

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年10月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	世界経済インデックスファンド（債券シフト型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

世界経済インデックスファンド（債券シフト型）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース)で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7)【申込期間】

2020年10月21日から2021年4月20日までとします。

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

(8)【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9)【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、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および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

**?** DR(預託証券)とは

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

###### (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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



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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

(1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

(2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 特殊型 ]

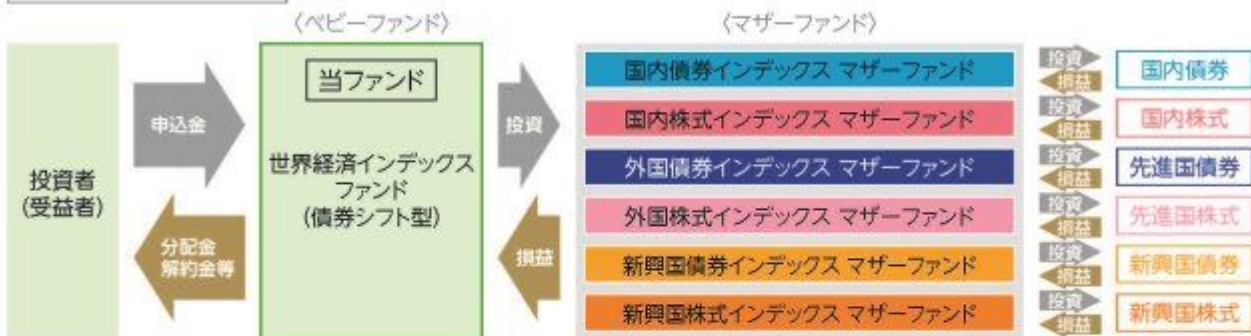
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、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

## &lt; ファンドの特色 &gt;

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

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

ファンドのしくみ



### ? ファミリーファンド方式とは

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

## 2. 世界経済全体の発展を享受します。

- 基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。
- ※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。
- ※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。

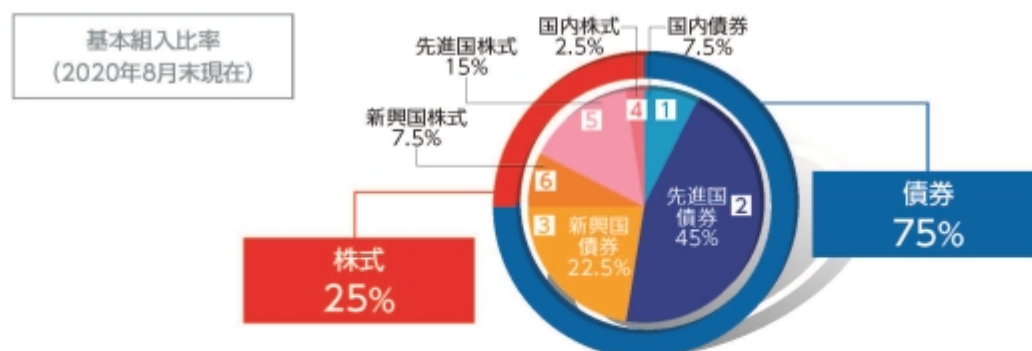


（出所）IMF「世界経済見通し2019年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※上記のファンドの地域別構成比は、2020年8月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合があります。

資産

インデックス

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

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

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

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

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

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

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

5「MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

6「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株

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

### 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組入比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

#### 分配方針

- 年1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

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

#### 〈ご参考情報〉

##### 世界人口・名目GDP総額の推移



(出所) 国連「World Population Prospects 2019」及びIMF「世界経済見通し2019年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

