	126.90	6,346,522.80	
	TELIA CO AB	257,822	32.70	8,430,779.40	
	スウェーデンクローナ 小計	2,344,461		308,542,022.34 (3,369,278,883)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	174.85	1,802,878.35	
	EQUINOR ASA	92,158	140.75	12,971,238.50	
	NORSK HYDRO	106,150	24.10	2,558,215.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	337.10	6,226,237.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	213.40	1,487,611.40	
	MOWI ASA	40,968	180.00	7,374,240.00	
	ORKLA	69,804	84.86	5,923,567.44	
	DNB ASA	96,834	118.10	11,436,095.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	177.90	3,304,314.60	
	TELENOR ASA	71,821	150.35	10,798,287.35	
	ノルウェークローネ 小計	532,061		63,882,685.04 (666,935,231)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	611.00	6,322,017.00	
	NOVOZYMES A/S	21,895	349.40	7,650,113.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,605	593.60	10,450,328.00	
	ISS A/S	14,253	101.35	1,444,541.55	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	5,910.00	1,767,090.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	6,340.00	4,114,660.00	
	DSV PANALPINA A S	20,416	692.40	14,136,038.40	
	PANDORA A/S	8,431	272.00	2,293,232.00	
	CARLSBERG AS-B	10,388	829.80	8,619,962.40	
	COLOPLAST-B	11,223	1,052.00	11,806,596.00	
	DEMANT A/S	11,604	171.80	1,993,567.20	
	GENMAB A/S	6,320	1,820.00	11,502,400.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	242.60	1,181,704.60	

	NOVO NORDISK A/S-B	169,280	432.00	73,128,960.00
	DANSKE BANK A/S	59,378	77.26	4,587,544.28
	TRYG A/S	9,828	182.50	1,793,610.00
	ORSTED A/S	18,488	696.00	12,867,648.00
	デンマーククローネ 小計	395,275		175,660,012.43 (2,731,513,193)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	24.50	505,410.50
	OIL SEARCH LTD	118,781	2.87	340,901.47
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.53	915,740.35
	SANTOS	156,437	4.85	758,719.45
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	17.74	227,302.62
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	21.89	1,988,246.81
	WORLEY LTD	34,596	8.56	296,141.76
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.52	259,948.45
	BHP GROUP LTD	281,528	31.40	8,839,979.20
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	10.07	496,732.96
	BORAL LIMITED	81,732	2.75	224,763.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	12.04	1,621,499.04
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	2.19	329,811.81
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	21.63	935,021.64
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	27.60	2,045,104.80
	ORICA LTD	44,211	16.26	718,870.86
	RIO TINTO LTD	35,522	83.00	2,948,326.00
	SOUTH32 LTD	481,840	1.85	891,404.00
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	23.03	212,336.60
	BRAMBLES LTD	160,308	10.58	1,696,058.64
	SEEK LTD	26,358	17.41	458,892.78
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.49	859,794.59
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	3.40	289,000.00
	TRANSURBAN GROUP	262,342	13.60	3,567,851.20
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	24.98	1,317,744.96
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.34	283,263.52
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	10.76	35,109.88
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	3.14	523,896.44
	REA GROUP LTD	5,276	95.17	502,116.92
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.03	136,843.89
	WESFARMERS LTD	109,322	37.45	4,094,108.90
	COLES GROUP LTD	128,408	15.20	1,951,801.60
WOOLWORTHS GROUP LTD	120,802	34.70	4,191,829.40	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.66	399,485.80	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	9.84	694,093.92	
COCHLEAR LIMITED	6,220	181.66	1,129,925.20	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	60.91	989,665.68
	SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	25.90	1,009,815.10
	CSL LIMITED	43,340	301.18	13,053,141.20
	AUST AND NZ BANKING GROUP	271,505	15.73	4,270,773.65
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	5.89	249,936.26
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	169,116	59.60	10,079,313.60
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	275,678	16.08	4,432,902.24
	WESTPAC BANKING	338,380	15.51	5,248,273.80
	AMP LTD	343,649	1.41	484,545.09
	ASX LTD	20,270	82.30	1,668,221.00
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	4.76	209,763.68
	MACQUARIE GROUP LIMITED	32,981	105.19	3,469,271.39
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	55.00	600,160.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	5.28	1,105,394.40
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.83	763,703.80
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	7.56	961,329.60
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	8.91	1,063,444.14
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	11.43	507,217.68
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	19.91	358,380.00
	TELSTRA CORP	403,126	3.03	1,221,471.78
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.26	228,508.50
	AGL ENERGY LTD	64,235	16.49	1,059,235.15
	AUSNET SERVICES	187,145	1.95	365,868.47
	オーストラリアドル 小計	6,788,323		100,088,415.17 (6,994,178,452)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	3.40	260,589.60
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	5.68	482,516.00
	A2 MILK CO LTD	66,854	19.53	1,305,658.62
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	29.80	1,624,696.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.14	440,888.38
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.60	915,087.20
	MERCURY NZ LTD	85,000	4.80	408,000.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.70	519,556.80
	ニュージーランドドル 小計	713,761		5,956,992.60 (390,838,284)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	56.80	14,568,972.80
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	7.76	1,264,880.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	64.90	8,729,050.00
	MTR CORP	151,000	42.70	6,447,700.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	13.04	893,240.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	211,000	53.70	11,330,700.00
	SANDS CHINA LTD	242,800	31.10	7,551,080.00

	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.10	1,069,200.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	14.14	1,990,912.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	104,500	22.35	2,335,575.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	28.20	1,804,800.00	
	WH GROUP LTD	936,500	7.13	6,677,245.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	16.16	1,764,025.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	24.05	8,670,025.00	
	HANG SENG BANK	74,200	135.20	10,031,840.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	115,000	242.80	27,922,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,155,200	69.65	80,459,680.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	257,996	48.70	12,564,405.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	16.62	2,875,260.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	30.50	3,819,454.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	21.80	1,406,100.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	621,500	9.11	5,661,865.00	
	SINO LAND CO	315,400	10.90	3,437,860.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	151,000	102.40	15,462,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	49.85	2,018,925.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.55	2,073,110.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140,000	33.60	4,704,000.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	82,000	57.75	4,735,500.00	
	PCCW LTD	357,000	4.76	1,699,320.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	45.40	3,064,500.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	80.00	12,560,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	981,504	13.78	13,525,125.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	50.40	6,930,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	82.65	1,958,805.00	
	香港ドル 小計	8,210,684		292,007,554.72 (4,029,704,255)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	169,900	6.04	1,026,196.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	1.60	171,200.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	204,600	3.31	677,226.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.99	197,901.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	1.59	264,735.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	4.41	191,098.53	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	2.97	152,064.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.76	470,475.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	1.54	195,734.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	20.34	201,366.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.47	619,742.00	
	DBS GROUP	174,800	19.70	3,443,560.00	
	OCBC BANK	315,600	8.88	2,802,528.00	



	UNITED OVERSEAS BANK	120,300	19.88	2,391,564.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.81	768,123.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	2.93	654,855.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.00	342,400.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.96	330,600.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.74	404,518.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.72	2,046,100.96	
	シンガポールドル 小計	3,653,776		17,351,986.49 (1,313,024,817)	
イスラエルシ ケル	ICL LTD	67,756	12.85	870,664.60	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	483.60	1,037,805.60	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	23.01	2,262,113.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	19.43	2,732,926.65	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	11.60	1,154,200.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	71.26	890,963.78	
	AZRIELI GROUP	4,323	199.00	860,277.00	
	NICE LTD	6,172	616.90	3,807,506.80	
	イスラエルシケル 小計	431,365		13,616,457.53 (414,484,967)	
	合 計	103,575,436		355,249,058,100 (355,249,058,100)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	オーストラ リアドル	APA GROUP	114,413	1,288,290.38	
		LENLEASE GROUP	55,692	624,864.24	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	489,737.00	
		オーストラリアドル 小計	259,965	2,402,891.62 (167,914,066)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,766,205.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,747,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,513,705.00 (89,889,129)	
		投資信託受益証券合計	855,465	257,803,195 (257,803,195)	
投資証券	アメリカド ル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	587,733.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,846	1,648,592.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	42,251	10,070,948.36	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	778,280.67	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,188,046.20	

BOSTON PROPERTIES	14,788	1,285,225.08	
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	777,386.48	
CROWN CASTLE INTL CORP	39,669	6,255,801.30	
DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,639,700.46	
DUKE REALTY CORP	35,040	1,188,556.80	
EQUINIX INC	8,137	5,518,187.92	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,016,367.04	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,278,332.94	
ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,558,828.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,130,262.63	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	566,916.84	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,101	1,142,199.25	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	748,861.54	
INVITATION HOMES INC	51,458	1,282,847.94	
IRON MOUNTAIN INC	27,546	676,805.22	
KIMCO REALTY CORP	35,407	385,936.30	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	895,644.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,261,446.55	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	544,995.10	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	578,821.46	
PROLOGIS INC	70,356	6,329,929.32	
PUBLIC STORAGE	15,009	2,856,813.06	
REALTY INCOME CORP	30,146	1,653,809.56	
REGENCY CENTERS CORP	14,271	598,811.16	
SBA COMMUNICATIONS CORP	10,751	3,137,786.86	
SIMON PROPERTY GROUP	29,338	1,702,190.76	
SL GREEN REALTY CORP	8,067	391,330.17	
SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,216,251.05	
UDR INC	28,059	1,075,782.06	
VENTAS INC	34,403	1,035,530.30	
VEREIT INC	105,798	579,773.04	
VICI PROPERTIES INC	44,224	755,788.16	
VORNADO REALTY TRUST	15,390	606,519.90	
WELLTOWER INC	38,031	1,694,281.05	
WP CAREY INC	16,500	1,032,735.00	
アメリカドル 小計	1,244,559	72,674,055.23 (7,772,490,206)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	436,707.18
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	162,418.95
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	88,971.55
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	231,265.70
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	113,633.58

カナダドル 小計		51,928	1,032,996.96 (79,272,186)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	266,955.60
	GECINA SA	4,459	501,191.60
	ICADE	2,845	190,330.50
	KLEPIERRE	17,225	296,011.62
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	691,871.40
ユーロ 小計		43,186	1,946,360.72 (225,777,843)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	308,920.46
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	376,944.90
	SEGRO PLC	106,999	879,959.77
イギリスポンド 小計		244,963	1,565,825.13 (208,019,868)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	832,696.50
	GOODMAN GROUP	162,271	2,330,211.56
	GPT GROUP	167,884	673,214.84
	MIRVAC GROUP	392,919	860,492.61
	SCENTRE GROUP	486,663	1,070,658.60
	STOCKLAND	207,412	568,308.88
	VICINITY CENTERS	291,115	416,294.45
オーストラリアドル 小計		1,802,354	6,751,877.44 (471,821,195)
香港ドル	LINK REIT	199,000	13,621,550.00
香港ドル 小計		199,000	13,621,550.00 (187,977,390)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	802,820.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	386,370.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	370,555.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	418,000.00
	SUNTEC REIT	173,000	233,550.00
シンガポールドル 小計		1,110,300	2,211,295.00 (167,328,692)
投資証券合計		4,696,290	9,112,687,380 (9,112,687,380)
合計			9,370,490,575 (9,370,490,575)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

#### 4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 608銘柄	97.0%			70.0%
	投資証券 40銘柄			3.0%	2.1%
カナダドル	株式 82銘柄	99.4%			3.4%
	投資証券 5銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 236銘柄	99.4%			10.1%
	投資証券 5銘柄			0.6%	0.1%
イギリスポンド	株式 93銘柄	98.9%			5.0%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.6%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	91.6%			1.9%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.2%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 34銘柄	93.5%			1.1%
	投資信託受益証券 2銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.4%	0.1%
シンガポールドル	株式 20銘柄	88.7%			0.4%
	投資証券 5銘柄			11.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 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 5月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,102,359,961
コール・ローン	71,637,047
株式	58,587,422,422
投資信託受益証券	130,045,520
投資証券	67,822,196
派生商品評価勘定	72,368,111
未収入金	405,755
未収配当金	72,057,753
差入委託証拠金	517,783,201
流動資産合計	60,621,901,966
資産合計	60,621,901,966
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,267,913
前受金	68,838,902
未払解約金	12,664,642
未払利息	62
流動負債合計	84,771,519
負債合計	84,771,519
純資産の部	
元本等	
元本	24,915,019,168
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,622,111,279
元本等合計	60,537,130,447
純資産合計	60,537,130,447
負債純資産合計	60,621,901,966

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2020年 5月11日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	24,915,019,168口

		2020年 5月11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 (1万口当たり純資産額)	2.4297円 (24,297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 5月11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 5月11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 5月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月12日
期首元本額	21,641,099,794円
期中追加設定元本額	4,023,953,683円
期中一部解約元本額	750,034,309円
期末元本額	24,915,019,168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	7,600,596,130円
世界経済インデックスファンド	3,696,923,682円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,408,470,099円
DC 世界経済インデックスファンド	4,798,337,184円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	158,866,194円
分散投資コア戦略ファンドA	350,413,663円



区分	2020年 5月11日現在
分散投資コア戦略ファンドS	1,250,606,036円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	514,048,169円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	610,996,146円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	337,509,612円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	20,329,551円
SMT インデックスバランス・オープン	113,878,896円
SMT 世界経済インデックス・オープン	86,987,994円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	270,796,942円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	55,897,663円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,045,162円
グローバル経済コア	449,326,797円
i-SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	19,052,607円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	175,941円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	228,905円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	125,862円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	73,942円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	96,310,605円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	73,021,386円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,102,256,394
投資信託受益証券	38,703,787
投資証券	59,540,553
合計	6,200,500,734

(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 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,615,615,042	-	68,838,902
			1,684,453,944	68,838,902
合計		1,615,615,042	-	68,838,902

## (注)1.時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2020年 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	50,118,452	-	50,434,348	315,896
	アメリカドル	50,118,452	-	50,434,348	315,896
	売建	2,260,952	-	2,315,552	54,600
	ブラジルリアル	2,260,952	-	2,315,552	54,600
合計		52,379,404	-	52,749,900	261,296

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	592,047	4.98	2,951,946.34	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.61	63,648.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	46,044	65.74	3,026,932.56	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,190	139.10	1,417,429.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	146,513	4.61	676,450.52	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.90	603,709.40	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	30,595	44.24	1,353,522.80	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	4.05	62,819.55	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.43	142,719.90	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	73,003	27.37	1,998,092.11	

NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	16.93	331,794.14
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	12.30	329,861.40
POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	80.40	572,769.60
SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	11.75	455,582.75
SOUTHERN COPPER CORP	11,367	34.45	391,593.15
51JOB INC-ADR	2,701	64.84	175,132.84
BEST INC - ADR	14,126	5.26	74,302.76
DP WORLD PLC	21,152	15.99	338,220.48
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	33,291	31.15	1,037,014.65
NIO INC - ADR	77,076	3.77	290,576.52
HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	33.21	462,316.41
LUCKIN COFFEE INC - ADR	8,174	4.39	35,883.86
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,167	127.65	1,936,067.55
TAL EDUCATION GROUP- ADR	40,978	54.80	2,245,594.40
YUM CHINA HOLDINGS INC	38,070	48.55	1,848,298.50
58.COM INC-ADR	9,450	52.31	494,329.50
AUTOHOME INC-ADR	6,571	80.67	530,082.57
BAIDU INC - SPON ADR	29,357	99.77	2,928,947.89
HUYA INC-ADR	8,211	15.85	130,144.35
IQIYI INC-ADR	11,977	17.53	209,956.81
JOYY INC	6,185	55.00	340,175.00
MOMO INC-SPON ADR	15,529	22.49	349,247.21
NETEASE INC-ADR	7,551	359.77	2,716,623.27
SINA CORP	5,725	33.76	193,276.00
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	11.03	100,075.19
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	36.49	191,536.01
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	185,886	201.19	37,398,404.34
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	29.73	104,292.84
JD.COM INC-ADR	78,907	46.78	3,691,269.46
PINDUODUO INC-ADR	20,442	54.60	1,116,133.20
TRIP.COM GROUP LTD	52,406	25.12	1,316,438.72
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	17.18	815,843.84
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47,223	11.28	532,675.44
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	7,243	21.80	157,897.40
ZAI LAB LTD-ADR	3,373	65.98	222,550.54
BANCO MACRO SA-ADR	4,035	18.51	74,687.85
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	173,806	3.82	664,807.95
CREDICORP LTD	7,332	145.66	1,067,979.12
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	14,502	8.10	117,466.20
SBERBANK-SPONSORED ADR	289,100	10.56	3,054,341.50
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	0.94	355,921.83
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	26.92	54,405.32

	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.84	45,995.04	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	6,140	62.92	386,328.80	
	GLOBANT SA	3,122	124.25	387,908.50	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.76	349,121.04	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	7.11	104,630.76	
	アメリカドル 小計	3,074,826		83,025,772.68 (8,879,606,388)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,944,661	5.12	9,956,664.32	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	350,392	52.91	18,539,240.72	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	182.80	2,650,600.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	31.85	3,084,736.20	
	ALFA S.A.B. -A	359,900	9.75	3,509,025.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	48.02	1,800,750.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	250.85	5,846,059.25	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	155.16	4,822,372.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	170.23	2,890,505.40	
	ALSEA SAB DE CV	34,300	20.08	688,744.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	24.60	5,495,394.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	67.58	2,122,012.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	60.83	663,047.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	579,880	58.59	33,975,169.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	100.56	5,075,766.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	216,340	159.92	34,597,092.80	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	246.99	6,411,860.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	34.50	6,272,100.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	34.51	6,273,918.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	262,800	75.64	19,878,192.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	14.54	3,671,350.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,625,440	15.10	54,744,144.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	75.42	4,336,650.00	
	メキシコペソ 小計	8,609,655		237,305,393.09 (1,074,993,430)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	62.29	1,146,136.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	423,000	19.55	8,269,650.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	422,640	18.48	7,810,387.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	13.88	1,049,328.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	20.38	301,624.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	8.51	536,130.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	13.00	1,365,000.00	
	SUZANO SA	62,679	47.35	2,967,850.65	
	VALE SA	340,278	48.85	16,622,580.30	
	EMBRAER SA	69,700	7.54	525,538.00	