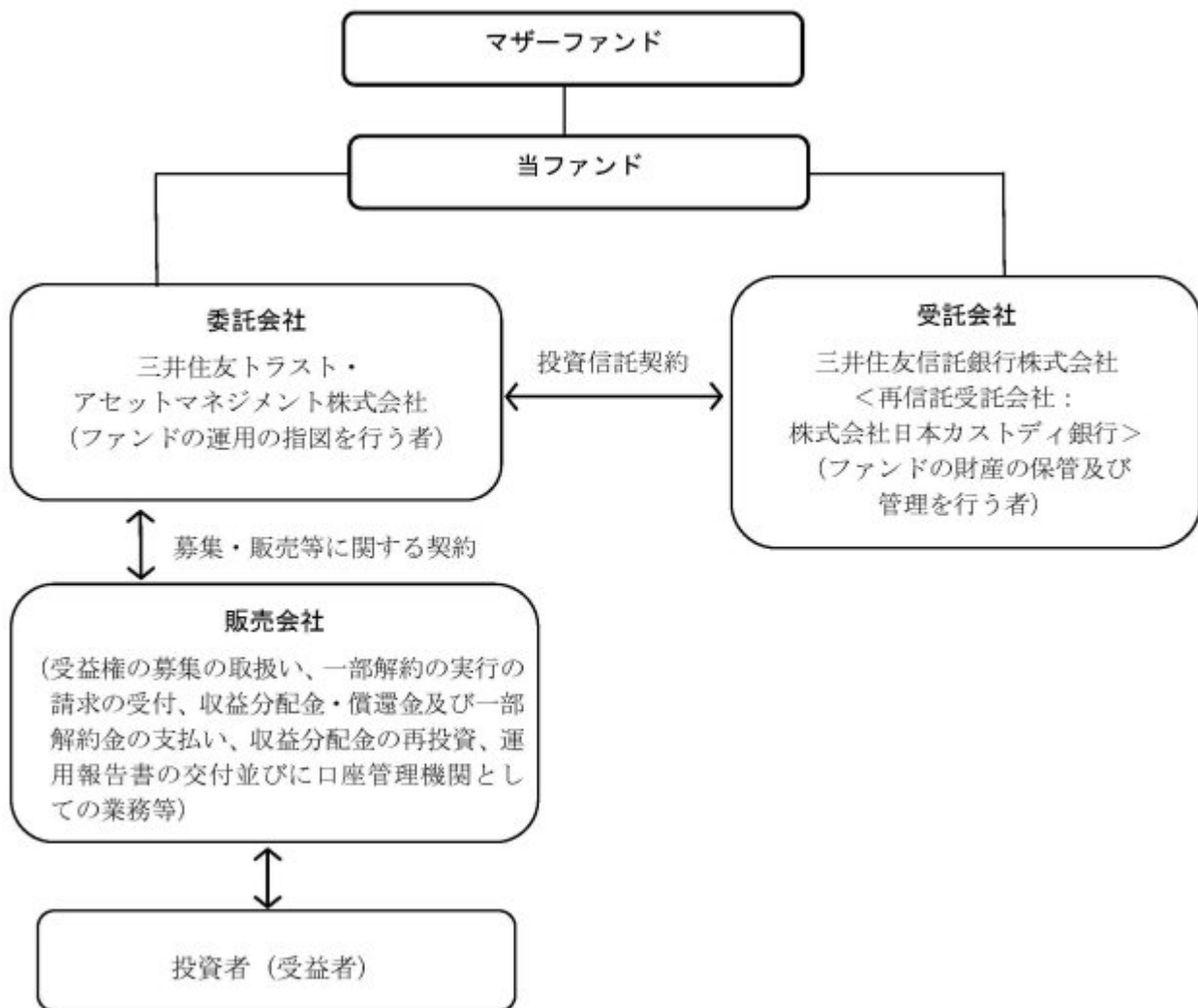
2013年11月8日

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 8月31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、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

#### 投資対象

各マザーファンド受益証券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公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。
- ロ．株式（DR（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式25%、債券75%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。
- ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- ヘ．投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（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および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
- ト．ただし、資金動向及び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21条、第22条及び第23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、信託金を主として次に掲げる1.から6.までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに7.から28.までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 新興国債券インデックス マザーファンド
6. 新興国株式インデックス マザーファンド
7. 株券又は新株引受権証券
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
14. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
15. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
16. コマーシャル・ペーパー
17. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
18. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7.から17.の証券又は証書の性質を有するもの
19. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
20. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
21. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）



22. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
23. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
25. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
26. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
28. 外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によって

は、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。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、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数

等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

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

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

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

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

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及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

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

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。

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

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

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

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

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・ディバースファイド（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・ディバースファイド（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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取