WEG SA	84,872	38.24	3,245,505.28	
CCR SA	125,600	11.42	1,434,352.00	
LOCALIZA RENT A CAR	61,952	29.65	1,836,876.80	
RUMO SA	114,200	20.30	2,318,260.00	
COGNA EDUCACAO	181,284	4.73	857,473.32	
B2W CIA DIGITAL	20,960	87.50	1,834,000.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	77,416	26.90	2,082,490.40	
LOJAS RENNER S.A.	82,907	33.90	2,810,547.30	
MAGAZINE LUIZA SA	83,400	55.54	4,632,036.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	19.05	1,447,800.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	19.75	819,625.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	19,700	65.80	1,296,260.00	
RAIA DROGASIL SA	24,500	104.68	2,564,660.00	
AMBEV SA	517,700	12.04	6,233,108.00	
BRF SA	52,500	18.74	983,850.00	
JBS SA	106,400	23.45	2,495,080.00	
NATURA &CO HOLDING SA	62,900	35.70	2,245,530.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	50.60	1,017,060.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	46,200	55.69	2,572,878.00	
HYPERA SA	35,300	28.10	991,930.00	
BANCO BRADESCO S.A.	146,698	16.63	2,439,587.74	
BANCO BRADESCO SA-PREF	483,948	17.92	8,672,348.16	
BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	27.10	2,392,930.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	529,381	22.32	11,815,783.92	
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	505,867	8.49	4,294,810.83	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	222,703	37.76	8,409,265.28	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	23.27	1,605,630.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	69,100	9.04	624,664.00	
PORTO SEGURO SA	7,300	40.65	296,745.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,963	8.18	703,177.34	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	18.84	855,336.00	
CIELO SA	99,269	3.76	373,251.44	
TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	48.19	2,520,337.00	
TIM PARTICIPACOES SA	96,100	13.16	1,264,676.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	25.40	449,580.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	22.22	746,592.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	98,092	8.63	846,533.96	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	41.00	1,422,700.00	
ENGIE BRASIL SA	29,250	38.23	1,118,227.50	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	110,400	17.60	1,943,040.00	
ブラジルリアル 小計	6,255,559		137,108,762.42 (2,558,449,506)	

チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	5,100.00	228,123,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,715.00	233,179,975.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	13,896	18,520.00	257,353,920.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	30,286	2,520.30	76,329,805.80	
	FALABELLA SA	70,837	2,405.00	170,362,985.00	
	CENCOSUD SA	137,988	947.10	130,688,434.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,564	5,551.10	125,255,020.40	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,940.00	29,511,280.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	71.00	345,247,440.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,194	28,700.00	149,067,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	33.63	211,190,380.23	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	2.26	37,853,092.56	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	4,912.00	91,127,424.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	265.22	75,914,716.26	
	COLBUN SA	1,215,680	115.10	139,924,768.00	
ENEL AMERICAS SA	3,990,008	131.80	525,883,054.40		
ENEL CHILE SA	2,561,278	59.51	152,421,653.78		
チリペソ 小計		36,440,040		2,979,434,750.23 (385,240,913)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,040.00	997,517,160.00	
	GRUPO ARGOS SA	33,752	8,880.00	299,717,760.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	24,000.00	705,024,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	24,500.00	937,811,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	805.00	244,484,940.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	20,420.00	425,144,400.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	17,800.00	899,095,800.00	
コロンビアペソ 小計		965,424		4,508,795,060.00 (123,991,864)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,794	12.64	73,236.16	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	4,358	11.62	50,639.96	
	OPAP SA	17,668	7.95	140,460.60	
	JUMBO SA	14,899	14.29	212,906.71	
	ALPHA BANK AE	129,138	0.60	78,205.97	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	291,098	0.33	96,528.09	
	NATIONAL BANK OF GREECE	53,130	1.12	59,930.64	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	11.42	299,283.94	
ユーロ 小計		542,292		1,011,192.07 (117,298,280)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	16.44	438,948.00	
イギリスポンド 小計		26,700		438,948.00 (58,314,241)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	84.95	985,674.85	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	8.05	939,877.75	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	49,783	26.50	1,319,249.50	
	KOC HOLDING AS	89,884	14.97	1,345,563.48	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	28,973	17.30	501,232.90	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	10.60	659,224.60	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	54.85	356,579.85	
	ARCELIK AS	15,358	15.40	236,513.20	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	51.00	2,184,024.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	21,501	17.04	366,377.04	
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.56	1,536,344.76	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	7.86	1,886,337.12	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	4.87	842,568.44	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.01	916,167.78	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	13.40	1,917,419.40	
	トルコリラ 小計	1,392,167		15,993,154.67	(241,336,703)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	525.00	3,918,075.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	50.30	3,458,024.40	
	CEZ AS	18,145	468.00	8,491,860.00	
	チェココルナ 小計	94,356		15,867,959.40	(67,597,507)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,042.00	86,488,910.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	6,905.00	104,804,090.00	
	OTP BANK NYRT	24,834	9,250.00	229,714,500.00	
	ハンガリーフォリント 小計	82,367		421,007,500.00	(139,732,389)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	60.66	670,717.62	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	62.82	1,929,390.66	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	259,894	3.72	967,065.57	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	77.00	1,011,164.00	
	CCC SA	3,138	41.65	130,697.70	
	LPP SA	124	6,355.00	788,020.00	
	AMREST HOLDINGS SE	7,816	24.90	194,618.40	
	CD PROJEKT SA	6,704	354.90	2,379,249.60	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	24.72	580,969.44	
	DINO POLSKA SA	4,430	169.00	748,670.00	
	BANK MILLENNIUM SA	99,381	2.30	228,576.30	
	BANK PEKAO SA	22,583	49.91	1,127,117.53	
	M BANK SA	1,663	188.30	313,142.90	
	PKO BANK POLSKI SA	104,297	21.06	2,196,494.82	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	151.00	545,865.00	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	30.09	1,866,903.96		

	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.69	372,352.02
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	3.86	245,412.04
	ポーランドズロチ 小計	773,247		16,296,427.56 (415,558,902)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	2.00	196,000.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.20	1,190,400.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,901,400	3.70	10,735,180.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	392,500	13.50	5,298,750.00
	CNOOC LTD-R	1,883,000	8.73	16,438,590.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.40	378,400.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,382,000	2.70	6,431,400.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	5.93	842,060.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	1.61	547,400.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	124,000	59.55	7,384,200.00
	BBMG CORPORATION - H	131,000	1.92	251,520.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	3.62	367,430.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	642,000	2.49	1,598,580.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	9.86	4,062,320.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	10.50	3,024,000.00
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	1.68	133,728.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	7.34	609,220.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	4.41	732,060.00
	MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	2.38	694,960.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.23	932,670.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	557,000	2.05	1,141,850.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	9.28	839,840.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.32	2,420,280.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	3.05	378,200.00
	BOC AVIATION LTD	32,500	48.95	1,590,875.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	519,000	5.05	2,620,950.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	5.55	1,087,800.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	34.80	5,550,600.00
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	79,000	11.06	873,740.00
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	8.09	1,549,235.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.59	2,175,660.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	6.20	1,054,000.00
	CITIC LTD	677,000	7.82	5,294,140.00
	CRRC CORP LTD-H	511,050	4.04	2,064,642.00
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	9.84	2,833,920.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	15.24	1,188,720.00
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	660,000	1.29	851,400.00
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.32	389,760.00



SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	12.94	491,720.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.61	258,115.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	97,500	17.82	1,737,450.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	211,800	14.94	3,164,292.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	7.66	240,646.56
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	24.50	1,526,350.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	6.50	755,300.00
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	41,500	42.65	1,769,975.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	4.56	1,755,937.44
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	36.45	4,957,200.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	10.56	1,900,800.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.11	1,093,540.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	5.16	557,280.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	308,000	2.90	893,200.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.20	1,688,579.40
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	3.45	607,200.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	474,000	2.13	1,009,620.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	232,344	4.07	945,640.08
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	9.48	1,478,880.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	64,000	8.56	547,840.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	15.14	1,936,739.08
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	1.75	192,500.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.16	542,080.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	3.50	409,500.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.51	2,763,680.00
BYD CO LTD-H	82,500	46.80	3,861,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.37	1,428,420.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	17.84	485,248.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	518,000	12.96	6,713,280.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	5.46	1,926,015.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.35	1,854,728.40
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	4.41	405,720.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	67.90	7,536,900.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	2.27	440,380.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	21.50	2,494,000.00
LI NING CO LTD	194,000	26.20	5,082,800.00
SHENZHOI INTERNATIONAL GROUP	76,900	91.35	7,024,815.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	12.56	565,200.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	27,000	13.18	355,860.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	37,000	34.10	1,261,700.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.00	1,450,000.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	37.40	1,204,280.00

TENCENT HOLDINGS LTD	612,600	418.20	256,189,320.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.91	540,501.78
MEITUAN DIANPING-CLASS B	110,200	111.60	12,298,320.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	9.25	1,054,500.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	33.40	2,271,200.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	12.30	3,185,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	27.60	7,755,600.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	40.20	5,708,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.72	1,161,120.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.84	3,155,520.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	50.80	2,336,800.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.15	652,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.55	3,108,000.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	65.85	3,160,800.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	78,500	64.95	5,098,575.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	358,000	18.24	6,529,920.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	33,500	108.40	3,631,400.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	12.28	2,996,320.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.50	1,733,400.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	20.85	2,610,420.00
3SBIO INC	119,000	8.52	1,013,880.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	9.72	972,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	498,000	15.76	7,848,480.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.78	752,850.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.40	564,400.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	14.88	1,220,160.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	64,000	30.55	1,955,200.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	94,000	38.15	3,586,100.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	3.73	303,995.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	27.50	1,526,250.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	742,000	11.88	8,814,960.00
SSY GROUP LTD	114,000	5.57	634,980.00
WUXI APPTec CO LTD-H	19,100	110.10	2,102,910.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	82,500	124.80	10,296,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,152,000	3.20	10,086,400.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,635,200	2.91	25,128,432.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.86	5,338,588.50
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.78	3,595,536.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,216,620	6.16	62,934,379.20
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	3.14	2,150,900.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	436,923	36.65	16,013,227.95

CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	5.64	3,803,616.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.33	502,830.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,988,515	5.11	35,711,311.65
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	882,000	4.54	4,004,280.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.50	1,248,000.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	11.86	1,589,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	3.89	1,277,865.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	0.86	797,220.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	12.18	1,607,760.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	14.48	3,598,280.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.33	1,519,200.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.24	730,064.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	109,400	10.52	1,150,888.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.69	2,389,668.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	209,200	12.64	2,644,288.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	831,000	15.60	12,963,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	24.50	7,266,700.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	0.88	210,320.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	12.76	2,348,146.24
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	27.05	2,607,620.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.54	2,385,060.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.24	4,990,445.12
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	605,500	78.60	47,592,300.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	28.50	1,302,450.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	8.86	1,258,120.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	9.27	1,168,020.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	14.74	2,741,640.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	5.56	3,213,680.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	409,040	25.80	10,553,232.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	347,111	31.00	10,760,441.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	25.20	4,495,680.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	5.82	1,606,320.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	865,154	10.00	8,651,540.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	204,000	7.32	1,493,280.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	9.60	1,297,920.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.99	466,440.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	11.60	1,769,000.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	150,000	11.98	1,797,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	36.50	7,190,500.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.46	826,560.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	31.05	4,114,125.00
SHUI ON LAND LTD	651,000	1.35	878,850.00

SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	1.98	1,046,610.18
SOHO CHINA LTD	291,500	3.11	906,565.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	33.75	8,471,250.00
WHARF HOLDINGS	100,000	14.48	1,448,000.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.45	838,100.00
YUZHOU PROPERTIES CO	332,086	3.41	1,132,413.26
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	4.82	631,420.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	11.68	2,826,560.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	28.20	2,594,400.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.72	1,083,880.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	39.05	2,792,075.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	17.24	1,465,400.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	3.73	880,280.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	19.14	1,282,380.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.61	525,090.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	8.60	181,460.00
LENOVO GROUP LTD	732,000	4.34	3,176,880.00
SUNNY OPTICAL TECH	75,500	115.70	8,735,350.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,109,600	11.20	12,427,520.00
ZTE CORP-H	82,908	23.70	1,964,919.60
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	654,500	59.10	38,680,950.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	2.59	3,512,040.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.70	7,762,200.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	618,000	4.98	3,077,640.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.05	1,609,475.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.92	1,781,200.00
CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.82	2,442,440.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,600	27.95	5,578,820.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	431,000	3.80	1,637,800.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.58	1,052,280.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	42.20	3,629,200.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	9.00	1,578,600.00
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	138,000	1.06	146,280.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	84,700	88.85	7,525,595.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	15.78	5,049,600.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	2.50	460,000.00
HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	2.71	1,002,700.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	5.03	1,810,800.00
TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	3.58	164,680.00
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	16.70	751,500.00
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	310,500	17.04	5,290,920.00

	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	376,453	5.50	2,070,491.50
	香港ドル 小計	97,139,093		1,024,635,600.94 (14,139,971,292)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.28	1,356,831.04
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	20.50	514,550.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	5.48	1,479,052.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	3.86	556,998.00
	GAMUDA BHD	141,520	3.35	474,092.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.18	274,276.00
	IJM CORP BHD	198,100	1.68	332,808.00
	SIME DARBY BERHAD	336,346	1.97	662,601.62
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	4.90	522,310.60
	MISC BHD	125,040	7.90	987,816.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.66	256,200.00
	GENTING BHD	307,200	4.15	1,274,880.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.38	879,886.00
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	13,200	27.66	365,112.00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	21,300	31.54	671,802.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.30	130,200.00
	IOI CORPORATION BHD	179,640	3.88	697,003.20
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	55,646	20.60	1,146,307.60
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	138.20	953,580.00
	PPB GROUP BERHAD	52,680	16.24	855,523.20
	QL RESOURCES BHD	83,200	8.10	673,920.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.77	1,178,409.42
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	7.37	1,168,882.00
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.16	1,183,188.00
	TOP GLOVE CORP BHD	168,300	7.31	1,230,273.00
	AMMB HOLDINGS BHD	265,600	2.91	772,896.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	517,519	3.44	1,780,265.36
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	13.40	821,312.80
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	46,033	12.82	590,143.06
	MALAYAN BANKING BHD	404,004	7.41	2,993,669.64
	PUBLIC BANK BERHAD	324,420	15.74	5,106,370.80
	RHB BANK BHD	206,419	4.66	961,912.54
AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.89	1,109,774.21	
DIGI.COM BERHAD	311,700	4.48	1,396,416.00	
MAXIS BHD	267,900	5.27	1,411,833.00	
TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	4.25	299,846.00	
PETRONAS GAS BHD	75,500	14.86	1,121,930.00	
TENAGA NATIONAL BHD	323,475	12.34	3,991,681.50	
YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.74	186,750.10	

	マレーシアリングット 小計	7,187,548		42,371,302.69 (1,045,723,750)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	364,800	5.50	2,006,400.00	
	IRPC PCL - NVDR	829,500	2.64	2,189,880.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	164,500	83.00	13,653,500.00	
	PTT PCL-NVDR	1,253,200	35.25	44,175,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	43.25	5,194,325.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	27.25	5,624,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	38.50	8,659,959.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	336.00	27,216,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	59.75	25,578,975.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	9.35	7,638,950.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	11.70	9,471,150.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	323,310	19.00	6,142,890.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	55,100	36.25	1,997,375.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	743,535	13.30	9,889,015.50	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	36.75	6,526,800.00	
	CP ALL PCL-NVDR	657,100	72.00	47,311,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	458,200	27.25	12,485,950.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	40.75	2,689,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	449,700	12.60	5,666,220.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,083,700	19.30	20,915,410.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	112.00	3,673,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	95.75	4,969,425.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	83.50	10,554,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	83.50	6,538,050.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	10.30	4,518,095.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127,400	66.50	8,472,100.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,147,300	0.90	2,832,570.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	45.00	4,041,000.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	50.75	3,872,225.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	45.75	10,353,225.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	6.55	5,711,600.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	193.50	23,161,950.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	53.00	12,916,100.00		
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	40.00	2,640,000.00		
TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.22	3,095,736.98		
B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	43.00	2,296,200.00		
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	36,000	269.00	9,684,000.00		
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	37.75	7,002,625.00		
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	68.00	4,637,600.00		
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	262,000	38.00	9,956,000.00		

	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	66.25	3,597,375.00	
	タイパーツ 小計	16,630,638		409,557,076.48 (1,363,825,064)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	38.30	9,113,102.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	704.00	19,909,120.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	412.20	2,826,867.60	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	289,060	49.25	14,236,205.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	804.00	18,335,220.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	83.00	11,993,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	136.00	8,297,360.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	123.00	11,753,880.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	57.00	3,411,165.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	97.00	21,331,367.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	36.75	5,927,297.25	
	SECURITY BANK CORP	30,810	100.60	3,099,486.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	2.86	6,737,302.00	
	AYALA LAND INC	742,900	32.65	24,255,685.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	2.59	1,652,420.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	14.90	1,385,700.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,156,150	31.00	35,840,650.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,150.00	10,083,500.00	
	PLDT INC	10,460	1,207.00	12,625,220.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	26.50	2,371,750.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	252.00	7,335,720.00		
	フィリピンペソ 小計	6,477,376		232,522,516.85 (492,947,735)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,025.00	1,475,282,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	2,060.00	921,438,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	15,825.00	3,179,242,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	1,210.00	3,487,825,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	5,100.00	1,245,420,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	10,600.00	2,014,000,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	4,820.00	417,894,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	7,450.00	2,574,720,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	3,640.00	449,540,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	3,740.00	8,051,098,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,360.00	1,231,752,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	4,370.00	3,462,351,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	44,050.00	2,625,380,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	1,640.00	1,505,356,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,625.00	1,549,625,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,625.00	2,842,787,500.00	

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	8,050.00	6,008,520,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,400.00	3,858,260,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,051,000	26,225.00	27,562,475,000.00	
	BANK MANDIRI	2,133,796	4,200.00	8,961,943,200.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	3,800.00	3,078,760,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	669,100	845.00	565,389,500.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	6,046,500	2,590.00	15,660,435,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	665.00	454,461,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	356.00	573,302,400.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	5,349,700	3,190.00	17,065,543,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	387,000	2,380.00	921,060,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	860.00	680,690,000.00	
	インドネシアルピア 小計	34,413,196		122,424,550,600.00 (869,214,309)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	38,400.00	253,171,200.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	69,000.00	306,843,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	98,600.00	550,779,600.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	14,300.00	153,095,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	21,250.00	153,892,500.00	
	KCC CORP	732	157,500.00	115,290,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	374,500.00	293,233,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,512	72,100.00	181,115,200.00	
	LG CHEM LTD	4,819	352,500.00	1,698,697,500.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,129	160,000.00	180,640,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	195,500.00	377,315,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	41,000.00	46,207,000.00	
	POSCO	8,609	180,000.00	1,549,620,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	52,000.00	176,748,000.00	
	CJ CORP	1,230	80,000.00	98,400,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,217	81,300.00	261,542,100.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	33,865	3,570.00	120,898,050.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	23,250.00	100,161,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	25,050.00	169,338,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	19,200.00	54,240,000.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	3,301	18,800.00	62,058,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	35,000.00	323,365,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,348	250,000.00	337,000,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10,619	24,050.00	255,386,950.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	81,700.00	355,721,800.00	
	LG CORP	9,902	61,600.00	609,963,200.00	
	LOTTE CORP	2,370	38,750.00	91,837,500.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	14,100.00	84,430,800.00	



SAMSUNG C&T CORP	8,727	105,500.00	920,698,500.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	11,650.00	215,711,400.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	4,260.00	158,263,260.00
SK HOLDINGS CO LTD	3,449	182,500.00	629,442,500.00
S-1 CORPORATION	2,394	85,200.00	203,968,800.00
CJ LOGISTICS	862	144,000.00	124,128,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,307	102,000.00	235,314,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	19,200.00	105,676,800.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	3,330.00	99,020,880.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,066	22,400.00	158,278,400.00
HANON SYSTEMS	19,000	8,870.00	168,530,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,916	176,000.00	1,217,216,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	15,682	94,500.00	1,481,949,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,286	58,200.00	249,445,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	55,900.00	167,867,700.00
KIA MOTORS CORPORATION	29,688	30,500.00	905,484,000.00
COWAY CO LTD	5,058	61,800.00	312,584,400.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	33,750.00	137,700,000.00
HLB INC	3,060	100,400.00	307,224,000.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	55,200.00	608,248,800.00
KANGWON LAND INC	13,208	24,900.00	328,879,200.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	17,700.00	89,739,000.00
KAKAO CORP	5,728	206,000.00	1,179,968,000.00
NAVER CORP	14,853	214,000.00	3,178,542,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	679,000.00	1,120,350,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	97,800.00	241,077,000.00
PEARL ABYSS CORP	921	210,000.00	193,410,000.00
CJ ENM CO LTD	830	120,500.00	100,015,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	82,300.00	251,097,300.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	70,800.00	86,517,600.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	93,600.00	96,782,400.00
SHINSEGAE CO LTD	881	253,500.00	223,333,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	150,500.00	82,624,500.00
EMART	2,723	114,500.00	311,783,500.00
GS RETAIL CO LTD	4,060	37,650.00	152,859,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	277,000.00	214,675,000.00
KT&G CORP	11,869	78,700.00	934,090,300.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,968	124,000.00	368,032,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	537,000.00	36,516,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	181,500.00	521,449,500.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	2,100	62,800.00	131,880,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,024	1,420,000.00	1,454,080,000.00

	LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	278	703,000.00	195,434,000.00	
	PACIFIC CORP	3,393	57,700.00	195,776,100.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,381	88,000.00	561,528,000.00	
	CELLTRION INC	10,296	210,500.00	2,167,308,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	490	276,000.00	135,240,000.00	
	HELIXMITH CO LTD	2,051	67,500.00	138,442,500.00	
	MEDY-TOX INC	335	153,100.00	51,288,500.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,803	588,000.00	1,060,164,000.00	
	YUHAN CORPORATION	3,802	49,150.00	186,868,300.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	48,153	4,865.00	234,264,345.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	32,598	26,850.00	875,256,300.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	7,740.00	219,274,200.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	44,011	32,800.00	1,443,560,800.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	48,174	30,050.00	1,447,628,700.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	8,070.00	479,406,420.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	48,500.00	223,197,000.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,240.00	155,208,960.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	48,121	5,650.00	271,883,650.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	22,174	9,550.00	211,761,700.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	30,150.00	57,254,850.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	28,950.00	167,215,200.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	45,150.00	190,036,350.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	44,037	1,700.00	74,862,900.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	26,200.00	238,446,200.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	186,500.00	579,642,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	47,650.00	353,420,050.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	176,000.00	655,600,000.00	
	KMW CO LTD	1,901	62,700.00	119,192,700.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	10,900.00	262,373,900.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	137,500.00	194,562,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	119,000.00	666,757,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	510,272	48,800.00	24,901,273,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	87,965	41,650.00	3,663,742,250.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,042	285,500.00	1,724,991,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	13,100.00	289,837,500.00	
	SK TELECOM	2,172	207,000.00	449,604,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	30,309	22,350.00	677,406,150.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	27,400.00	124,341,200.00	
	SK HYNIX INC	58,170	85,000.00	4,944,450,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,702,523		79,253,944,765.00 (6,958,496,350)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	137,240	88.30	12,118,292.00	

ASIA CEMENT CORP	234,176	44.00	10,303,744.00
CHINA STEEL	1,266,261	19.65	24,882,028.65
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	396,061	73.70	29,189,695.70
FORMOSA PLASTICS CORP	489,824	86.40	42,320,793.60
NAN YA PLASTICS CORP	548,752	64.00	35,120,128.00
TAIWAN CEMENT	540,479	43.00	23,240,597.00
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	561.00	6,732,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	27.25	9,483,763.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,237	290.00	6,158,730.00
CHINA AIRLINES LTD	437,203	7.81	3,414,555.43
EVA AIRWAYS CORP	164,159	10.95	1,797,541.05
EVERGREEN MARINE	359,039	10.55	3,787,861.45
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	33.50	5,929,500.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	33.85	5,993,514.85
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	273.50	5,452,769.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	36,207	163.50	5,919,844.50
FORMOSA TAFFETA CO.	121,000	33.60	4,065,600.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	188.00	4,787,232.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	231.00	3,696,000.00
POU CHEN	273,780	27.75	7,597,395.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	62,108	67.80	4,210,922.40
TATUNG CO LTD	210,000	21.80	4,578,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	518.00	15,540,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	305.00	18,160,920.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	65.60	2,345,593.60
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	526,395	70.90	37,321,405.50
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	559,468	18.90	10,573,945.20
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,026,237	19.80	40,119,492.60
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,071,573	26.85	28,771,735.05
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,004,094	21.75	21,839,044.50
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	912,945	19.05	17,391,602.25
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,173,339	30.00	35,200,170.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	11.55	13,362,067.95
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,201,768	12.35	14,841,834.80
TAIWAN BUSINESS BANK	476,620	10.60	5,052,172.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,055,621	19.85	20,954,076.85
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	43.60	14,425,539.60
CHAILEASE HOLDING CO LTD	132,022	113.00	14,918,486.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,125,153	16.40	18,452,509.20
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	823,123	39.25	32,307,577.75
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	8.98	11,285,884.40
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	307,791	20.10	6,186,599.10

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	710,082	40.65	28,864,833.30
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	8.29	9,911,001.73
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	103,120	43.80	4,516,656.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	98,440	43.95	4,326,438.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	209.50	10,056,000.00
ACER INC	255,803	16.35	4,182,379.05
ADVANTECH CO LTD	39,402	291.00	11,465,982.00
ASUSTEK COMPUTER INC	76,092	200.50	15,256,446.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	7.39	6,984,215.10
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	241.50	16,832,550.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	79.70	4,924,822.40
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	6.26	4,851,500.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	18.80	8,117,088.00
DELTA ELECTRONICS INC	209,903	140.00	29,386,420.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	56.20	5,218,170.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,333,248	76.20	101,593,497.60
INVENTEC CO LTD	280,511	23.45	6,577,982.95
LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	4,225.00	46,644,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	46.95	10,584,971.40
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	90.80	5,448,000.00
PEGATRON CORP	200,474	66.30	13,291,426.20
QUANTA COMPUTER INC	286,270	64.90	18,578,923.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	39.35	5,040,735.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	203.50	5,494,500.00
WISTRON CORP	355,695	27.45	9,763,827.75
WIWYNN CORP	8,000	794.00	6,352,000.00
WPG HOLDINGS LTD	143,692	38.50	5,532,142.00
YAGEO CORPORATION	22,764	403.50	9,185,274.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	117.00	7,010,874.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	400,315	110.00	44,034,650.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	67.00	10,519,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	178,200	107.50	19,156,500.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	349,315	67.60	23,613,694.00
GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	381.00	9,144,000.00
MEDIATEK INC	160,804	411.50	66,170,846.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	154,000	63.80	9,825,200.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	69,045	203.50	14,050,657.50
PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	289.00	3,352,111.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	99,770	106.00	10,575,620.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	250.50	12,761,472.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,632,389	297.50	783,135,727.50
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	15.65	18,936,500.00

	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	70.40	6,265,600.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	281.50	9,008,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	13.50	4,711,500.00
	新台湾ドル 小計	35,561,115		2,101,084,897.96 (7,521,883,934)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	324.75	21,472,470.00
	COAL INDIA LTD	147,331	129.00	19,005,699.00
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	196.95	11,703,753.75
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	74.35	14,406,427.75
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	76.00	19,205,884.00
	PETRONET LNG LTD	83,779	224.65	18,820,952.35
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	306,633	1,561.80	478,899,419.40
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	169.35	12,452,813.55
	ASIAN PAINTS LTD	28,520	1,578.40	45,015,968.00
	BERGER PAINTS INDIA LTD	16,698	455.40	7,604,269.20
	GRASIM INDUSTRIES LTD	41,773	486.30	20,314,209.90
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	117.10	14,210,904.70
	JSW STEEL LTD	80,284	168.65	13,539,896.60
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,368.35	16,786,917.80
	SHREE CEMENT LTD	901	18,732.75	16,878,207.75
	TATA STEEL LTD	39,709	272.90	10,836,586.10
	ULTRATECH CEMENT LTD	10,743	3,305.80	35,514,209.40
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	364.60	19,762,778.40
	VEDANTA LTD	198,772	77.40	15,384,952.80
	ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	47.05	6,756,521.15
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	487.45	11,443,376.20
	LARSEN & TOUBRO LTD	49,730	815.95	40,577,193.50
	SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,043.35	6,182,892.10
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	285.05	17,823,036.30
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	358.75	9,490,731.25
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	928.05	7,758,498.00
	BAJAJ AUTO LTD	8,362	2,419.05	20,228,096.10
	BHARAT FORGE LTD	30,322	279.80	8,484,095.60
	BOSCH LTD	965	9,792.15	9,449,424.75
	EICHER MOTORS LTD	1,254	13,858.85	17,378,997.90
	HERO MOTOCORP LTD	10,359	1,962.60	20,330,573.40
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	386.70	29,261,202.30
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,151	4,654.15	56,552,576.65	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	77.00	5,916,449.00	
TATA MOTORS LTD	190,082	81.05	15,406,146.10	
PAGE INDUSTRIES LTD	601	16,982.90	10,206,722.90	
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	832.85	27,392,436.50	

INFO EDGE INDIA LTD	6,428	2,697.95	17,342,422.60
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	150.65	11,972,607.45
AVENUE SUPERMARTS LTD	14,325	2,255.00	32,302,875.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	2,994.65	15,296,672.20
ITC LTD	388,437	158.25	61,470,155.25
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	17,802.95	42,638,065.25
UNITED SPIRITS LTD	32,483	501.35	16,285,352.05
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	5,255	1,359.50	7,144,172.50
DABUR INDIA LTD	58,111	446.80	25,963,994.80
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	499.55	19,214,691.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	87,189	2,089.45	182,177,056.05
MARICO LTD	42,465	300.25	12,750,116.25
AUROBINDO PHARMA LTD	37,851	652.65	24,703,455.15
CIPLA LTD	47,915	591.90	28,360,888.50
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	2,300.80	20,840,646.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	3,984.00	50,373,696.00
LUPIN LTD	26,552	835.00	22,170,920.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	885.80	10,383,347.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	469.00	38,903,550.00
AXIS BANK LTD	228,324	382.05	87,231,184.20
BANDHAN BANK LTD	36,073	240.00	8,657,520.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	177,443	1,689.70	299,825,437.10
ICICI BANK LTD	515,616	337.70	174,123,523.20
LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	263.65	7,374,554.15
STATE BANK OF INDIA	187,504	166.65	31,247,541.60
BAJAJ FINANCE LTD	18,080	2,024.15	36,596,632.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,619.25	10,725,828.75
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	165.35	4,618,060.15
REC LTD	48,168	87.55	4,217,108.40
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	19,022	744.40	14,159,976.80
BAJAJ FINSERV LTD	3,888	4,601.00	17,888,688.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	49,372	520.05	25,675,908.60
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	17,954	1,235.15	22,175,883.10
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	400.10	12,695,973.20
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	32,481	760.05	24,687,184.05
DLF LTD	56,420	130.15	7,343,063.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	122,073	518.40	63,282,643.20
INFOSYS LTD	365,523	674.20	246,435,606.60
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	96,664	1,893.40	183,023,617.60
TECH MAHINDRA LTD	48,055	536.20	25,767,091.00
WIPRO LTD	118,712	184.00	21,843,008.00
BHARTI AIRTEL LTD	263,301	530.05	139,562,695.05

	BHARTI INFRA TEL LTD	35,804	174.25	6,238,847.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	91.35	15,965,056.80	
	NTPC LTD	260,019	87.00	22,621,653.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	159.00	32,017,035.00	
	TATA POWER CO LTD	93,250	28.50	2,657,625.00	
	インドルピー 小計	6,798,523		3,321,408,918.95	(4,716,400,664)
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	103.05	7,522,650.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	95.58	6,356,070.00	
	MCB BANK LTD	53,300	155.66	8,296,678.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		22,175,398.00	(15,079,270)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	57,358	16.09	922,890.22	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.04	907,382.70	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	7.65	1,505,428.20	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	3.97	809,840.30	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	3.78	1,539,973.52	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	8.11	799,412.04	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	15.14	1,729,442.20	
	QATAR NATIONAL BANK	487,496	17.17	8,370,306.32	
	QATAR INSURANCE CO	189,640	1.97	373,590.80	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.84	589,271.60	
	OOREDOO QSC	72,800	6.11	444,953.60	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	15.13	944,429.73	
	カタールリアル 小計	2,541,237		18,936,921.23	(553,904,945)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,900	112.65	3,931,485.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	7,385	976.70	7,212,929.50	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,716	487.64	21,805,310.24	
	GOLD FIELDS LTD	89,344	152.23	13,600,837.12	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	77,953	108.33	8,444,648.49	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	363.33	1,951,808.76	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	88.30	2,997,785.00	
	SASOL LTD	57,207	82.89	4,741,888.23	
	SIBANYE STILLWATER LTD	218,901	35.70	7,814,765.70	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	144.85	4,012,634.70	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	85.38	3,460,366.02	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	133.53	3,806,940.30	
	NASPERS LTD-N SHS	47,573	2,980.00	141,767,540.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	83,044	11.04	916,805.76	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	71.52	1,718,768.64	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	29.31	3,238,608.45		

	BID CORP LTD	33,071	240.12	7,941,008.52	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	228.17	6,142,564.57	
	PICK N PAY STORES LTD	45,989	59.22	2,723,468.58	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	58,453	109.49	6,400,018.97	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	185.35	4,313,835.90	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	192.08	2,501,457.84	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	17.84	2,792,727.12	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	129.70	4,830,546.80	
	ABSA GROUP LTD	92,885	84.00	7,802,340.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,385	878.53	3,852,354.05	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	97.28	3,700,239.36	
	STANDARD BANK GROUP LTD	142,629	98.29	14,019,004.41	
	FIRSTRAND LTD	377,344	40.60	15,320,166.40	
	INVESTEC LTD	28,883	36.23	1,046,431.09	
	PSG GROUP LTD	18,494	159.04	2,941,285.76	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	303.86	5,222,441.82	
	REMGRO LTD	55,441	143.27	7,943,032.07	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	53.75	3,998,892.50	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	97.72	3,419,809.12	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	18,158	65.42	1,187,896.36	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	17.37	1,182,514.86	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	13.39	6,555,904.68	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	25.01	2,532,712.68	
	SANLAM LTD	221,098	59.45	13,144,276.10	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	32,121	83.78	2,691,097.38	
	MTN GROUP LTD	173,000	49.50	8,563,500.00	
	TELKOM SA LTD	11,353	18.11	205,602.83	
	VODACOM GROUP	73,306	123.46	9,050,358.76	
	南アフリカランド 小計	3,398,804		383,448,610.44 (2,235,505,398)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	4.10	1,104,909.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	3.42	439,770.96	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	11.60	3,285,839.20	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	509,421	1.72	876,204.12	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.14	204,793.02	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	2.44	939,497.60	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	200,413	14.78	2,962,104.14	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,955,857		9,813,118.04 (285,267,341)	
香港・オフショア 人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	6.44	585,396.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	7.34	281,122.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	5.69	499,582.00	



YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	8.38	512,856.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	2.84	466,612.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	60.85	1,791,424.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	4.88	188,856.00
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	22,500	38.87	874,575.00
BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	98,100	4.24	415,944.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	9.33	498,222.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.14	524,594.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.12	516,320.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.02	246,218.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	61,700	8.01	494,217.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.07	455,607.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	69,000	7.25	500,250.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	5,180	36.63	189,743.40
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	23,600	24.25	572,300.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	38,900	21.22	825,458.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	31,500	18.76	590,940.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	43,200	11.80	509,760.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.07	559,654.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	34,900	46.83	1,634,367.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	12.39	292,404.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.44	286,960.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	24.87	283,518.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	17.92	304,640.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	25,000	24.19	604,750.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	6.58	635,628.00
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	75,820	7.49	567,891.80
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	63,200	9.76	616,832.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	494,300	4.20	2,076,060.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.19	1,094,571.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	144.08	1,930,672.00
CRRG CORP LTD-A	79,000	6.20	489,800.00
EVE ENERGY CO LTD-A	12,900	67.68	873,072.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	43.92	597,312.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	12,200	73.84	900,848.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	20.00	972,000.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	3.66	597,312.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	20.39	854,341.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	34.68	707,472.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	8.14	183,964.00
WEICHAH POWER CO LTD-A	43,200	14.38	621,216.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	10.34	207,947.74

ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	25.47	804,852.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	36,300	22.02	799,326.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	13.22	585,646.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	9.98	804,388.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	37,300	17.52	653,496.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	52.70	579,700.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	6.96	180,264.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.24	169,600.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	1.94	726,724.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.95	849,985.00
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	2.35	148,755.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	14.18	439,580.00
S F HOLDING CO LTD-A	13,700	45.91	628,967.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	69.00	367,011.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.18	185,592.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	35.13	291,579.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	16,800	29.93	502,824.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	104,734	5.60	586,510.40
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	20.66	770,618.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	52,300	10.47	547,581.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	22.28	764,204.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	20.75	607,975.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	20.29	864,354.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	56.99	1,054,315.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	15.18	503,976.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	5,500	110.29	606,595.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	15.35	399,100.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	30,100	19.66	591,766.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	6.47	513,071.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	18,600	30.27	563,022.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	10.96	587,456.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	13.50	229,500.00
CITIC GUOAN INFORMATION-A	174,400	3.30	575,520.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.00	697,000.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	1,800	415.50	747,900.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	47.50	774,250.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	52,800	15.12	798,336.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	9.19	756,888.40
PERFECT WORLD CO LTD-A	15,200	45.57	692,664.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	37.96	930,020.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	22,800	19.71	449,388.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	92.68	1,371,664.00