引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

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

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

### 3. 運用制限

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。

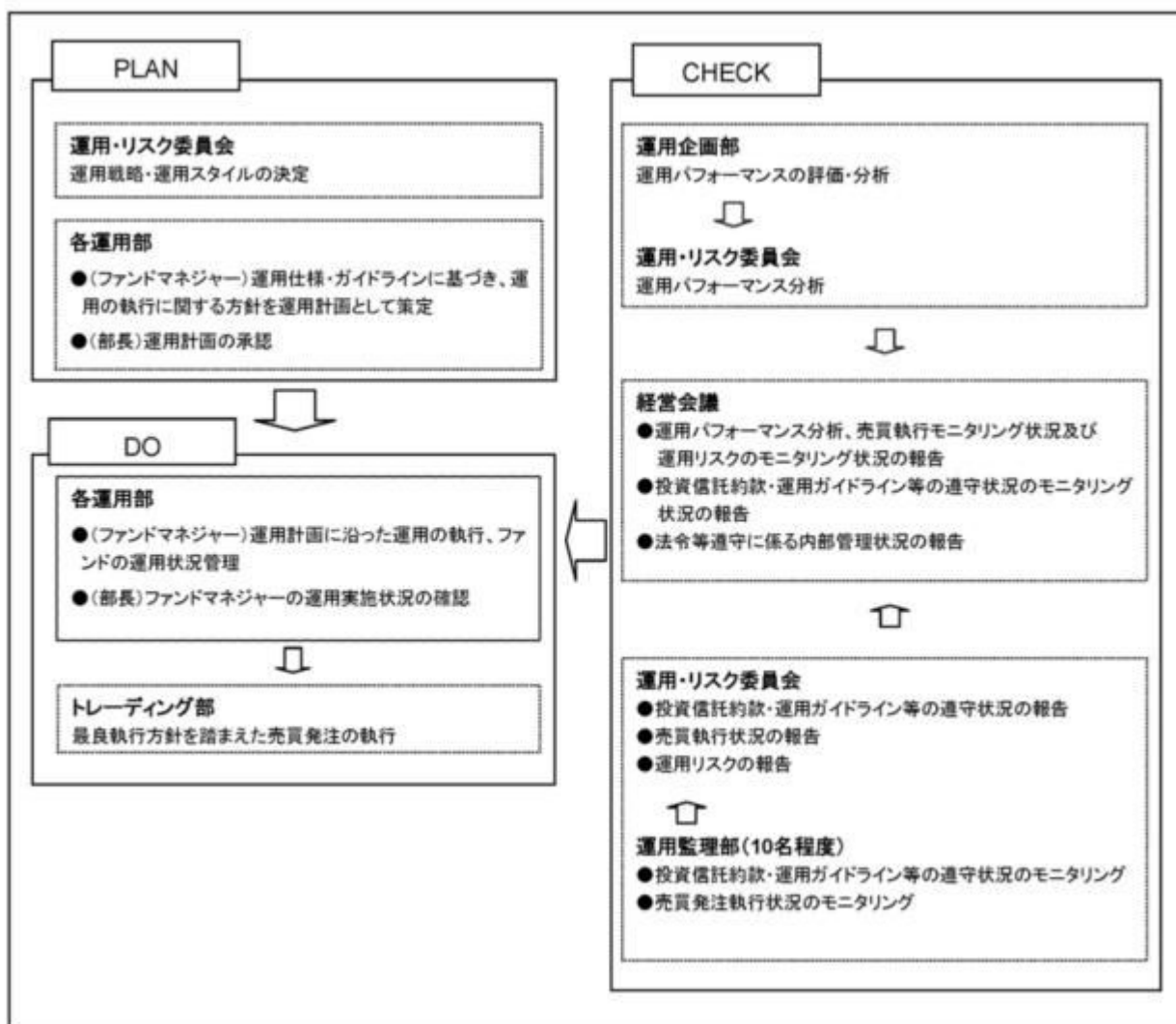
投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

- ・年1回、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（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）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．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ニ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証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（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

- へ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。
- ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。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、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。
- リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

- 又. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ル. 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。この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ヲ. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ワ. 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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- カ. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- コ. デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

< 関連法令に基づく投資制限 >

- イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限  
（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 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。