HLA CORP LTD-A	21,400	6.17	132,038.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	17.61	299,370.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	8.70	398,460.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	9.99	404,595.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	18,700	38.88	727,056.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	4,800	140.24	673,152.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	15,900	42.48	675,432.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	54.84	564,852.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	21,100	34.45	726,895.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	14,160	108.72	1,539,475.20
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	21.59	591,566.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	44.47	755,990.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	32,400	42.83	1,387,692.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	29.44	1,009,850.88
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	34.20	591,660.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	99.82	908,362.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	51.01	586,615.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,314.61	9,991,036.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	81.64	800,072.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	14,100	123.30	1,738,530.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	32.43	869,124.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	108.35	725,945.00
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	50,891	12.32	626,977.12
TONGWEI CO LTD-A	31,600	14.66	463,256.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	63,900	30.20	1,929,780.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	142.90	3,029,480.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	37,500	18.30	686,250.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,780	46.80	644,904.00
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	136.51	682,550.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	10,938	71.00	776,598.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	21.76	211,507.20
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	6,500	117.35	762,775.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	57,300	18.60	1,065,780.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	39.60	586,080.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	12.00	298,080.00
OVCTEK CHINA INC-A	9,300	67.99	632,307.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	266.21	1,410,913.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	4,700	127.84	600,848.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	29,100	25.87	752,817.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,800	187.96	714,248.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	19,500	35.12	684,840.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	7,400	101.36	750,064.00

CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	1,100	611.60	672,760.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	40.03	612,459.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	29.08	296,616.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	81.39	805,761.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	30.71	681,547.03
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.35	501,600.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	77.80	622,400.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	38.06	717,431.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	26,926	21.53	579,716.78
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	26,460	97.05	2,567,943.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	12,600	60.33	760,158.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	133.69	909,092.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	19.29	135,030.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	20.30	228,009.60
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	13.58	264,810.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	42.59	724,030.00
WUXI APPTec CO LTD-A	6,300	103.60	652,680.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	91.49	649,579.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	145.03	565,617.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	36,900	27.95	1,031,355.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	27.08	655,336.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.42	1,209,312.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.98	288,840.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	5.14	508,346.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	6.06	350,268.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	7.76	391,880.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	26.23	629,520.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.13	369,915.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.35	793,115.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.69	475,641.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	34.97	3,668,353.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.84	1,597,824.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.52	778,488.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.10	1,332,120.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	16.37	1,558,424.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	13.95	1,665,630.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.44	1,443,852.00
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	2.50	79,750.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	3.99	488,775.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	6.44	1,188,180.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	56,200	18.37	1,032,394.00
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	23.82	1,029,024.00

CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	35.22	848,802.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	85,500	18.40	1,573,200.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	11.34	1,154,412.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	7.24	599,472.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	13.82	837,492.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	120.52	650,808.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	7.49	325,066.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	6.10	536,190.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	9.52	301,784.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.48	928,256.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	29.69	540,358.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	59,100	72.97	4,312,527.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	23.50	329,000.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	16.66	911,302.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	26.26	1,410,162.00
GEMDALE CORP-A	45,500	13.26	603,330.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	5.64	663,264.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	15.89	1,299,802.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	32.29	413,312.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	52,200	13.28	693,216.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	18.60	500,340.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	31.35	423,225.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	27.85	802,080.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	89.00	596,300.00
GLODON CO LTD-A	15,400	52.20	803,880.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	7,000	103.39	723,730.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	34.27	370,116.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	191.18	573,540.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	15,500	53.73	832,815.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	29,900	47.36	1,416,064.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	36.70	491,780.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.86	442,356.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	21.25	595,000.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	13.35	464,580.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	24,640	40.83	1,006,051.20
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	34.89	725,712.00
GOERTEK INC -A	26,900	20.76	558,444.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	9.33	466,500.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	58,500	31.84	1,862,640.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	42.77	843,082.24
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	38,500	18.41	708,785.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	45,732	47.25	2,160,837.00

OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	15.79	494,227.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	32.35	786,105.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	3,400	256.30	871,420.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	43.35	580,890.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	26.33	750,405.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	14.06	660,820.00	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	37,800	18.51	699,678.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	114.30	480,060.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,500	93.95	704,625.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	17.36	526,008.00	
ZTE CORP-A	12,600	42.49	535,374.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	600,000	5.24	3,144,000.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.34	754,292.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	17.09	2,290,060.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.61	1,076,863.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	7.61	514,436.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.26	789,000.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	2.61	215,325.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,480	221.01	990,124.80	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	31.20	508,560.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	24.05	976,430.00	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	241.13	626,938.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	11,700	62.88	735,696.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,900	208.97	606,013.00	
香港・オフショア人民元 小計	12,849,020		190,673,557.79 (2,873,450,515)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	13.16	310,036.44
	SAUDI ARABIAN OIL CO	129,846	31.15	4,044,702.90
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	43.75	428,925.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	9.33	297,888.24
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	13.70	442,277.10
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	19,671	69.90	1,375,002.90
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	33.90	1,524,957.60
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	83,163	71.70	5,962,787.10
	SAUDI CEMENT	7,489	44.10	330,264.90
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	18.12	381,589.08
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	8.05	532,217.70
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	45.80	1,216,264.80
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	73.00	323,536.00
	JARIR MARKETING CO	7,199	136.40	981,943.60
	ALMARAI CO	30,130	46.30	1,395,019.00
	SAVOLA	25,336	38.80	983,036.80

AL RAJHI BANK	135,049	53.90	7,279,141.10	
ALINMA BANK	109,956	14.70	1,616,353.20	
ARAB NATIONAL BANK	57,638	18.38	1,059,386.44	
BANK AL-JAZIRA	35,813	11.12	398,240.56	
BANK ALBILAD	32,374	21.06	681,796.44	
BANQUE SAUDI FRANSI	57,797	29.45	1,702,121.65	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	133,085	33.90	4,511,581.50	
RIYAD BANK	120,952	15.90	1,923,136.80	
SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	21.16	2,151,612.28	
SAUDI BRITISH BANK	71,793	22.88	1,642,623.84	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,609	100.80	162,187.20	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	65.90	435,796.70	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	7.14	336,236.88	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	6.72	310,376.64	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	25.90	891,322.60	
SAUDI TELECOM CO	43,949	88.90	3,907,066.10	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	15.50	1,429,425.50	
サウジアラビアリアル 小計	1,691,778		50,968,854.59 (1,453,631,732)	
合 計	286,796,141		58,587,422,422 (58,587,422,422)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	5,581,288.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	5,581,288.00 (25,283,234)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	950,468.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	58,600	1,431,598.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	673,530.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,388,254.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	26,962	1,170,420.42	
	ブラジルリアル 小計	192,062	5,614,270.42 (104,762,286)		
投資信託受益証券合計			250,462	130,045,520 (130,045,520)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	5,915,112.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	5,915,112.00 (26,795,457)	
		FORTRESS REIT LTD-A	189,245	1,949,223.50	

南アフリカ ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	4,030,342.02	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	1,057,611.05	
南アフリカランド 小計		1,032,277	7,037,176.57	(41,026,739)
投資証券合計		1,340,677	67,822,196	(67,822,196)
合計			197,867,716	(197,867,716)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 57銘柄	100.0%			15.1%
メキシコペソ	株式 23銘柄	95.4%			1.8%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.2%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.4%	0.0%
ブラジルリアル	株式 50銘柄	96.1%			4.4%
	投資信託受 益証券 5銘柄		3.9%		0.2%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
コロンビアペソ	株式 7銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.2%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%			0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
香港ドル	株式 207銘柄	100.0%			24.1%
マレーシアリンギット	株式 39銘柄	100.0%			1.8%
タイバーツ	株式 41銘柄	100.0%			2.3%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%			0.8%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.0%			1.5%
韓国ウォン	株式 109銘柄	100.0%			11.8%
新台幣ドル	株式 88銘柄	100.0%			12.8%



インドルピー	株式	84銘柄	100.0%			8.0%
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式	44銘柄	98.2%			3.8%
	投資証券	3銘柄			1.8%	0.1%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	7銘柄	100.0%			0.5%
香港・オフショア人 民元	株式	237銘柄	100.0%			4.9%
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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 5月11日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	696,609,533
国債証券	446,946,272,650
地方債証券	28,712,707,023
特殊債券	35,985,807,188
社債券	22,828,547,470
未収入金	201,168,000
未収利息	979,441,615
前払費用	17,573,279
流動資産合計	536,368,126,758
資産合計	536,368,126,758
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	190,330
未払金	203,180,000
未払解約金	377,274,638
未払利息	606
流動負債合計	580,645,574
負債合計	580,645,574
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	378,873,649,929
剰余金	

	2020年 5月11日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	156,913,831,255
元本等合計	535,787,481,184
純資産合計	535,787,481,184
負債純資産合計	536,368,126,758

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 5月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	378,873,649,929口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 101,503,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4142円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,142円)</p>

（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 5月11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 5月11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 5月11日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月12日
期首元本額	383,388,386,551円
期中追加設定元本額	25,424,721,237円
期中一部解約元本額	29,939,457,859円
期末元本額	378,873,649,929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
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,625,496,456円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,214,326円
S M T 国内債券インデックス・オープン	18,552,999,511円
世界経済インデックスファンド	1,962,131,216円
D C マイセレクション 2 5	20,513,979,581円
D C マイセレクション 5 0	21,596,541,639円
D C マイセレクション 7 5	5,855,908,741円
D C 日本債券インデックス・オープン	455,277,825円
D C 日本債券インデックス・オープン S	89,315,518,832円

区分	2020年 5月11日現在
D C日本債券インデックス・オープンP	68,562,279,714円
D CマイセレクションS 2 5	8,631,095,001円
D CマイセレクションS 5 0	9,026,466,177円
D CマイセレクションS 7 5	1,662,679,702円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	1,078,494,844円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	1,326,024,598円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	439,703,295円
D C世界経済インデックスファンド	2,561,937,347円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	66,167,120円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,891,710円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	40,367,643円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	13,051,579円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	831,352円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	142,110,136円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	211,159,302円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	51,743,667円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	83,851,530円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,802,698,110円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	849,603,102円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,275,633,949円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	734,253,257円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	87,041,340円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,100,046,570円
グローバルバランスファンドV A 3 5（適格機関投資家専用）	25,144,003円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,285,711,011円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,622,545,611円
国内バランス2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	146,210,886円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,920,405,893円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,703,559,783円
分散投資コア戦略ファンドA	11,117,699,729円
分散投資コア戦略ファンドS	9,309,995,398円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	86,728,722円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	920,905,207円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	45,784,514円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,829,002円
S M T インデックスバランス・オープン	57,002,487円
S M T 世界経済インデックス・オープン	13,361,360円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	25,750,299円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,679,530円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,983,065円
グローバル経済コア	223,508,881円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	15,188,307円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5	1,388,396円

区分	2020年 5月11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	116,822円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	122,775円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	43,098円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	11,830円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	70,611,430,161円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	24,116,747円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	6,156,773,950	
地方債証券	319,813,792	
特殊債券	373,871,178	
社債券	248,760,740	
合計	7,099,219,660	

(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)

## 債券関連

(2020年 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	152,390,000	-	152,200,000	190,000
合計		152,390,000	-	152,200,000	190,000

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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ではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第401回利付国債(2年)	2,880,000,000	2,888,496,000	
	第402回利付国債(2年)	500,000,000	501,595,000	
	第403回利付国債(2年)	3,690,000,000	3,702,619,800	
	第404回利付国債(2年)	460,000,000	461,683,600	
	第405回利付国債(2年)	670,000,000	672,840,800	
	第406回利付国債(2年)	780,000,000	783,338,400	
	第407回利付国債(2年)	360,000,000	361,598,400	
	第408回利付国債(2年)	690,000,000	693,174,000	
	第409回利付国債(2年)	2,670,000,000	2,682,922,800	
	第410回利付国債(2年)	390,000,000	391,973,400	
	第412回利付国債(2年)	60,000,000	60,325,800	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,614,991,000	
	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,352,491,600	
	第130回利付国債(5年)	3,160,000,000	3,173,998,800	
	第131回利付国債(5年)	4,990,000,000	5,015,997,900	
	第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	4,798,238,400	
	第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,409,039,400	
	第134回利付国債(5年)	6,050,000,000	6,094,346,500	
	第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,112,191,200	
	第136回利付国債(5年)	4,140,000,000	4,174,900,200	
	第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	6,961,755,000	
	第138回利付国債(5年)	9,510,000,000	9,599,679,300	
	第139回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,423,274,400	
	第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	7,375,409,000	
	第141回利付国債(5年)	6,020,000,000	6,083,330,400	
	第142回利付国債(5年)	6,050,000,000	6,114,493,000	
	第143回利付国債(5年)	520,000,000	525,584,800	
	第1回利付国債(40年)	400,000,000	602,004,000	
	第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,656,173,200	
	第3回利付国債(40年)	550,000,000	814,027,500	
	第4回利付国債(40年)	1,000,000,000	1,494,370,000	
	第5回利付国債(40年)	920,000,000	1,334,018,400	
	第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,806,197,400	
第7回利付国債(40年)	830,000,000	1,146,595,200		
第8回利付国債(40年)	800,000,000	1,036,784,000		
第9回利付国債(40年)	930,000,000	905,847,900		
第10回利付国債(40年)	1,990,000,000	2,269,495,500		
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,986,201,900		

第12回利付国債(40年)	1,650,000,000	1,660,791,000	
第315回利付国債(10年)	3,140,000,000	3,187,853,600	
第316回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,186,532,100	
第317回利付国債(10年)	890,000,000	905,450,400	
第318回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,194,560,000	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,745,294,400	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,656,967,100	
第321回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,524,216,500	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	765,067,500	
第323回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,974,274,200	
第324回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,797,074,200	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,987,773,200	
第326回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,554,838,400	
第327回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,651,119,400	
第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,475,582,000	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,317,792,500	
第330回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,745,077,100	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	923,247,000	
第332回利付国債(10年)	3,110,000,000	3,195,773,800	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,398,199,100	
第334回利付国債(10年)	1,790,000,000	1,845,472,100	
第335回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,518,747,000	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	525,014,400	
第337回利付国債(10年)	3,330,000,000	3,396,366,900	
第338回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,139,223,400	
第339回利付国債(10年)	5,230,000,000	5,371,105,400	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,498,982,400	
第341回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,211,840,000	
第342回利付国債(10年)	5,880,000,000	5,956,263,600	
第343回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,293,972,500	
第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	7,035,563,800	
第345回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,322,769,900	
第346回利付国債(10年)	3,540,000,000	3,591,330,000	
第347回利付国債(10年)	310,000,000	314,662,400	
第348回利付国債(10年)	4,940,000,000	5,015,088,000	
第349回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,177,982,900	
第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	5,877,023,700	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,590,000,000	3,642,701,200	
第352回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,249,875,100	
第353回利付国債(10年)	4,470,000,000	4,531,864,800	
第354回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,828,724,200	
第355回利付国債(10年)	4,940,000,000	4,998,637,800	



第356回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,769,509,800	
第357回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,696,940,300	
第358回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,493,838,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	138,890,400	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	197,547,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	147,438,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	143,050,600	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	61,749,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	240,479,200	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	227,176,200	
第8回利付国債(30年)	100,000,000	120,815,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	278,152,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	179,622,400	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	108,070,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	238,678,000	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	361,305,200	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	390,819,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	449,136,600	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	490,150,100	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	749,048,400	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	449,517,750	
第19回利付国債(30年)	380,000,000	496,652,400	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	643,545,600	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	656,935,000	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	539,308,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	581,600,800	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	515,181,200	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	464,411,500	
第26回利付国債(30年)	530,000,000	713,713,900	
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,383,467,700	
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,259,100,000	
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,914,906,000	
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,403,854,700	
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,482,382,000	
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,144,641,200	
第33回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,342,825,100	
第34回利付国債(30年)	1,615,000,000	2,210,741,200	
第35回利付国債(30年)	1,940,000,000	2,588,988,200	
第36回利付国債(30年)	1,830,000,000	2,452,968,600	
第37回利付国債(30年)	1,910,000,000	2,529,126,500	
第38回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,607,413,200	
第39回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,597,620,000	

第40回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,534,665,600
第41回利付国債(30年)	780,000,000	1,007,416,800
第42回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,745,482,500
第43回利付国債(30年)	930,000,000	1,205,084,700
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,582,559,600
第45回利付国債(30年)	990,000,000	1,239,519,600
第46回利付国債(30年)	1,570,000,000	1,967,084,400
第47回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,725,516,000
第48回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,241,603,000
第49回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,774,483,200
第50回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,206,958,500
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,775,508,000
第52回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,620,752,000
第53回利付国債(30年)	690,000,000	716,295,900
第54回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,642,517,600
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,130,667,200
第56回利付国債(30年)	1,870,000,000	2,034,373,000
第57回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,293,863,200
第58回利付国債(30年)	1,620,000,000	1,760,340,600
第59回利付国債(30年)	170,000,000	180,378,500
第60回利付国債(30年)	2,530,000,000	2,816,320,100
第61回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,410,691,100
第62回利付国債(30年)	170,000,000	171,295,400
第63回利付国債(30年)	980,000,000	961,203,600
第64回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,667,139,000
第65回利付国債(30年)	860,000,000	843,255,800
第66回利付国債(30年)	460,000,000	450,974,800
第51回利付国債(20年)	100,000,000	102,429,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	113,423,200
第53回利付国債(20年)	80,000,000	82,935,200
第54回利付国債(20年)	200,000,000	207,660,000
第55回利付国債(20年)	140,000,000	145,688,200
第56回利付国債(20年)	150,000,000	156,931,500
第57回利付国債(20年)	240,000,000	250,581,600
第58回利付国債(20年)	300,000,000	314,781,000
第59回利付国債(20年)	200,000,000	209,852,000
第60回利付国債(20年)	350,000,000	364,490,000
第61回利付国債(20年)	240,000,000	248,090,400
第62回利付国債(20年)	320,000,000	329,641,600
第63回利付国債(20年)	200,000,000	212,272,000
第64回利付国債(20年)	320,000,000	342,259,200
第65回利付国債(20年)	220,000,000	236,403,200
第66回利付国債(20年)	330,000,000	353,406,900

第67回利付国債(20年)	130,000,000	140,332,400	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	207,310,900	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	424,019,700	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	442,056,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	219,376,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	691,733,700	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	395,546,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	220,676,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	144,127,100	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	296,703,000	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	320,099,100	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	187,644,300	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	299,411,100	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	245,095,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	434,592,600	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	671,838,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	326,348,600	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	526,254,300	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	327,862,400	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	239,893,500	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	625,047,500	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	482,378,400	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	399,829,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	723,189,600	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	519,444,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,009,456,800	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	469,585,300	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	702,866,400	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	715,042,000	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,841,029,200	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	468,200,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	511,759,600	
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,343,441,500	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	566,726,400	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	855,497,500	
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,514,356,200	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	477,484,000	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	423,864,000	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,394,701,000	
第106回利付国債(20年)	380,000,000	452,336,800	
第107回利付国債(20年)	260,000,000	308,458,800	
第108回利付国債(20年)	660,000,000	771,599,400	

第109回利付国債(20年)	520,000,000	609,642,800
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,130,652,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,167,521,100
第112回利付国債(20年)	790,000,000	943,655,000
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,737,404,500
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,801,475,500
第115回利付国債(20年)	700,000,000	848,372,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,812,138,000
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,302,858,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	791,808,600
第119回利付国債(20年)	530,000,000	625,150,900
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,820,195,200
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,789,665,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,111,813,200
第123回利付国債(20年)	830,000,000	1,010,608,000
第124回利付国債(20年)	610,000,000	736,294,400
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,010,330,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	883,679,600
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,223,714,400
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,166,919,700
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,060,853,300
第130回利付国債(20年)	1,245,000,000	1,487,712,750
第131回利付国債(20年)	850,000,000	1,006,128,000
第132回利付国債(20年)	840,000,000	996,508,800
第133回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,425,405,800
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,356,644,100
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,665,200
第136回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,730,351,700
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,334,356,800
第138回利付国債(20年)	620,000,000	723,825,200
第139回利付国債(20年)	580,000,000	684,069,400
第140回利付国債(20年)	1,840,000,000	2,196,720,800
第141回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,524,066,400
第142回利付国債(20年)	580,000,000	701,022,800
第143回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,340,010,500
第144回利付国債(20年)	1,740,000,000	2,041,385,400
第145回利付国債(20年)	2,515,000,000	3,019,961,700
第146回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,935,295,600
第147回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,502,738,000
第148回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,690,445,600
第149回利付国債(20年)	3,070,000,000	3,627,481,300
第150回利付国債(20年)	2,640,000,000	3,086,476,800
第151回利付国債(20年)	1,255,000,000	1,433,122,150

	第152回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,765,116,200	
	第153回利付国債(20年)	2,230,000,000	2,584,012,500	
	第154回利付国債(20年)	2,950,000,000	3,376,983,000	
	第155回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,341,857,000	
	第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	2,003,296,400	
	第157回利付国債(20年)	2,820,000,000	2,791,659,000	
	第158回利付国債(20年)	2,320,000,000	2,403,589,600	
	第159回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,176,832,700	
	第160回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,049,772,800	
	第161回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,838,410,000	
	第162回利付国債(20年)	580,000,000	608,704,200	
	第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,738,646,900	
	第164回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,773,784,400	
	第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,690,512,000	
	第166回利付国債(20年)	900,000,000	959,301,000	
	第167回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,615,692,000	
	第168回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,406,012,800	
	第169回利付国債(20年)	760,000,000	754,543,200	
	第170回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,392,479,300	
	第171回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,439,328,000	
	第172回利付国債(20年)	320,000,000	323,568,000	
	国債証券合計	411,040,000,000	446,946,272,650	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,546,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,473,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	134,933,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	134,451,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	129,549,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	128,681,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,749,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,963,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	235,286,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,536,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	101,279,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	101,339,000	
	第702回東京都公募公債	100,000,000	101,626,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	101,930,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	101,712,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	102,590,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,218,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,647,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,748,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,493,000	

第781回東京都公募公債	300,000,000	300,840,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	198,670,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	202,768,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,099,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,691,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,910,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,774,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	137,593,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	117,243,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	114,639,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,782,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,670,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	201,292,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,493,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	198,576,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	235,576,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,874,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,588,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,603,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,141,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	153,840,310	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,315,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,225,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,998,440	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,592,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	119,054,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	117,449,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	102,566,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,432,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	98,883,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	103,533,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	104,324,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	116,366,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,484,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	439,140,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,355,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	203,214,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,530,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,944,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	102,474,000	

令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	299,721,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	122,323,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	106,452,000	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,449,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,853,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,563,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,704,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,765,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	119,314,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,518,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,750,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,477,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,736,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,816,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,574,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	309,336,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,591,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	105,404,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,758,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	118,345,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,988,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,002,592	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	200,906,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	116,291,000	
第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	117,441,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	235,366,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	109,467,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	236,168,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	197,984,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,996,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,217,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,379,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,207,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,904,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,005,000	

平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,564,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	116,394,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	116,408,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	108,789,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,450,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	101,299,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	109,052,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	133,788,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	112,633,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,179,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	105,404,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,626,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	235,366,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	118,892,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,418,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	102,645,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,843,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,377,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,904,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,639,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	297,846,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,703,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,058,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,685,000	
第107回共同発行市場公募地方債	800,000,000	814,048,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,831,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,993,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,751,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,785,000	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,386,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,804,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,294,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,579,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,227,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,209,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,356,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,188,000	



第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,397,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,250,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,108,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,570,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,794,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,508,666	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,324,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,146,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,029,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,634,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,382,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,996,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,674,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,533,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,978,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,060,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,795,465	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,776,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,653,000	
平成23年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	101,421,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	203,786,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債(5年)	100,000,000	99,955,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	101,565,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,565,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,822,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	238,020,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	298,065,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	103,962,000	
平成29年度第1回大阪市公募公債(5年)	100,000,000	99,958,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	131,169,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	137,044,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	116,579,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	127,683,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,862,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,853,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,675,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,885,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,244,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,066,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	137,779,200	

	平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	235,922,000	
	平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	120,085,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	110,667,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,339,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,684,000	
	平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,499,000	
	平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	201,852,000	
	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,668,000	
	平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	202,738,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	109,356,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,008,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,795,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	116,944,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,393,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,801,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,141,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,881,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	118,581,000	
	平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	101,421,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	204,448,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,374,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,583,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,919,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,448,350	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	171,575,900	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	547,910,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	203,174,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	198,564,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,712,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	116,183,000	
	地方債証券合計	27,316,930,000	28,712,707,023	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,779,500	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,860,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	310,000,000	315,843,500	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,800,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,197,000	

第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,497,000	
第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,835,000	
第14回道路債券	100,000,000	104,932,000	
第17回道路債券	100,000,000	103,967,000	
第21回道路債券	100,000,000	131,485,000	
第28回道路債券	200,000,000	266,348,000	
第33回道路債券	200,000,000	269,956,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,523,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	156,966,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,244,000	
第42回道路債券	100,000,000	110,498,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,007,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,635,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,952,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,199,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	237,752,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,317,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,985,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,907,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,545,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,377,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,717,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,105,000	
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	101,377,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,960,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,536,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,902,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	305,831,050	
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	203,352,000	

第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,614,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,682,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,901,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,836,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,757,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,846,000	
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	102,259,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,810,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,776,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	619,212,000	
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	203,162,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	428,000,000	435,781,040	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,464,000	
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	151,963,440	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,983,000	
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	102,444,000	
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	232,540,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,646,900	
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	102,597,000	
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	102,473,000	
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	102,343,000	
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	102,085,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,287,000	
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	112,181,000	
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	226,090,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,256,000	
	100,000,000	100,636,000	

第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,879,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,650,110	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	316,625,680	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,822,050	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,617,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,180,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,727,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,305,600	
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	201,282,000	
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	311,820,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	216,777,720	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	100,000,000	100,863,000	
第2回公営企業債券(30年)	300,000,000	381,990,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	100,000,000	100,879,000	
第3回公営企業債券(20年)	110,000,000	113,177,900	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	108,828,000	
第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	399,204,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,354,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	133,689,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	43,418,400	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	131,550,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	237,304,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	236,870,000	
第21回地方公共団体金融機構債券(5年)	400,000,000	399,916,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	117,436,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,481,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,770,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,015,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,991,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,184,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,245,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,776,000	

第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,572,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,796,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,687,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,874,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,707,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,483,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,984,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,919,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,912,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,714,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,197,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,400,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,473,370	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,751,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,723,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,191,300	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,845,480	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,292,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,348,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,223,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,302,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,349,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,629,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	110,250,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,008,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,856,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	121,183,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	204,522,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,889,120	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,752,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,537,600	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,236,520	
第81回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,971,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	181,162,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	99,263,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,980,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	104,297,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,618,800	
第59回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	508,700,000	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,950,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,945,000	13,350,955	

第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,434,000	13,949,059	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,750,000	14,376,862	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	216,330,000	216,453,308	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	152,482,000	152,677,176	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,623,000	14,180,861	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,591,000	15,271,086	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	276,201,000	275,756,316	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,864,000	12,089,178	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,558,000	25,323,964	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,300,000	14,870,856	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,367,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	291,057,000	290,015,015	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,971,000	13,430,303	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,129,000	15,926,600	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,925,000	13,401,415	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,110,000	15,908,412	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,242,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,106,000	12,250,666	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,445,000	12,591,726	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,874,000	21,292,208	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,435,000	21,950,868	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,104,000	25,012,159	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,793,000	26,575,864	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,175,000	29,265,844	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,216,000	30,311,884	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,974,000	64,409,677	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,179,000	13,645,800	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,700,000	30,447,543	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,240,000	13,702,208	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,044,000	13,635,806	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,426,000	33,467,118	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,243,000	12,652,773	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,749,000	33,847,608	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,745,000	31,671,583	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,331,000	15,115,765	

第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,800,000	64,417,600	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,824,000	34,789,501	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,802,000	14,424,884	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,219,000	45,726,998	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,990,000	43,355,123	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,066,000	43,479,038	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,658,000	92,499,351	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,726,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,810,000	99,228,146	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,286,000	50,479,150	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,406,000	51,018,471	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,907,000	51,610,578	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,874,000	45,065,718	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,877,000	44,746,865	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,352,000	51,062,129	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	180,462,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,533,000	136,198,132	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,092,000	183,727,349	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,443,000	51,523,067	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,116,000	53,303,764	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,976,000	54,050,362	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,533,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,916,000	171,449,971	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,395,000	58,398,150	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,858,000	120,229,353	
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,683,000	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,385,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,841,000	67,968,322	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,531,000	71,568,258	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,891,000	71,253,961	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	213,495,000	221,708,152	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,638,000	147,974,087	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,047,000	72,544,175	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,650,000	77,388,162	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,329,000	80,771,612	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,933,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,682,000	85,364,536	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,789,000	85,288,407	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,746,000	
	84,869,000	85,738,907	



第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,432,000	86,723,731	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,903,000	87,072,998	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,491,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,888,000	88,977,811	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,681,000	89,890,608	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,436,000	89,396,414	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,850,000	89,811,357	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,394,000	90,415,773	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,914,000	181,580,003	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,468,000	90,426,202	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,984,000	183,401,946	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,657,000	91,646,067	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,278,000	183,973,185	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,473,000	92,454,505	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,300,000	186,849,108	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,552,000	187,090,226	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	132,919,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,640,000	94,958,451	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,239,000	95,770,383	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,225,000	94,914,727	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,012,000	191,518,181	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,611,000	95,772,582	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,873,000	96,178,834	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,842,000	193,113,907	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,147,000	96,521,373	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	292,560,000	289,154,601	
	195,718,000	193,406,570	

第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,211,000	99,506,648	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,521,000	99,485,172	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,068,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,187,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,020,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,508,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,711,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	114,381,000	
第57回日本学生支援債券	100,000,000	99,978,000	
第58回日本学生支援債券	100,000,000	99,974,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	109,949,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,868,000	
い第800号商工債	200,000,000	199,896,000	
い第802号商工債	100,000,000	99,961,000	
い第804号商工債	300,000,000	299,754,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,960,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,916,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,078,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,081,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,166,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	99,986,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	99,862,000	
第221号商工債（3年）	200,000,000	200,064,000	
第236号商工債（3年）	300,000,000	299,427,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,865,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	118,645,000	
第37回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,009,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,006,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,190,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,006,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,446,000	
第42回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,715,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,473,000	
第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,994,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,347,000	
第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,222,000	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,199,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,656,000	
	200,000,000	198,572,000	

	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券			
	特殊債券合計	34,313,820,000	35,985,807,188	
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	99,329,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,533,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	294,495,000	
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,936,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,273,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,941,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,224,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,513,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,467,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,152,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,682,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,517,000	
	第1回HSBC・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	99,612,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	200,000,000	204,794,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	398,220,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,598,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,322,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,404,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,593,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,663,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,865,000	
	第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,368,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,586,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,386,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,304,000		
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,531,000		
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	99,155,000		
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,983,000		

第11回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,866,000	
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	99,457,000	
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	100,106,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,518,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,498,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,487,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,425,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,648,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,868,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,530,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,244,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,459,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,722,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,764,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,079,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,244,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,662,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,137,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,552,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,389,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,574,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,261,000	
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債	100,000,000	98,475,000	
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	100,490,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,613,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,062,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	199,910,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,879,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,304,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,810,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,578,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,390,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,045,000	
第11回JA三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,388,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,697,000	

第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,437,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,748,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,300,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,036,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,228,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	96,263,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,882,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,624,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,479,000	
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	99,710,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,560,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,740,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,066,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,930,000	
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	97,026,000	
第11回株式会社りそなホールディングス無担保社債	700,000,000	698,838,000	
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	118,468,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,452,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	114,385,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,914,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,422,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,402,000	
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	302,331,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,864,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,125,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,804,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,410,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,850,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,476,000	
第83回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	98,787,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,451,000	
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	199,460,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,566,000	
	200,000,000	199,010,000	

第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債			
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,951,000	
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	99,078,000	
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	199,436,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	198,574,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,296,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,855,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,331,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,031,000	
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	102,750,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,747,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,118,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,073,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,336,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,123,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,743,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,066,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,832,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	234,586,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,836,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,884,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,598,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,777,100	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,408,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,085,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,824,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,841,200	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,269,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	126,890,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,681,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	112,409,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,094,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	100,165,000	
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	197,866,000	

第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,222,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,465,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	202,784,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,844,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,489,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	101,613,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,188,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,534,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,653,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,269,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,119,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	97,043,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,637,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,080,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,763,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,718,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,253,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,115,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,314,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,711,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,977,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,227,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,033,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,170,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,363,380	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,420,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,916,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,640,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,523,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,119,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,266,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,325,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,678,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,956,000	
第317回北海道電力株式会社社債	200,000,000	206,274,000	
第320回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,364,790	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,224,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,268,000	
第344回北海道電力株式会社社債	200,000,000	199,976,000	
第351回北海道電力株式会社社債	200,000,000	199,708,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,435,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,672,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,583,000	

第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,783,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,961,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,986,000	
第6回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	99,650,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,713,000	
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	199,348,000	
社債券合計	22,566,000,000	22,828,547,470	
合計		534,473,334,331	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(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 5月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,489,222,305
コール・ローン	3,873,225,646
国債証券	264,618,239,989
派生商品評価勘定	30,117,859
未収入金	50,882
未収利息	1,776,679,978
前払費用	129,196,204
差入委託証拠金	484,241,369
流動資産合計	272,400,974,232
資産合計	272,400,974,232
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,991,767
前受金	19,829,046
未払金	1,399,576,084
未払解約金	79,015,708
未払利息	3,372
流動負債合計	1,531,415,977
負債合計	1,531,415,977
純資産の部	
元本等	



	2020年 5月11日現在
項目	金額（円）
元本	94,868,892,209
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	176,000,666,046
元本等合計	270,869,558,255
純資産合計	270,869,558,255
負債純資産合計	272,400,974,232

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年 5月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		94,868,892,209口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8552円 (28,552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 5月11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 5月11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

	2020年 5月11日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月12日
期首元本額	139,217,550,317円
期中追加設定元本額	9,664,997,250円
期中一部解約元本額	54,013,655,358円
期末元本額	94,868,892,209円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,632,932,893円

区分	2020年 5月11日現在
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	622,319,577円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	448,133,431円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,019,509,450円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,906,861円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,607,291,474円
世界経済インデックスファンド	6,468,658,069円
DCマイセレクション25	1,746,991,627円
DCマイセレクション50	1,309,207,702円
DCマイセレクション75	844,645,282円
DC外国債券インデックス・オープン	1,977,161,287円
DCマイセレクションS25	733,212,553円
DCマイセレクションS50	547,990,944円
DCマイセレクションS75	237,164,451円
DCターゲット・イヤーフンド2025	43,662,163円
DCターゲット・イヤーフンド2035	64,283,767円
DCターゲット・イヤーフンド2045	30,028,920円
DC世界経済インデックスファンド	8,436,722,606円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	602,453,955円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	30,905,007円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,454,903円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,876,546円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	50,195,925円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	80,741,779円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	123,269,428円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	128,500,127円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	237,976,045円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,848,261,214円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	519,887,298円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,909,918,720円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	760,898,333円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	68,782,169円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	529,352,735円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	30,886,754円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	216,932,067円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	269,622,961円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	880,880,976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）	2,035,756,523円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	793,370,537円
外国債券ファンド・シリーズ1	595,804,132円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンドA	1,656,350,336円
分散投資コア戦略ファンドS	5,810,356,988円

区分	2020年 5月11日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	305,186,752円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,782,912,343円
コア投資戦略ファンド(切替型)	563,477,235円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	195,750,525円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	93,996,399円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,059,653,153円
S M T インデックスバランス・オープン	177,147,270円
外国債券S M T Bセクション(S M A専用)	19,780,851,441円
S M T 世界経済インデックス・オープン	90,470,127円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	100,876,047円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	170,998,277円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,580,913円
グローバル経済コア	828,946,398円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	8,525,727円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	158,840円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	218,715,325円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	19,162,672円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	85,018円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	143,796円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	81,075円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	52,878円
F O F s 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)	624,736,186円
F O F s 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)	10,340,661,499円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	343,952,450円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	367,915,348円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	107,036,586円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	14,298,343,723
合計	14,298,343,723

(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 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,810,469,425	-	3,830,298,471	19,829,046
	合計	3,810,469,425	-	3,830,298,471	19,829,046

## (注)1. 時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2020年 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,761,544,254	-	3,738,841,300	22,702,954
	アメリカドル	1,762,256,705	-	1,758,093,600	4,163,105
	カナダドル	170,187,454	-	169,573,300	614,154
	ユーロ	1,539,782,081	-	1,524,240,000	15,542,081
	イギリスポンド	289,318,014	-	286,934,400	2,383,614
	合計	3,761,544,254	-	3,738,841,300	22,702,954