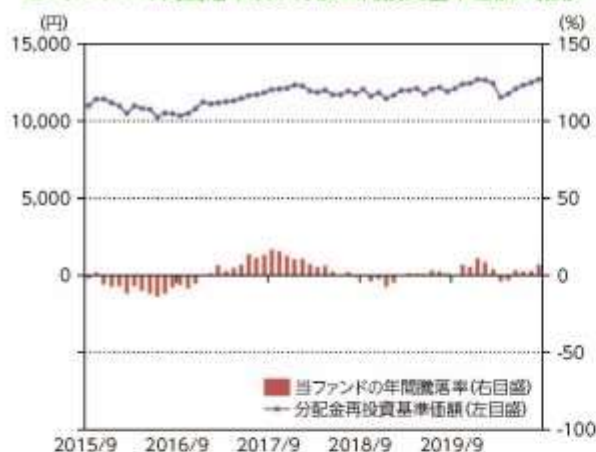
## (2) リスクの管理体制

### 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



\*2015年9月～2020年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

### 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全部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、数値値の公表、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、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMJURA-BPI国債	NOMJURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動きを表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEILガンガバント北アインデックス・エマージング マーケットグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。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新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.495%（税抜 0.45%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.198% (税抜 0.18%)	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 0.242% (税抜 0.22%)	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、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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。

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

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

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

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 8月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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



## 5【運用状況】

以下は、2020年8月31日現在の状況について記載してあります。

## 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	655,436,839	99.06
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		6,250,081	0.94
合計（純資産総額）		661,686,920	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	外国債券インデックス マザーファンド	96,377,129	2.8730	276,896,776	2.9723	286,461,740	43.29
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	87,411,400	1.7917	156,621,098	1.6514	144,351,185	21.82
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	37,085,450	2.8995	107,530,292	2.9318	108,727,122	16.43
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	18,993,653	2.9941	56,868,920	2.9844	56,684,658	8.57
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	30,516,005	1.4147	43,173,741	1.4064	42,917,709	6.49
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	10,649,951	1.5969	17,006,991	1.5300	16,294,425	2.46

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.06
合計	99.06

(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 (2014年 1月20日)	83,358,017	83,358,017	10,486	10,486
第2期計算期間末 (2015年 1月20日)	377,394,493	377,394,493	11,741	11,741
第3期計算期間末 (2016年 1月20日)	537,488,921	537,488,921	10,576	10,576
第4期計算期間末 (2017年 1月20日)	675,724,816	675,724,816	11,185	11,185
第5期計算期間末 (2018年 1月22日)	737,543,812	737,543,812	12,433	12,433
第6期計算期間末 (2019年 1月21日)	681,031,315	681,031,315	11,631	11,631
第7期計算期間末 (2020年 1月20日)	704,051,491	704,051,491	12,839	12,839
2019年 8月末日	699,709,381		11,920	
9月末日	703,912,403		12,117	
10月末日	722,100,091		12,406	
11月末日	713,256,558		12,455	
12月末日	713,119,374		12,707	
2020年 1月末日	696,557,065		12,659	
2月末日	684,601,937		12,443	
3月末日	622,033,045		11,547	
4月末日	636,411,080		11,773	
5月末日	649,839,139		12,111	
6月末日	659,911,475		12,339	
7月末日	666,658,846		12,500	
8月末日	661,686,920		12,714	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2013年11月 8日～2014年 1月20日	0
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0

第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	0
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2013年11月 8日～2014年 1月20日	4.9
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	12.0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	9.9
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	5.8
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	11.2
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	6.5
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	10.4
第8期中間計算期間	2020年 1月21日～2020年 7月20日	2.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2013年11月 8日～2014年 1月20日	82,565,042	3,071,810	79,493,232
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	351,798,094	109,869,385	321,421,941
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	400,244,016	213,448,471	508,217,486
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	182,370,280	86,474,117	604,113,649
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	162,011,209	172,898,759	593,226,099
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	126,811,279	134,500,317	585,537,061
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	89,841,976	126,994,519	548,384,518
第8期中間計算期間	2020年 1月21日～2020年 7月20日	54,643,859	68,266,374	534,762,003

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	461,040,775,200	83.20
地方債証券	日本	30,082,716,188	5.43

特殊債券	日本	39,055,424,336	7.05
社債券	日本	20,331,237,970	3.67
	フランス	1,488,722,000	0.27
	オーストラリア	400,792,000	0.07
	アメリカ	203,888,000	0.04
	小計	22,424,639,970	4.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,528,229,178	0.28
合計(純資産総額)		554,131,784,872	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	100.91	9,505,816,200	100.67	9,483,961,800	0.100	2023/12/20	1.71
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,420,000,000	100.99	7,494,153,800	100.81	7,480,324,600	0.100	2024/9/20	1.35
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	100.99	7,372,854,000	100.78	7,357,086,000	0.100	2024/6/20	1.33
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	101.42	7,039,172,600	101.03	7,011,690,200	0.100	2026/9/20	1.27
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	100.86	6,959,547,000	100.64	6,944,367,000	0.100	2023/9/20	1.25
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	102.83	6,498,856,000	102.40	6,472,185,600	0.400	2025/9/20	1.17
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	6,380,000,000	101.31	6,463,833,200	100.97	6,442,141,200	0.100	2026/3/20	1.16
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	6,050,000,000	101.07	6,115,098,000	100.84	6,100,941,000	0.100	2024/12/20	1.10
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	5,850,000,000	100.67	5,889,195,000	100.49	5,879,016,000	0.100	2022/12/20	1.06
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	101.53	5,878,702,800	101.05	5,851,316,100	0.100	2028/3/20	1.06
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,200,000,000	101.47	5,276,596,000	101.08	5,256,420,000	0.100	2027/3/20	0.95
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,050,000,000	102.72	5,187,360,000	102.28	5,165,544,000	0.400	2025/6/20	0.93
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	4,990,000,000	100.46	5,013,403,100	100.35	5,007,764,400	0.100	2022/3/20	0.90
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	4,870,000,000	101.22	4,929,414,000	100.79	4,908,521,700	0.100	2029/6/20	0.89
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	4,840,000,000	101.50	4,912,987,200	101.09	4,893,094,800	0.100	2027/9/20	0.88
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	4,760,000,000	100.93	4,804,713,200	100.73	4,794,748,000	0.100	2024/3/20	0.87
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	100.54	4,795,996,500	100.40	4,789,318,500	0.100	2022/6/20	0.86
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	4,640,000,000	100.87	4,680,471,200	100.72	4,673,500,800	0.100	2029/9/20	0.84

日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	101.81	4,652,899,800	101.47	4,637,316,100	1.000	2021/12/20	0.84
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,580,000,000	101.24	4,637,245,000	100.85	4,619,113,200	0.100	2029/3/20	0.83
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	4,470,000,000	101.37	4,531,462,500	100.91	4,510,811,100	0.100	2028/12/20	0.81
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	4,380,000,000	100.61	4,406,805,600	100.45	4,399,797,600	0.100	2022/9/20	0.79
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	4,190,000,000	101.46	4,251,257,800	100.96	4,230,517,300	0.100	2028/9/20	0.76
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	4,080,000,000	100.75	4,110,967,200	100.54	4,102,399,200	0.100	2023/3/20	0.74
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	3,950,000,000	101.04	3,991,410,500	100.84	3,983,338,000	0.100	2025/3/20	0.72
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	3,370,000,000	116.84	3,937,608,600	115.92	3,906,706,200	1.400	2034/9/20	0.71
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	3,670,000,000	100.90	3,703,050,600	100.61	3,692,680,600	0.100	2030/3/20	0.67
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	3,630,000,000	101.46	3,683,093,600	101.06	3,668,550,600	0.100	2027/12/20	0.66
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	3,590,000,000	101.49	3,643,814,100	101.01	3,626,474,400	0.100	2028/6/20	0.65
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	3,010,000,000	118.09	3,554,509,000	117.14	3,526,004,300	1.500	2034/6/20	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	83.20
地方債証券	5.43
特殊債券	7.05
社債券	4.05
合計	99.72

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

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

株式	日本	330,118,027,260	98.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,403,810,051	1.02
合計(純資産総額)		333,521,837,311	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	3,393,600,000	1.02