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

国債証券	アメリカドル				
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,908,910.14	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	5,059,082.05	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,837,460.94	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,699,296.87	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,160,156.30	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,179,882.80	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,593,847.65	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,153,437.52	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,144,726.55	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,603,007.83	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,083,968.75	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,150,312.52	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,298,828.10	
		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,932,546.89	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,945,253.88	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,652,128.88	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,646,699.21	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,846,315.62	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,042,890.63	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,582,128.90	
		T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	15,936,453.12	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,166,796.90	
		T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,239,257.80	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,827,539.09	
		T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,587,115.20	
		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,419,293.75	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,868,220.72	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,571,191.40	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,834,448.27	
		T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,672,304.71	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,920,828.14	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,860,085.93	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,859,255.83	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,235,703.16	
		T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,058,968.78	
		T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,605,024.97	
		T 1.75% 07/31/21	6,700,000.00	6,830,597.67	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,342,119.15	
		T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,199,123.06	
		T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,205,214.87	
		T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,576,806.65	
		T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,677,031.25	

T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,599,057.60
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,339,960.96
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,638,042.99
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,156,406.24
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,405,937.50
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,760,222.69
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,543,648.42
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,458,792.95
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,932,453.16
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,938,639.06
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,612,531.25
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,459,328.16
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,669,335.97
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,251,250.00
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,169,187.48
T 2.125% 08/15/21	5,370,000.00	5,503,410.93
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,581,439.46
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,636,875.04
T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,057,409.36
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,612,041.02
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,590,571.90
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,294,843.76
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,986,242.18
T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,160,156.24
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,547,148.42
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,076,640.64
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,599,378.94
T 2.25% 08/15/46	10,790,000.00	12,840,100.00
T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	12,326,859.42
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,843,621.07
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	11,031,781.25
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,843,265.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,609,238.31
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,825,898.46
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,148,125.00
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,296,093.75
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,221,250.02
T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,465,093.78
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,127,343.75
T 2.375% 05/15/29	15,010,000.00	17,293,161.79
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,602,539.12
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,753,398.47
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,823,687.50



T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,511,914.05	
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,119,617.16	
T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,450,484.37	
T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,562,578.12	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,317,837.88	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,601,433.57	
T 2.5% 05/15/46	10,050,000.00	12,498,902.39	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,885,740.22	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,276,066.80	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,693,763.33	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,494,937.50	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,056,279.31	
T 2.625% 06/15/21	10,000,000.00	10,272,460.90	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,268,265.62	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,447,490.22	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,801,464.83	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,538,633.57	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,279,375.00	
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,665,625.00	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,870,421.88	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,179,184.39	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,170,742.21	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,081,015.63	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,359,648.41	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,838,593.75	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,486,433.61	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,761,152.36	
T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,417,656.28	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,655,500.00	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,375,015.64	
T 2.75% 11/15/47	4,550,000.00	5,972,230.49	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,500,468.76	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,565,665.62	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,724,773.43	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,565,626.56	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,304,065.62	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,169,586.73	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,559,746.91	
T 2.875% 08/15/45	9,300,000.00	12,289,078.12	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,173,046.87	
T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,530,654.31	
T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	6,001,230.45	

T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,691,991.20
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,394,833.60
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,580,859.37
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,248,242.20
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,130,521.07
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,755,078.15
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,654,662.09
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,874,589.85
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,556,562.48
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,888,437.50
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,121,875.00
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,474,842.56
T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,829,701.58
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,802,836.90
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,447,656.30
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,466,937.51
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,206,868.75
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,092,109.38
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,265,656.25
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,188,105.48
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,744,960.95
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,609,375.00
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,399,822.66
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,151,531.29
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,368,652.35
T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,388,696.87
T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	10,762,937.50
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,094,182.03
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,517,875.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,922,187.50
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,946,718.76
T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	8,193,710.96
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,162,312.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	6,110,406.25
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,698,281.25
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,157,510.94
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,709,414.08
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,808,871.12
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,515,039.06
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,786,851.55
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,705,664.05
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	8,115,035.18
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,396,054.69

T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,674,812.50	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,557,031.25	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	3,009,273.44	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,102,785.16	
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,987,846.87	
T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,439,283.60	
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,528,250.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,718,273.44	
T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,869,545.32	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,243,710.93	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,807,179.69	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,747,265.62	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,804,257.81	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,904,128.91	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,677,000.00	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,243,667.97	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,049,824.22	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,621,347.66	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,974,650.38	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,902,539.07	
アメリカドル 小計	1,029,250,000.00	1,154,742,212.56 (123,499,679,633)	
カナダドル			
CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,047,631.25	
CAN 0.5% 09/01/25	700,000.00	703,265.50	
CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,717,442.00	
CAN 1.25% 06/01/30	1,730,000.00	1,843,444.75	
CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,907,354.00	
CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,235,670.15	
CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,110,365.75	
CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,448,910.00	
CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	629,028.00	
CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,770,519.60	
CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,739,177.00	
CAN 1% 06/01/27	500,000.00	518,472.50	
CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,525,417.50	
CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,466,462.50	
CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,969,884.00	
CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,524,566.30	
CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,958,202.00	
CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,858,509.55	
CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,742,814.80	
CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	871,376.80	

	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,465,012.30
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,226,883.45
	CAN 2% 12/01/51	1,970,000.00	2,404,375.15
	CAN 3.25% 06/01/21	1,840,000.00	1,898,098.00
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,249,590.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,850,000.00	2,863,134.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,707,304.95
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,592,568.00
	CAN 5% 06/01/37	1,580,000.00	2,587,542.30
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,813,535.50
	カナダドル 小計	58,080,000.00	67,396,557.60 (5,172,011,830)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,498,382.00
	MBONO 10% 12/05/24	25,860,000.00	31,034,586.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,213,210.65
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,074,737.15
	MBONO 6.5% 06/10/21	39,660,000.00	40,325,098.20
	MBONO 6.75% 03/09/23	10,400,000.00	10,907,208.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,263,009.30
	MBONO 7.5% 06/03/27	41,630,000.00	46,394,969.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	19,007,377.20
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,493,250.85
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	17,722,717.40
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,577,547.90
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,214,981.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,411,989.20
	MBONO 8% 11/07/47	18,770,000.00	21,143,278.80
MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,648,011.80	
	メキシコペソ 小計	408,420,000.00	451,930,355.25 (2,047,244,509)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,060,000.00	1,066,736.30
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,547,787.75
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	662,679.45
	BGB 0.5% 10/22/24	970,000.00	1,009,983.40
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,310,996.20
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,808,984.45
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,676,805.00
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,681,827.50
	BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,335,028.85
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	963,096.75
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	615,576.45
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,805,422.40
	BGB 1.7% 06/22/50	630,000.00	788,898.60

BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,588,684.80
BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,565,556.70
BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,637,659.00
BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,399,692.90
BGB 2.25% 06/22/23	1,450,000.00	1,578,274.25
BGB 2.25% 06/22/57	680,000.00	991,127.20
BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,749,953.20
BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,229,727.50
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,416,141.85
BGB 4.25% 03/28/41	2,140,000.00	3,666,793.70
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,506,416.00
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,345,101.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,464,740.40
BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,326,377.90
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,568,143.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,025,579.00
BGB 5% 03/28/35	2,920,000.00	4,892,182.60
BKO 0% 03/11/22	3,100,000.00	3,145,043.00
BKO 0% 06/11/21	2,640,000.00	2,659,430.40
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	1,991,896.90
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	556,289.60
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,573,756.40
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,402,177.00
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,150,524.25
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,197,410.50
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,008,110.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,590,010.40
BTPS 0.95% 08/01/30	650,000.00	594,876.75
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,030,200.50
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,920,623.25
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	956,440.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,938,193.00
BTPS 1.45% 03/01/36	550,000.00	495,874.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,315,732.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,067,939.25
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,426,124.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,430,991.10
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,204,756.30
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,909,827.20
BTPS 1.75% 07/01/24	1,600,000.00	1,637,264.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,057,320.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,771,280.00
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,175,228.00

BTPS 2.05% 08/01/27	1,740,000.00	1,792,034.70	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,312,720.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,563,275.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	3,680,000.00	3,826,390.40	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,392,182.30	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,767,810.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,596,612.50	
BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	835,347.90	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,107,126.80	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,127,000.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,114,359.25	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,564,893.70	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,325,557.20	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,047,030.65	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,750,000.00	2,977,851.25	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,692,297.75	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,158,363.90	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,559,962.30	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,179,017.75	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,210,000.00	1,382,170.90	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,451,546.80	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,529,566.80	
BTPS 3.75% 08/01/21	3,220,000.00	3,349,009.30	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,377,835.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,201,032.80	
BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,455,008.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,098,961.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,433,464.80	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,962,540.90	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,494,266.65	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,171,970.25	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,476,552.30	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,028,575.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,164,364.90	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	3,889,004.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,607,120.60	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,385,612.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,847,854.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,318,575.80	
BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,507,790.00	
BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,161,244.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	4,574,899.80	

BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,439,395.40
BTPS 6.5% 11/01/27	3,520,000.00	4,704,462.40
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,485,957.50
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,891,575.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,019,504.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,414,275.00
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,190,327.45
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,343,282.00
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,186,675.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,220,710.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,610,429.70
DBR 0.5% 08/15/27	3,160,000.00	3,437,906.20
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,763,779.60
DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,678,033.80
DBR 0% 08/15/29	2,510,000.00	2,647,033.45
DBR 0% 08/15/50	860,000.00	880,210.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,050,000.00	4,228,687.75
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,152,015.20
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,333,395.70
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,505,202.75
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,951,004.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,811,766.00
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,205,315.75
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,155,940.00
DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,511,317.60
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,026,176.75
DBR 2.5% 07/04/44	3,320,000.00	5,500,078.00
DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,839,246.10
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,452,889.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,125,593.90
DBR 3.25% 07/04/21	4,100,000.00	4,285,935.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,940,000.00	5,235,757.80
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,099,049.70
DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,680,186.05
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,690,411.00
DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,515,096.40
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,757,748.20
DBR 5.5% 01/04/31	2,140,000.00	3,551,019.70
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,501,261.40
DBR 6.25% 01/04/24	5,440,000.00	6,858,235.20
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,093,093.75
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,494,794.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,530,000.00	4,691,177.40

FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,267,667.90	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,352,694.90	
FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,214,100.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	5,640,000.00	6,059,108.40	
FRTR 0.75% 05/25/52	1,550,000.00	1,552,751.25	
FRTR 0.75% 11/25/28	4,570,000.00	4,916,748.75	
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,020,840.00	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,378,475.25	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,073,432.75	
FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,201,547.35	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,121,873.50	
FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,099,693.50	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,281,250.40	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,817,658.35	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,053,810.45	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,293,189.10	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,330,000.00	4,037,491.80	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,920,043.95	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,432,432.30	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,288,531.60	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,408,052.35	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,060,292.75	
FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,907,385.20	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,565,862.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,146,105.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,160,000.00	6,468,859.80	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,756,724.50	
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,621,020.30	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,190,000.00	5,144,225.90	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,963,857.50	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,822,025.25	
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	9,089,309.10	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,868,279.60	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	8,676,370.50	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,103,372.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	4,097,632.25	
FRTR 4% 04/25/60	1,850,000.00	3,887,349.50	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,516,487.80	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,782,995.55	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,362,853.40	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,570,861.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,269,370.00	



IRISH 0.2% 05/15/27	1,270,000.00	1,289,265.90
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	472,704.00
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	839,147.00
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,144,236.60
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	535,323.85
IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	1,001,121.00
IRISH 1.3% 05/15/33	630,000.00	703,461.15
IRISH 1.35% 03/18/31	390,000.00	435,546.15
IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	732,645.90
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	885,270.00
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,516,595.50
IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,707,517.00
IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,401,363.95
IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,327,550.40
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,134,295.65
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,924,555.40
NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,507,052.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,686,664.00
NETHER 0.5% 01/15/40	760,000.00	837,520.00
NETHER 0.5% 07/15/26	1,860,000.00	1,981,020.90
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,296,924.90
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,774,207.80
NETHER 0% 01/15/22	980,000.00	991,260.20
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,895,769.00
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,653,856.40
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,300,072.30
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	702,969.30
NETHER 2.5% 01/15/33	1,650,000.00	2,219,613.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,130,000.00	3,664,239.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,213,755.60
NETHER 3.25% 07/15/21	2,740,000.00	2,863,409.60
NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,294,858.00
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,747,696.20
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,555,423.85
NETHER 5.5% 01/15/28	1,380,000.00	2,015,931.60
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	244,579.00
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,992,002.50
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,690,876.25
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,892,856.25
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,272,802.70
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,240,308.80
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,626,845.00
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,552,370.60

OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,432,614.25
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,238,544.45
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	940,066.95
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,743,776.10
RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	613,914.00
RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,294,261.90
RAGB 0% 02/20/30	470,000.00	475,043.10
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,528,537.50
RAGB 0% 07/15/24	920,000.00	940,442.40
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	325,008.00
RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,809,458.10
RAGB 1.5% 02/20/47	830,000.00	1,077,912.70
RAGB 1.5% 11/02/86	450,000.00	653,280.75
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,086,713.10
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,438,800.65
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,446,477.60
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,360,120.15
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,393,279.50
RAGB 3.4% 11/22/22	2,990,000.00	3,299,450.05
RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,826,992.45
RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,257,956.20
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,065,405.40
RAGB 4.15% 03/15/37	1,770,000.00	2,950,501.50
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,717,324.85
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,735,260.80
RFGB 0.125% 04/15/36	510,000.00	508,421.55
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	654,010.10
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,384,290.10
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	709,506.55
RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	688,837.50
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	545,922.50
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	739,217.70
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	394,785.30
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	550,878.30
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	429,366.00
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	732,652.80
RFGB 1.375% 04/15/47	450,000.00	577,323.00
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	690,833.00
RFGB 1.625% 09/15/22	1,250,000.00	1,317,393.75
RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	866,958.60
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	522,652.20
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	804,474.60

RFGB 4% 07/04/25	640,000.00	789,980.80
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,937,633.15
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,304,495.70
SPGB 0.35% 07/30/23	1,440,000.00	1,457,359.20
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,417,903.25
SPGB 0.45% 10/31/22	2,210,000.00	2,242,674.85
SPGB 0.5% 04/30/30	2,150,000.00	2,090,821.25
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,744,193.60
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,226,499.00
SPGB 0% 01/31/25	870,000.00	862,304.85
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,382,867.90
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,174,150.25
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,648,547.50
SPGB 1.4% 04/30/28	4,430,000.00	4,702,555.75
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,504,088.50
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,044,941.90
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,770,638.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,263,896.50
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,259,840.00
SPGB 1.85% 07/30/35	1,820,000.00	2,000,735.10
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,074,814.40
SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,790,944.30
SPGB 1% 10/31/50	1,180,000.00	1,011,029.90
SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,599,622.60
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,842,099.80
SPGB 2.7% 10/31/48	1,780,000.00	2,241,918.90
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,021,218.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	2,811,343.50
SPGB 3.45% 07/30/66	1,500,000.00	2,294,617.50
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,892,531.60
SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	3,965,352.00
SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,026,186.15
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,489,451.20
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,246,347.60
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,826,480.00
SPGB 4.9% 07/30/40	2,590,000.00	4,216,714.25
SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,339,442.30
SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,230,470.00
SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,335,739.50
SPGB 5.5% 04/30/21	3,390,000.00	3,576,314.40
SPGB 5.75% 07/30/32	2,730,000.00	4,254,227.25
SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,725,441.00
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,653,125.40

	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,521,135.00	
	ユーロ 小計	749,330,000.00	884,227,522.55 (102,570,392,615)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/31/23	1,090,000.00	1,091,547.80	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,580,143.60	
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,496,543.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,978,268.60	
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,936,736.60	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,238,962.35	
	UKT 1.25% 10/22/41	650,000.00	739,277.50	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,180,990.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,697,017.80	
	UKT 1.625% 10/22/28	4,040,000.00	4,549,423.80	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,494,960.50	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,530,000.00	2,455,856.55	
	UKT 1.75% 01/22/49	2,120,000.00	2,795,421.40	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,030,000.00	2,925,128.50	
	UKT 1.75% 09/07/22	2,470,000.00	2,570,516.65	
	UKT 1.75% 09/07/37	3,530,000.00	4,256,315.15	
	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,218,187.50	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,686,200.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,350,000.00	4,356,148.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,810,082.70	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,970,201.90	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,820,000.00	4,493,049.60	
	UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	5,074,507.65	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	5,033,440.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	4,109,117.65	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,958,729.90	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,790,000.00	4,406,749.20	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,849,661.75	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,171,870.20	
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	877,475.55	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,914,478.80	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	4,165,424.10	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,800,572.65	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	5,160,089.55	
UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,777,200.80		
UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,522,931.40		
UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,267,350.00		
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,337,141.00		
UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	4,416,950.40		

	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,092,740.00
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,450,368.80
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,872,681.25
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	803,170.10
イギリスポンド 小計		96,200,000.00	135,583,630.75 (18,012,285,345)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,615,124.50
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,240,388.50
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,317,625.00
	SGB 1% 11/12/26	8,640,000.00	9,349,603.20
	SGB 2.5% 05/12/25	8,370,000.00	9,561,762.45
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,335,363.50
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,875,044.50
スウェーデンクローナ 小計		61,110,000.00	69,294,911.65 (756,700,435)
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	3,610,000.00	3,968,888.15
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,303,413.75
	NGB 1.75% 02/17/27	4,120,000.00	4,555,484.00
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,618,460.45
	NGB 1.75% 09/06/29	5,420,000.00	6,122,432.00
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,576,420.50
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,964,819.70
	NGB 3.75% 05/25/21	11,380,000.00	11,823,194.10
	NGB 3% 03/14/24	6,830,000.00	7,624,226.55
ノルウェークローネ 小計		57,620,000.00	62,557,339.20 (653,098,621)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,206,709.30
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,488,611.00
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,456,488.50
	DGB 1.5% 11/15/23	7,380,000.00	7,929,736.20
	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	10,068,039.20
	DGB 3% 11/15/21	8,330,000.00	8,781,652.60
	DGB 4.5% 11/15/39	16,530,000.00	31,159,959.15
デンマーククローネ 小計		67,500,000.00	86,091,195.95 (1,338,718,097)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	4,550,000.00	4,620,092.75
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,865,924.55
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,165,603.50
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,158,508.40
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,010,528.80
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,750,000.00	5,108,340.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,443,136.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,609,663.90