(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	1,624,200	6,768.34	10,993,137,828	7,006.00	11,379,145,200	3.41
日本	株式	ソニー	電気機器	911,900	6,912.82	6,303,800,558	8,309.00	7,576,977,100	2.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,133,400	4,870.92	5,520,700,728	6,598.00	7,478,173,200	2.24
日本	株式	キーエンス	電気機器	131,900	44,360.94	5,851,207,986	43,680.00	5,761,392,000	1.73
日本	株式	任天堂	その他製品	89,300	43,725.57	3,904,693,401	56,740.00	5,066,882,000	1.52
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,211,200	4,179.96	5,062,767,552	3,959.00	4,795,140,800	1.44
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,909,600	2,448.84	4,676,304,864	2,411.50	4,605,000,400	1.38
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,821,400	444.83	4,368,853,362	442.50	4,345,969,500	1.30
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	996,600	3,718.74	3,706,096,284	4,026.00	4,012,311,600	1.20
日本	株式	第一三共	医薬品	416,600	10,023.16	4,175,648,456	9,447.00	3,935,620,200	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	185,500	15,919.63	2,953,091,365	19,965.00	3,703,507,500	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,041,500	3,140.80	3,271,143,200	3,078.00	3,205,737,000	0.96
日本	株式	信越化学工業	化学	244,800	12,616.16	3,088,435,968	12,885.00	3,154,248,000	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,146,100	2,791.34	3,199,154,774	2,729.00	3,127,706,900	0.94
日本	株式	日本電産	電気機器	350,400	6,653.52	2,331,393,408	8,911.00	3,122,414,400	0.94
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	993,000	3,126.41	3,104,525,130	3,118.00	3,096,174,000	0.93
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,021,500	2,949.26	3,012,669,090	2,959.00	3,022,618,500	0.91

日本	株式	HOYA	精密機器	288,800	10,111.70	2,920,258,960	10,415.00	3,007,852,000	0.90
日本	株式	花王	化学	348,500	8,652.10	3,015,256,850	8,069.00	2,812,046,500	0.84
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,509,400	134.77	2,629,281,838	143.80	2,805,451,720	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,002,800	2,313.35	2,319,827,380	2,723.50	2,731,125,800	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	427,700	6,040.32	2,583,444,864	6,280.00	2,685,956,000	0.81
日本	株式	S M C	機械	45,700	54,486.27	2,490,022,539	58,250.00	2,662,025,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	136,900	19,264.98	2,637,375,762	18,605.00	2,547,024,500	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	92,400	21,699.79	2,005,060,596	27,150.00	2,508,660,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	507,600	4,681.99	2,376,578,124	4,890.00	2,482,164,000	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	699,500	3,463.70	2,422,858,150	3,530.00	2,469,235,000	0.74
日本	株式	三井物産	卸売業	1,241,400	1,639.91	2,035,784,274	1,914.00	2,376,039,600	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	940,100	2,510.80	2,360,403,080	2,512.50	2,362,001,250	0.71
日本	株式	中外製薬	医薬品	455,300	5,299.80	2,412,998,940	4,721.00	2,149,471,300	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	0.17
		建設業	2.51
		食料品	3.74
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.09
		医薬品	6.50
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.58
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.55
		機械	5.39
		電気機器	14.89
		輸送用機器	7.23
		精密機器	2.59
		その他製品	2.67
		電気・ガス業	1.42
陸運業	3.80		
海運業	0.14		
空運業	0.36		
倉庫・運輸関連業	0.19		

	情報・通信業	10.07
	卸売業	4.72
	小売業	4.93
	銀行業	4.92
	証券、商品先物取引業	0.82
	保険業	1.98
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.97
	サービス業	5.45
	小計	98.98
合計		98.98

(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	210円		3,314,625,250	3,393,600,000	1.02

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

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

#### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	124,216,126,765	43.00
	フランス	29,678,127,153	10.27
	イタリア	26,960,152,537	9.33
	ドイツ	21,548,664,820	7.46
	イギリス	18,548,061,829	6.42
	スペイン	17,246,922,073	5.97
	ベルギー	7,377,718,421	2.55
	オーストラリア	6,717,941,226	2.33
	オランダ	5,487,266,012	1.90
	カナダ	5,412,383,737	1.87



	オーストリア	4,493,467,776	1.56
	アイルランド	2,359,971,906	0.82
	メキシコ	2,132,192,878	0.74
	フィンランド	1,756,022,134	0.61
	ポーランド	1,707,537,959	0.59
	デンマーク	1,511,490,335	0.52
	マレーシア	1,427,488,853	0.49
	シンガポール	1,243,089,914	0.43
	イスラエル	1,114,500,894	0.39
	スウェーデン	854,533,395	0.30
	ノルウェー	634,808,187	0.22
	小計	282,428,468,804	97.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,472,765,827	2.24
合計(純資産総額)		288,901,234,631	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,671,244,203	0.58
	買建	ドイツ	2,258,875,305	0.78

(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		3,830,329,300	1.33

(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	12,127.10	1,820,277,812	12,083.47	1,813,729,598	2.375	2029/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	11,456.25	1,678,341,173	11,423.32	1,673,517,661	1.625	2029/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	11,454.60	1,431,825,938	11,432.38	1,429,047,897	2.375	2024/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	12,150,000	10,905.99	1,325,078,357	10,880.47	1,321,978,050	1.625	2022/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 09/15/21	12,000,000	10,886.23	1,306,348,766	10,823.06	1,298,767,777	2.750	2021/9/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,875.22	1,276,586,625	11,858.76	1,274,816,907	2.375	2027/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	10,200,000	12,539.48	1,279,027,597	12,381.44	1,262,907,517	2.250	2049/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,320.53	1,230,821,446	12,269.50	1,225,723,174	2.625	2029/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	10,863.80	1,195,019,047	10,799.81	1,187,979,269	2.750	2021/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,547.20	1,180,124,763	11,551.73	1,180,587,444	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,440.20	1,161,180,582	11,425.79	1,159,718,514	2.250	2024/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,397.24	1,137,426,310	13,299.06	1,129,090,804	3.000	2022/4/25	0.39
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000	22,622.74	1,092,678,481	23,027.32	1,112,219,599	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.125% 09/30/21	10,300,000	10,809.68	1,113,397,970	10,762.77	1,108,565,409	2.125	2021/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,460.46	1,111,473,590	12,411.90	1,107,141,651	2.875	2028/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/48	7,300,000	15,339.75	1,119,802,298	15,153.73	1,106,222,381	3.375	2048/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,996.12	1,099,612,693	10,959.90	1,095,990,943	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	8,500,000	12,939.52	1,099,859,625	12,831.69	1,090,694,132	2.500	2046/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,842.61	1,084,261,404	10,816.68	1,081,668,568	1.500	2022/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,556.86	1,071,521,420	10,563.98	1,072,244,604	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,695.89	1,069,589,202	10,673.05	1,067,305,029	1.250	2021/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,718.92	1,068,389,910	12,661.30	1,063,549,935	3.125	2028/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,751.75	1,051,782,132	11,743.11	1,051,008,594	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,866.89	1,037,788,592	10,832.32	1,034,487,038	1.750	2022/5/31	0.36
フランス	国債証券	FRTR 0.75% 11/25/28	7,590,000	13,513.33	1,025,661,947	13,613.74	1,033,283,316	0.750	2028/11/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,839.52	1,035,174,858	10,803.51	1,031,735,747	1.750	2022/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,818.42	1,010,475,658	11,801.96	1,009,068,114	2.250	2027/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	7,000,000	14,403.86	1,008,270,510	14,236.77	996,573,900	3.000	2049/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/31/26	8,600,000	11,580.95	995,962,320	11,584.66	996,280,868	2.125	2026/5/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,299.86	992,127,708	11,313.03	993,284,034	1.625	2026/11/30	0.34

(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	97.76
合計	97.76

(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	47	アメリカ ドル	5,916,375.5	623,349,323	5,921,632.93	623,903,246	0.22
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	30	アメリカ ドル	4,175,323.13	439,912,045	4,172,812.5	439,647,525	0.15
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	33	アメリカ ドル	5,819,444.5	613,136,672	5,767,781.25	607,693,432	0.21
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,801,490	351,502,950	2,800,750	351,410,102	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	32	ユーロ	4,314,018	541,279,839	4,310,400	540,825,888	0.19
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	62	ユーロ	10,931,218	1,371,539,922	10,892,160	1,366,639,315	0.47