	POLGB 2.75% 10/25/29	4,060,000.00	4,494,521.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,480,000.00	3,867,324.00	
	POLGB 4% 10/25/23	4,900,000.00	5,449,339.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	813,669.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,531,827.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,659,454.00	
	ポーランドズロチ 小計	56,380,000.00	60,797,932.65 (1,550,347,282)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,800,000.00	1,791,720.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,988,073.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,060,000.00	2,167,356.90	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,570,000.00	3,977,461.95	
	ACGB 2.25% 11/21/22	4,050,000.00	4,256,529.75	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,356,188.10	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,604,838.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	955,740.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	730,000.00	878,930.95	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,825,870.30	
	ACGB 2.75% 11/21/28	2,960,000.00	3,428,360.80	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,433,455.25	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,985,024.30	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,968,348.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,941,361.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,689,857.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,193,496.20	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,130,928.80	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,512,205.50	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,699,288.40	
ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,312,498.00		
ACGB 5.5% 04/21/23	2,820,000.00	3,255,408.00		
ACGB 5.75% 05/15/21	3,450,000.00	3,641,751.00		
ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,752,217.75		
	オーストラリアドル 小計	67,390,000.00	77,746,909.95 (5,432,954,067)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,458,021.60	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	828,040.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	297,392.10	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	805,342.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,080,000.00	1,101,859.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	510,000.00	590,534.10	
	SIGB 2.375% 06/01/25	320,000.00	348,448.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	311,795.90	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,200,228.75	

	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,646,279.80
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	789,452.85
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,145,135.40
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	987,117.60
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	415,754.50
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	432,625.85
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	679,827.20
	SIGB 3.375% 09/01/33	840,000.00	1,079,883.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,042,118.00
	SIGB 3% 09/01/24	840,000.00	928,355.40
	シンガポールドル 小計	14,210,000.00	16,088,211.25 (1,217,394,945)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,538,272.50
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	728,423.50
	MGS 3.48% 03/15/23	2,840,000.00	2,931,888.20
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,593,155.70
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,267,149.80
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,056,588.70
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	363,956.25
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,552,815.00
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,735,422.10
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,521,632.25
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	772,593.75
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,093,999.05
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	794,532.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,215,557.95
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,121,561.95
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,546,372.80
	MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,747,229.60
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,102,316.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,025,875.00
	MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	473,380.55
	MGS 4.16% 07/15/21	2,030,000.00	2,077,776.05
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,367,673.60
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,237,060.00
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	904,045.05
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,677,448.60
	MGS 4.498% 04/15/30	1,410,000.00	1,597,276.20
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,742,895.00
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,748,620.00
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,695,735.20	
MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	963,084.00	

	MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,270,951.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	2,550,000.00	3,072,903.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,738,726.20	
	マレーシアリングット 小計	49,750,000.00	54,276,917.05 (1,339,554,312)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,838,383.82	
	ILGOV 1% 03/31/30	830,000.00	840,895.16	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,160,000.00	2,418,077.01	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,617,285.81	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,100,000.00	2,971,894.17	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	3,160,000.00	3,455,399.32	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,448,386.46	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,176,376.64	
	イスラエルシェケル 小計	27,680,000.00	33,766,698.39 (1,027,858,298)	
	合計		264,618,239,989 (264,618,239,989)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 190銘柄	100.0%	46.7%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 312銘柄	100.0%	38.8%
イギリスポンド	国債証券 43銘柄	100.0%	6.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表



該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 新興国債券インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

	2020年 5月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,116,677,878
コール・ローン	1,173,233,170
国債証券	50,150,342,047
派生商品評価勘定	16,272,953
未収入金	1,838,267,458
未収利息	930,516,941
前払費用	71,542,473
流動資産合計	55,296,852,920
資産合計	55,296,852,920
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,700,486
未払金	1,930,873,212
未払解約金	13,492,949
未払利息	1,021
流動負債合計	1,955,067,668
負債合計	1,955,067,668
純資産の部	
元本等	
元本	34,488,541,260
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	18,853,243,992
元本等合計	53,341,785,252
純資産合計	53,341,785,252
負債純資産合計	55,296,852,920

##### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

2020年 5月11日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 5月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	34,488,541,260口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5467円 (15,467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 5月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2020年 5月11日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月12日
期首元本額	30,670,496,451円
期中追加設定元本額	5,202,986,197円
期中一部解約元本額	1,384,941,388円
期末元本額	34,488,541,260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	4,179,918,012円
世界経済インデックスファンド	5,889,959,082円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,474,932,916円
DC世界経済インデックスファンド	7,584,732,314円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,820,926,962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）	97,437,378円
分散投資コア戦略ファンドA	240,523,876円
分散投資コア戦略ファンドS	1,167,243,911円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	274,443,087円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,616,073,061円
コア投資戦略ファンド（切替型）	86,647,214円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,542,481円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	90,746,259円
SMT インデックスバランス・オープン	163,113,990円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,277,197,680円
SMT 世界経済インデックス・オープン	122,705,743円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	138,738,280円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	228,872,736円

区分	2020年 5月11日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,051,815円
グローバル経済コア	723,407,080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	133,620円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	162,778円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	86,689円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	49,670円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	91,925,339円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	142,193,733円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	310,097,432円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		100,381,300
合計		100,381,300

(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)

## 通貨関連

(2020年 5月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,664,643,071	-	1,680,916,024	16,272,953
	アメリカドル	611,869,104	-	616,068,023	4,198,919
	メキシコペソ	458,350,000	-	465,560,000	7,210,000
	ブラジルリアル	431,406,201	-	435,425,710	4,019,509
	チェココルナ	162,894,461	-	163,738,313	843,852
	ハンガリーフォリント	123,305	-	123,978	673
	売建	1,098,616,605	-	1,109,317,091	10,700,486
	アメリカドル	431,406,201	-	433,758,736	2,352,535
	ハンガリーフォリント	10,189,700	-	10,285,800	96,100
	ポーランドズロチ	298,681,600	-	300,782,000	2,100,400
	タイバーツ	186,469,104	-	189,890,555	3,421,451

	南アフリカランド	171,870,000	-	174,600,000	2,730,000
	合計	2,763,259,676	-	2,790,233,115	5,572,467

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	41,421,072.00			
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	98,708,225.00			
		MBONO 5.75% 03/05/26	61,800,000.00	63,206,259.00			
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	111,684,581.00			
		MBONO 6.5% 06/10/21	79,150,000.00	80,477,345.50			
		MBONO 6.75% 03/09/23	19,950,000.00	20,922,961.50			
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	85,356,924.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000.00	102,697,489.00			
		MBONO 7.75% 05/29/31	56,200,000.00	63,659,988.00			
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	67,355,722.50			
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	27,300,720.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	106,000,000.00	125,437,220.00			
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	57,094,339.25			
		MBONO 8% 09/05/24	54,800,000.00	61,066,928.00			
		MBONO 8% 11/07/47	68,850,000.00	77,555,394.00			
		MBONO 8% 12/07/23	112,900,000.00	124,064,681.00			
			メキシコペソ 小計		1,089,300,000.00	1,208,009,849.75 (5,472,284,619)	
			ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	27,070,433.36	
	BLTN 0% 01/01/24			11,800,000.00	9,663,535.66		
BLTN 0% 07/01/21	24,650,000.00			23,895,880.08			
BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00			25,398,546.11			
BLTN 0% 07/01/23	48,550,000.00			41,513,692.19			

	BNTNF 10% 01/01/23	47,100,000.00	53,306,492.65	
	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000.00	40,392,328.79	
	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000.00	27,411,748.99	
	BNTNF 10% 01/01/29	12,700,000.00	14,508,856.77	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,482,250.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	500,625.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,935,625.00	
	ブラジルレアル 小計	263,850,000.00	267,080,014.60	(4,983,713,072)
チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,855,000,000.00	2,133,484,796.62	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,470,000,000.00	1,748,017,474.98	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,300,000,000.00	1,415,659,931.40	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,170,000,000.00	2,721,817,921.41	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,650,000,000.00	2,411,500,992.45	
	チリペソ 小計	8,445,000,000.00	10,430,481,116.86	(1,348,661,208)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	89,700,000,000.00	104,494,221,000.00	
	コロンビアペソ 小計	89,700,000,000.00	104,494,221,000.00	(2,873,591,077)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,790,183.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,400,000.00	5,767,821.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,650,000.00	4,187,845.75	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,194,579.25	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	8,025,045.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,200,000.00	9,685,184.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	8,626,725.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,150,000.00	8,695,079.25	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,254,741.25	
	ペルーヌエボソル 小計	55,650,000.00	64,227,203.50	(2,015,449,645)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	13,369,902.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	16,548,690.25	
	ウルグアイペソ 小計	32,950,000.00	29,918,592.25	(73,001,365)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	18,894,480.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	21,486,875.00	
	ドミニカペソ 小計	45,400,000.00	40,381,355.00	(75,109,320)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,751,749.50	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	7,779,810.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	9,032,887.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	10,874,323.75	

	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	8,632,725.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	5,600,000.00	5,709,760.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	10,195,069.50	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	5,174,000.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,785,370.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,683,478.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	6,279,455.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	11,100,000.00	9,382,719.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	9,500,000.00	9,552,155.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,999,565.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,531,452.50	
	トルコリラ 小計	112,650,000.00	108,364,519.75 (1,635,220,603)	
チェココ ルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	46,739,338.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	53,300,000.00	53,515,332.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	41,600,000.00	41,143,024.00	
	CZGB 1% 06/26/26	60,300,000.00	60,885,814.50	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	55,881,105.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	55,000,000.00	61,696,525.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	56,045,421.00	
	CZGB 2% 10/13/33	50,400,000.00	54,818,568.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	48,000,000.00	50,484,480.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	43,400,000.00	47,893,202.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	45,626,236.50	
	チェココルナ 小計	538,600,000.00	574,729,046.00 (2,448,345,735)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	561,388,050.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	571,109,160.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	265,000,000.00	270,117,150.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	462,500,000.00	492,393,687.50	
	HGB 3.25% 10/22/31	162,000,000.00	181,527,480.00	
	HGB 3% 06/26/24	512,500,000.00	542,576,062.50	
	HGB 3% 08/21/30	439,000,000.00	477,956,860.00	
	HGB 3% 10/27/27	678,000,000.00	730,341,600.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	688,000,000.00	821,843,520.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	612,747,450.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	454,916,360.00	
HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	314,021,400.00		
	ハンガリーフォリント 小計	5,453,000,000.00	6,030,938,780.00 (2,001,668,581)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	12,650,000.00	12,844,873.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,397,260.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	5,600,000.00	5,935,720.00	



	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,913,706.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000.00	15,946,118.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000.00	17,690,988.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000.00	17,592,273.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	12,950,000.00	14,194,883.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	13,050,000.00	14,446,676.25	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,724,725.00	
	POLGB 4% 10/25/23	16,250,000.00	18,071,787.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,165,182.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	5,350,000.00	5,758,258.50	
	<b>ポーランドズロチ 小計</b>	<b>169,600,000.00</b>	<b>182,682,452.25</b>	<b>(4,658,402,532)</b>
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	170,645,006.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	170,405,370.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	191,860,920.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	175,746,997.50	
	RFLB 7.15% 11/12/25	98,200,000.00	106,224,413.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	178,273,770.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	168,200,000.00	181,785,514.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	174,490,062.50	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	126,831,450.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	138,700,000.00	146,180,784.50	
	RFLB 7.65% 04/10/30	113,500,000.00	128,424,682.50	
	RFLB 7.7% 03/16/39	116,500,000.00	136,617,220.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	180,909,210.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	202,196,100.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	205,030,465.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	101,854,908.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	113,243,936.00	
	RFLB 7% 12/15/21	170,500,000.00	175,756,515.00	
RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	178,983,480.00		
RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	148,283,067.75		
	<b>ロシアルーブル 小計</b>	<b>2,919,450,000.00</b>	<b>3,193,743,871.75</b>	<b>(4,630,928,614)</b>
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,359,115.75	
	MGS 3.502% 05/31/27	4,750,000.00	5,011,582.50	
	MGS 3.62% 11/30/21	10,700,000.00	10,934,276.50	
	MGS 3.733% 06/15/28	12,450,000.00	13,266,595.50	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,043,393.75	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	9,043,012.75	
	MGS 3.828% 07/05/34	5,750,000.00	6,267,960.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	13,900,000.00	15,128,760.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,538,622.50	

	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,644,653.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	9,014,124.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	12,005,504.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,000,000.00	7,463,750.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	11,850,000.00	12,128,889.75	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	10,097,277.75	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,700,000.00	7,921,678.00	
	マレーシアリングット 小計	142,350,000.00	151,869,196.25 (3,748,131,763)	
タイバーツ	THAIGB 1.45% 12/17/24	36,000,000.00	37,047,420.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	40,000,000.00	41,539,800.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	39,500,000.00	41,477,567.50	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	75,300,000.00	77,265,706.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	94,500,000.00	101,303,527.50	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	101,000,000.00	107,097,875.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	74,969,655.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	84,500,000.00	87,431,727.50	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	111,800,000.00	144,666,964.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	144,200,000.00	184,692,802.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	91,549,500.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	141,723,427.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	75,600,000.00	79,267,734.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	102,495,528.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	82,400,000.00	95,593,476.00	
THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000.00	133,098,654.00		
	タイバーツ 小計	1,330,300,000.00	1,541,221,364.50 (5,132,267,143)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	14,849,700.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	34,864,050.00	
	フィリピンペソ 小計	45,000,000.00	49,713,750.00 (105,393,150)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,392,043,500.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	18,368,856,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,319,384,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	37,900,000,000.00	36,578,995,500.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	31,793,400,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	10,200,000,000.00	9,779,811,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	20,475,240,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	26,700,000,000.00	24,619,536,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	6,200,000,000.00	5,841,795,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	23,171,625,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	36,338,339,000.00	

	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	34,821,632,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	32,200,000,000.00	29,841,672,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	29,600,000,000.00	30,313,508,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	38,000,000,000.00	38,264,290,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	32,813,386,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	18,946,494,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	31,800,000,000.00	32,713,773,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000.00	74,722,098,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	51,470,900,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	21,068,772,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000.00	51,673,620,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	33,692,118,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,611,421,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	33,700,000,000.00	35,054,571,500.00	
	インドネシアルピア 小計	726,800,000,000.00	720,687,280,500.00 (5,116,879,691)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	108,700,000.00	124,412,585.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	23,295,671.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	52,700,000.00	34,025,491.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	51,200,000.00	54,571,264.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	34,328,668.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	44,320,751.25	
	SAGB 8.5% 01/31/37	71,000,000.00	58,612,275.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	55,354,189.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	71,992,320.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	54,004,467.50	
	SAGB 8% 01/31/30	79,050,000.00	72,681,336.75	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	29,569,750.00	
	南アフリカランド 小計	743,600,000.00	657,168,770.00 (3,831,293,929)	
	合計		50,150,342,047 (50,150,342,047)	

## 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%	10.9%
ブラジルリアル	国債証券 12銘柄	100.0%	9.9%

チリペソ	国債証券	5銘柄	100.0%	2.7%
コロンビアペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	5.7%
ペルーヌエボソル	国債証券	9銘柄	100.0%	4.0%
ウルグアイペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券	15銘柄	100.0%	3.3%
チェココルナ	国債証券	11銘柄	100.0%	4.9%
ハンガリーフォリント	国債証券	12銘柄	100.0%	4.0%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	9.3%
ロシアルーブル	国債証券	20銘柄	100.0%	9.2%
マレーシアリングット	国債証券	16銘柄	100.0%	7.5%
タイバーツ	国債証券	16銘柄	100.0%	10.2%
フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券	25銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	7.6%

(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。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2020年 5月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,529,833,626
投資証券	108,662,288,760
派生商品評価勘定	307,993,340
未収入金	10,513,519
未収配当金	1,110,931,049
前払金	203,579,260
差入委託証拠金	524,513,000
流動資産合計	113,349,652,554
資産合計	113,349,652,554
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	511,572,600
未払金	166,791,549
未払解約金	100,793,226

	2020年 5月11日現在
項目	金額（円）
未払利息	2,202
流動負債合計	779,159,577
負債合計	779,159,577
純資産の部	
元本等	
元本	66,810,950,533
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	45,759,542,444
元本等合計	112,570,492,977
純資産合計	112,570,492,977
負債純資産合計	113,349,652,554

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 5月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,810,950,533口

	2020年 5月11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 (1万口当たり純資産額)	1.6849円 (16,849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 5月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 5月11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

	2020年 5月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月12日
期首元本額	57,851,231,573円
期中追加設定元本額	12,829,452,022円
期中一部解約元本額	3,869,733,062円
期末元本額	66,810,950,533円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,606,087,520円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,241,491円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	14,517,611,140円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	31,411,730,115円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,260,170,305円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,024,464,783円
分散投資コア戦略ファンド A	2,944,977,094円
分散投資コア戦略ファンド S	5,970,372,520円

区分	2020年 5月11日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,107,909,967円
SMT インデックスバランス・オープン	31,136,848円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	427,055,025円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,832,618円
グローバル経済コア	286,244,428円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	6,976,487円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	489,812,542円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	43,326,401円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,026,996,342円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	5,477,077円
J-REITパッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	313,245円
J-REITパッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	929,011,678円
J-REITパッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	393,380,382円
J-REITパッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	319,822,525円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	25,691,074,683
合計	25,691,074,683

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（2020年 5月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	4,100,792,260	-	3,897,213,000	203,579,260
合計		4,100,792,260	-	3,897,213,000	203,579,260

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,522	164,071,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,813	187,645,500	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,787	362,310,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,157	2,635,538,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	16,050	1,369,065,000	
	森ヒルズリート投資法人	14,393	2,029,413,000	
	産業ファンド投資法人	16,112	2,555,363,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,866	3,844,584,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,162	1,403,047,800	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	6,269	2,316,395,500	
	G L P 投資法人	31,159	4,222,044,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,447	1,740,316,500	
	日本プロロジスリート投資法人	18,825	5,472,427,500	
	星野リゾート・リート投資法人	1,904	768,264,000	
	O n e リート投資法人	1,950	508,560,000	
	イオンリート投資法人	13,501	1,613,369,500	
	ヒューリックリート投資法人	10,639	1,399,028,500	
	日本リート投資法人	4,063	1,440,333,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	80,373	1,239,351,660	
	積水ハウス・リート投資法人	36,579	2,505,661,500	
	トーセイ・リート投資法人	2,723	288,638,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,832	936,441,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,668	326,830,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,504	251,902,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	40,387	5,266,464,800	
	いちごホテルリート投資法人	2,072	138,409,600	
	ラサールロジポート投資法人	11,632	1,848,324,800	
	スターアジア不動産投資法人	4,152	375,756,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,233	130,574,700	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,560	1,658,960,000	
大江戸温泉リート投資法人	2,126	144,568,000		

さくら総合リート投資法人	2,707	213,311,600	
投資法人みらい	14,227	573,348,100	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,935	279,705,500	
三菱地所物流リート投資法人	2,463	919,930,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	2,352	358,209,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,816	177,060,000	
タカラレーベン不動産投資法人	3,550	317,370,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,604	338,259,600	
日本ビルファンド投資法人	12,115	8,177,625,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,510	7,668,630,000	
日本リテールファンド投資法人	23,644	3,492,218,800	
オリックス不動産投資法人	24,927	3,636,849,300	
日本プライムリアルティ投資法人	8,222	2,729,704,000	
プレミア投資法人	11,300	1,336,790,000	
東急リアル・エステート投資法人	8,388	1,297,623,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,687	866,093,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	28,090	3,511,250,000	
森トラスト総合リート投資法人	8,941	1,173,953,300	
インヴィンシブル投資法人	54,876	1,695,668,400	
フロンティア不動産投資法人	4,444	1,535,402,000	
平和不動産リート投資法人	7,791	820,392,300	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,174	2,309,155,000	
福岡リート投資法人	6,470	826,866,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,870	2,306,520,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,687	717,806,700	
大和証券オフィス投資法人	2,888	1,833,880,000	
阪急阪神リート投資法人	5,651	762,319,900	
スタートプロシード投資法人	1,948	376,353,600	
大和ハウスリート投資法人	17,850	4,657,065,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,301	1,688,611,900	
大和証券リビング投資法人	15,315	1,462,582,500	
ジャパンエクセレント投資法人	11,572	1,458,072,000	
合計	735,775	108,662,288,760	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 5月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	747,273,248
コール・ローン	59,467,897
投資証券	84,092,999,275
派生商品評価勘定	94,200
未収入金	4,303,444
未収配当金	137,970,669
流動資産合計	85,042,108,733
資産合計	85,042,108,733
負債の部	
流動負債	
未払金	501,805,203
未払解約金	25,120,654
未払利息	51
流動負債合計	526,925,908
負債合計	526,925,908
純資産の部	
元本等	
元本	56,493,313,438
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	28,021,869,387
元本等合計	84,515,182,825
純資産合計	84,515,182,825
負債純資産合計	85,042,108,733

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2020年 5月11日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

2020年 5月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,493,313,438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 1.4960円 (1万口当たり純資産額) (14,960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 5月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2020年 5月11日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 5月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月12日
期首元本額	44,803,032,363円
期中追加設定元本額	14,585,145,044円
期中一部解約元本額	2,894,863,969円
期末元本額	56,493,313,438円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	99,823,787円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	142,414,037円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,631,488,775円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,423,756円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,202,146,468円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	28,377,867,507円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,438,322,562円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,925,261,290円
分散投資コア戦略ファンドA	2,000,590,992円
分散投資コア戦略ファンドS	5,584,405,620円
コア投資戦略ファンド（切替型）	691,612,815円
SMT インデックスバランス・オープン	195,649,582円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	398,653,196円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,404,616円
グローバル経済コア	292,928,657円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	7,164,827円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	321,460,040円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,451,509円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,062,433,184円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	847,685,539円

区分	2020年 5月11日現在
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	63,814,564円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 01（適格機関投資家専用）	156,310,115円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	20,768,972,803	
合計	20,768,972,803	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2020年 5月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	27,950,800	-	28,045,000	94,200
	アメリカドル	5,347,000	-	5,347,000	-
	シンガポールドル	22,603,800	-	22,698,000	94,200
	合計	27,950,800	-	28,045,000	94,200

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	63,420	766,747.80	
		AGREE REALTY CORP	38,046	2,466,141.72	
		ALEXANDER'S INC	1,490	376,329.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	94,970	14,435,440.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	35,495	987,470.90	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	106,446	3,299,826.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	83,590	623,581.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	196,578	4,881,031.74	
		AMERICOLD REALTY TRUST	147,810	5,204,390.10	
		APARTMENT INVEST & MGMT	114,915	4,348,383.60	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	162,263	1,484,706.45	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	116,437.50	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	66,030	50,843.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	108,121	17,727,519.16	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	58,320.00	
		BOSTON PROPERTIES	111,550	9,694,810.50	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,000	66,480.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	141,008	1,463,663.04	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	236,823	2,690,309.28	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	42,700	407,785.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	49,200.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	75,169	6,649,449.74	
		CARETRUST REIT INC	72,760	1,274,755.20	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	99,840	22,464.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	44,993.89	
		CHATHAM LODGING TRUST	37,360	261,520.00	
		CITY OFFICE REIT INC	37,050	387,913.50	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	40,515.00	
		COLONY CAPITAL INC	402,574	813,199.48	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	86,283	1,159,643.52	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,600	565,020.00	
		CORECIVIC INC	88,003	1,085,076.99	
		COREPOINT LODGING INC	22,000	96,800.00	
		CORESITE REALTY CORP	29,298	3,600,431.22	
CORPORATE OFFICE PPTYS	88,859	2,277,456.17			
COUSINS PROPERTIES INC	113,943	3,283,837.26			
CUBESMART	149,347	3,995,032.25			
CYRUSONE INC	88,160	6,482,404.80			
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	143,300	783,851.00			
DIGITAL REALTY TRUST INC	203,175	29,472,565.50			
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	180,800	585,792.00			



DOUGLAS EMMETT INC-W/I	127,445	3,762,176.40	
DUKE REALTY CORP	282,337	9,576,871.04	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	54,598	1,434,835.44	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	29,878	3,284,189.76	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	110,335	904,747.00	
EPR PROPERTIES	62,452	1,709,935.76	
EQUINIX INC	65,890	44,683,962.40	
EQUITY COMMONWEALTH	95,089	3,233,026.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	140,001	8,590,461.36	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	269,020	17,276,464.40	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	69,910	931,201.20	
ESSEX PROPERTY TRUST	51,225	12,634,646.25	
EXTRA SPACE STORAGE INC	99,120	9,088,312.80	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	124,640.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	54,190	4,233,322.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	98,637	3,631,814.34	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	49,960	1,096,122.40	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	423,295.28	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	37,530	257,080.50	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	157,568	4,396,147.20	
GEO GROUP INC/THE	89,496	1,029,204.00	
GETTY REALTY CORP	25,485	699,053.55	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	428,611.50	
GLADSTONE LAND CORP	11,500	165,255.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	34,430	361,859.30	
GLOBAL NET LEASE INC	66,202	936,758.30	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	104,018	3,189,191.88	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	157,576	4,002,430.40	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	380,134	9,218,249.50	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	35,650	168,981.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	80,854	2,994,832.16	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	558,021	6,171,712.26	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	120,690	2,831,387.40	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,738	669,251.44	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	48,270	878,031.30	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	12,593	950,897.43	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,899	554,585.68	
INVITATION HOMES INC	413,410	10,306,311.30	
IRON MOUNTAIN INC	223,917	5,501,640.69	
JBG SMITH PROPERTIES	91,912	2,994,492.96	

KILROY REALTY CORPORATION	73,890	4,470,345.00	
KIMCO REALTY CORP	327,219	3,566,687.10	
KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	632,167.20	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	196,662	2,037,418.32	
LIFE STORAGE INC	36,608	3,395,392.00	
LTC PROPERTIES INC	29,406	1,037,443.68	
MACERICH CO/THE	90,380	618,199.20	
MACK-CALI REALTY CORP	70,670	1,115,879.30	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,066,564	751,927.62	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	401,657	7,189,660.30	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	87,604	10,124,394.28	
MONMOUTH REIT -CL A	71,792	939,757.28	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	132,667	4,380,664.34	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	45,810	1,357,808.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	34,115	1,797,860.50	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	63,000	182,700.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	17,500	572,775.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	34,470	896,220.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	167,919	4,631,206.02	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,000	212,550.00	
PARAMOUNT GROUP INC	148,276	1,312,242.60	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	178,464	1,556,206.08	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	96,445	1,094,650.75	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	61,970	68,167.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	156,071	2,486,211.03	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	92,445	1,573,413.90	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,300	115,951.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	28,300	217,910.00	
PRIME US REIT	295,000	209,450.00	
PROLOGIS INC	570,172	51,298,374.84	
PS BUSINESS PARKS INC	14,830	1,820,234.20	
PUBLIC STORAGE	115,650	22,012,821.00	
QTS REALTY TRUST INC	45,588	2,973,249.36	
REALTY INCOME CORP	265,491	14,564,836.26	
REGENCY CENTERS CORP	130,591	5,479,598.36	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	85,450	801,521.00	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	165,590	887,562.40	
RETAIL VALUE	8,969	127,359.80	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	86,073	3,515,221.32	
RLJ LODGING TRUST	126,009	1,145,421.81	
RPT REALTY	70,450	438,903.50	

	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	43,490	1,366,020.90	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	161,856	2,023,200.00	
	SAFEHOLD INC	9,940	511,611.80	
	SAUL CENTERS INC	8,800	276,056.00	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	29,200	238,272.00	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	125,070	815,456.40	
	SIMON PROPERTY GROUP	237,078	13,755,265.56	
	SITE CENTERS CORP	111,320	630,071.20	
	SL GREEN REALTY CORP	63,410	3,076,019.10	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	79,349	2,370,154.63	
	STAG INDUSTRIAL INC	116,030	2,994,734.30	
	STORE CAPITAL CORP	166,698	3,330,626.04	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	90,470	537,391.80	
	SUN COMMUNITIES INC	71,263	9,561,356.71	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	165,442	1,401,293.74	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	75,170	493,866.90	
	TAUBMAN CENTERS INC	48,540	2,146,438.80	
	TERRENO REALTY CORP	52,507	2,721,437.81	
	UDR INC	226,840	8,697,045.60	
	UMH PROPERTIES INC	27,000	346,950.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10,040	1,004,401.60	
	URBAN EDGE PROPERTIES	92,220	917,589.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	309,375.00	
	VENTAS INC	288,534	8,684,873.40	
	VEREIT INC	825,380	4,523,082.40	
	VICI PROPERTIES INC	354,906	6,065,343.54	
	VORNADO REALTY TRUST	123,525	4,868,120.25	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	195,250	141,146.22	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	62,270	1,378,035.10	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	89,090	1,575,111.20	
	WELLTOWER INC	313,244	13,955,020.20	
	WHITESTONE REIT	38,340	237,708.00	
	WP CAREY INC	133,390	8,348,880.10	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	80,230	724,476.90	
	アメリカドル 小計	19,183,608	593,085,336.44 (63,430,476,732)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	46,542	1,958,952.78	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	359,844.30	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	19,560	520,687.20	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	63,090	3,100,242.60	
	CHOICE PROPERTIES REIT	123,670	1,533,508.00	

COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	70,620	561,429.00	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,577	515,733.67	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	40,730	522,565.90	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	55,550	548,278.50	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	396,537.40	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	76,200	992,886.00	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,300	1,255,272.00	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	115,539	1,087,221.99	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	44,460	650,005.20	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	32,900	571,802.00	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	305,020.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	181,362.30	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	27,993	976,395.84	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	69,170	675,790.90	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	120,696	1,801,991.28	
SLATE OFFICE REI	17,000	62,220.00	
SLATE RETAIL REIT	10,300	91,155.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	57,576	1,161,883.68	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	43,000	432,150.00	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	143,190.00	
カナダドル 小計	1,210,913	20,406,125.54 (1,565,966,073)	
ユーロ			
AEDIFICA	20,946	1,901,896.80	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	120,690	1,638,970.20	
ALTAREA	2,730	316,680.00	
BEFIMMO S.C.A.	16,810	655,590.00	
COFINIMMO	19,267	2,377,547.80	
COVIVIO(FP)	34,992	1,882,569.60	
EUROCOMMERCIAL	32,890	344,029.40	
GECINA SA	42,750	4,805,100.00	
HAMBORNER REIT AG	59,000	469,640.00	
HIBERNIA REIT PLC	562,550	623,305.40	
ICADE	21,380	1,430,322.00	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	117,758.15	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	182,422	1,467,584.99	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	18,300	405,345.00	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	328,021	399,529.57	

	KLEPIERRE	163,360	2,807,341.60	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,000	130,200.00	
	MERCIALYS	23,450	158,991.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	288,918	2,230,446.96	
	MONTEA	8,100	644,760.00	
	NSI NV	12,300	423,735.00	
	RETAIL ESTATES	8,800	421,080.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	106,542	5,382,501.84	
	VASTNED RETAIL	13,750	239,250.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	97,380	2,278,692.00	
	WERELDHAVE NV	34,970	264,023.50	
	ユーロ 小計	2,289,108	33,816,890.81 (3,922,759,333)	
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	72,000	46,080.00	
	ASSURA PLC	1,901,950	1,489,226.85	
	BIG YELLOW GROUP PLC	123,746	1,262,209.20	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	615,000	393,600.00	
	BRITISH LAND CO PLC	730,850	2,843,006.50	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	634,297	1,008,532.23	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	29,000	31,610.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	466,910	457,571.80	
	DERWENT LONDON PLC	80,321	2,329,309.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	496,000	335,296.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	198,030	1,325,612.82	
	HAMMERSON PLC	611,600	327,206.00	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	26,098.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	580,122	3,734,825.43	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	624,500	1,203,411.50	
	LXI REIT PLC	415,000	397,155.00	
	NEWRIVER REIT PL	218,000	132,108.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	450,000	290,700.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	970,207	1,523,224.99	
	RDI REIT PLC	154,400	80,133.60	
	REGIONAL REIT LTD	292,000	227,760.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	155,566	1,067,960.59	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	121,100.00	
	SEGREO PLC	840,890	6,915,479.36	
	SHAFTESBURY PLC	162,683	912,651.63	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	273,286	259,621.70	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,361,418	1,694,965.41		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	652,000	389,244.00		
UNITE GROUP PLC	283,402	2,323,896.40		
WORKSPACE GROUP PLC	94,047	703,471.56		

	イギリスポンド 小計	14,359,185	33,853,067.57 (4,497,380,026)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	266,440	660,771.20
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	154,500.00
	ARENA REIT	241,053	520,674.48
	BWP TRUST	340,160	1,193,961.60
	CENTURIA OFFICE REIT	319,000	601,315.00
	CHARTER HALL GROUP	350,960	2,607,632.80
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	304,532	1,236,399.92
	CHARTER HALL RETAIL REIT	288,380	885,326.60
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	164,800	374,096.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,462,633	1,089,661.58
	DEXUS	835,636	7,395,378.60
	GDI PROPERTY GROUP	446,500	464,360.00
	GOODMAN GROUP	1,243,689	17,859,374.04
	GPT GROUP	1,510,047	6,055,288.47
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	243,760	714,216.80
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	148,000	378,880.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	159,588	576,112.68
	MIRVAC GROUP	3,062,130	6,706,064.70
	NATIONAL STORAGE REIT	598,730	951,980.70
	RURAL FUNDS GROUP	272,766	520,983.06
SCENTRE GROUP	4,106,173	9,033,580.60	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	851,060	1,821,268.40	
STOCKLAND	1,883,374	5,160,444.76	
VICINITY CENTERS	2,457,150	3,513,724.50	
VIVA ENERGY REIT	568,970	1,354,148.60	
	オーストラリアドル 小計	22,200,531	71,830,145.09 (5,019,490,538)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	652,278	678,369.12
	GOODMAN PROPERTY TRUST	840,300	1,903,279.50
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,147,030	1,066,737.90
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	800,000	1,200,000.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	295,460	686,944.50
	ニュージーランドドル 小計	3,735,068	5,535,331.02 (363,173,068)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,523,000	6,853,500.00
	FORTUNE REIT	1,034,000	7,506,840.00
	LINK REIT	1,615,600	110,587,820.00
	PROSPERITY REIT	952,000	2,313,360.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	791,000	3,108,630.00
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,208,000	4,505,840.00

	香港ドル 小計	7,123,600	134,875,990.00 (1,861,288,662)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	427,500.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	881,000	453,715.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,311,000	6,771,230.00
	ASCOTT TRUST	1,442,077	1,232,975.83
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	2,252,128	3,580,883.52
	CAPITALAND MALL TRUST	2,212,000	4,092,200.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	637,729	860,934.15
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	712,300	669,562.00
	ESR REIT	1,854,065	639,652.42
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	780,000	382,200.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	441,242.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	562,529	1,170,060.32
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	220,800.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,894,296	2,007,953.76
	KEPPEL DC REIT	952,903	2,239,322.05
	KEPPEL REIT	1,559,900	1,591,098.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	130,698.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,610,473	3,059,898.70
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,137,460	2,889,148.40
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,333,552	4,200,393.60
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,652,100	1,462,108.50
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,903,644	742,421.16
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	288,000	941,760.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	478,540	155,525.50
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	465,800	337,705.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	255,120.92
SPH REIT	572,300	452,117.00	
STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	532,512.00	
SUNTEC REIT	1,754,000	2,367,900.00	
	シンガポールドル 小計	34,373,812	44,308,637.83 (3,352,834,624)
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,500	110,775,000.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	1,593	618,084.00
	韓国ウォン 小計	19,093	111,393,084.00 (9,780,312)
イスラエルシェゲル	REIT 1 LTD	131,500	2,294,675.00

	イスラエルシェケル 小計	131,500	2,294,675.00 (69,849,907)	
	合計	104,626,418	84,092,999,275 (84,092,999,275)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 157銘柄	100.0%	75.4%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	4.7%
イギリスポンド	投資証券 30銘柄	100.0%	5.3%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.0%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	4.0%
韓国ウォン	投資証券 2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。



## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2020年 5月29日現在)

資産総額	42,621,207円
負債総額	10,989円
純資産総額( - )	42,610,218円
発行済口数	41,789,097口
1口当たり純資産額( / )	1.0196円
(1万口当たり純資産額)	(10,196円)

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 5月29日現在)

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 5月29日現在)

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

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 5月29日現在)

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 5月29日現在)

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 5月29日現在)

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

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

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

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

## グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2020年 5月29日現在）

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

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

#### 受益権の譲渡

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

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します。

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2020年 5月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於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

###### 会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・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

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 8月11日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者の財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、当事業年度より百万円単位で記載することに变更いたしました。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

（単位：百万円）

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



## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300	350	350
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700	1,700	1,700
会社分割による増加		18,589	18,589
剰余金の配当			

当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700	16,889	16,889
当期末残高	2,000	17,239	17,239

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

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

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## （リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 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。

#### 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。

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

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:百万円)



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

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

(有価証券関係)

#### 1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

#### 2. 其他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額0百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2019年3月31日)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

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

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

## 3. 確定拠出制度

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## (資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (セグメント情報等)

## [ セグメント情報 ]

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

## [ 関連情報 ]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

## ( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

## 前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 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。

## 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。

## 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。

## 吸収分割

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

## 当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 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。

## 投信販売代行手数料等

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

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

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

（1株当たり情報）

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

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

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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



と。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年8月11日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2020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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三重銀行	15,295	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 2月10日	有価証券届出書
2020年 2月10日	有価証券報告書

**独立監査人の監査報告書**

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBR L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7月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 8資産インデックスバランス・オープンの2019年11月12日から2020年5月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2020年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。