(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	16,220,000.00	1,724,452,455	1,708,452,600	0.59
	カナダドル	買建	2,260,000.00	181,585,042	181,771,800	0.06
	ユーロ	買建	13,210,000.00	1,658,869,213	1,657,458,700	0.57
	イギリスポンド	買建	2,010,000.00	280,370,818	282,646,200	0.10

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

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

## 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	288,843,010,147	66.63
	イギリス	18,101,703,698	4.18
	スイス	15,260,047,974	3.52
	カナダ	14,668,175,197	3.38
	フランス	14,155,838,928	3.27
	ドイツ	13,196,404,390	3.04
	オーストラリア	8,599,339,639	1.98
	オランダ	7,904,777,751	1.82

	アイルランド	7,681,560,766	1.77
	スウェーデン	4,323,094,632	1.00
	香港	3,413,490,714	0.79
	デンマーク	3,403,994,580	0.79
	スペイン	3,278,048,476	0.76
	イタリア	2,635,999,735	0.61
	フィンランド	1,746,953,014	0.40
	バミューダ	1,356,955,240	0.31
	ベルギー	1,301,723,349	0.30
	シンガポール	1,207,595,280	0.28
	ジャージー	937,236,068	0.22
	イスラエル	875,157,392	0.20
	ケイマン	829,754,182	0.19
	ノルウェー	777,447,281	0.18
	ニュージーランド	479,724,255	0.11
	ルクセンブルク	297,680,224	0.07
	キュラソー	270,616,022	0.06
	オーストリア	242,021,746	0.06
	ポルトガル	225,672,444	0.05
	リベリア	138,049,238	0.03
	パナマ	73,148,141	0.02
	マン島	66,997,268	0.02
	パプアニューギニア	54,103,275	0.01
	小計	416,346,321,046	96.05
投資信託受益証券	オーストラリア	185,273,530	0.04
	香港	80,846,424	0.02
	小計	266,119,954	0.06
投資証券	アメリカ	8,228,399,895	1.90
	オーストラリア	581,237,775	0.13
	イギリス	231,811,821	0.05
	フランス	225,524,171	0.05
	シンガポール	216,758,520	0.05
	香港	166,308,280	0.04
	カナダ	76,380,077	0.02
	小計	9,726,420,539	2.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,148,547,659	1.65
合計(純資産総額)		433,487,409,198	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	4,596,833,620	1.06
	買建	カナダ	289,851,696	0.07
	買建	ドイツ	991,681,384	0.23
	買建	イギリス	402,415,557	0.09
	買建	オーストラリア	199,074,250	0.05

(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		174,596,000	0.04
	売建		520,920,500	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。

## 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	409,896	33,530.81	13,744,148,994	52,598.87	21,560,067,565	4.97
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	676,327	19,113.35	12,926,879,806	24,117.95	16,311,625,910	3.76
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	39,784	253,051.54	10,067,402,499	358,413.64	14,259,128,572	3.29
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	225,016	23,753.41	5,344,897,754	30,940.01	6,961,999,000	1.61
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	28,718	149,272.99	4,286,821,853	173,255.03	4,975,538,170	1.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,027	149,447.89	4,188,576,069	172,730.34	4,841,113,374	1.12
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	246,279	15,486.86	3,814,089,970	16,187.51	3,986,643,874	0.92
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	159,051	20,467.23	3,255,333,971	22,727.20	3,614,784,778	0.83
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	278,934	11,992.31	3,345,062,998	12,693.07	3,540,530,461	0.82

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	230,557	12,228.08	2,819,269,810	14,620.80	3,370,929,446	0.78
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	83,731	31,848.22	2,666,683,375	38,574.40	3,229,873,354	0.75
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	13,758	85,210.95	1,172,332,300	233,203.82	3,208,418,211	0.74
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	57,334	35,871.91	2,056,680,615	55,409.87	3,176,869,922	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	287,074	10,521.24	3,020,377,208	10,827.84	3,108,393,407	0.72
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	102,166	25,831.11	2,639,061,307	30,163.51	3,081,685,612	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	129,847	19,504.24	2,532,567,467	23,026.42	2,989,912,597	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	88,310	32,027.33	2,828,333,760	33,122.02	2,925,005,869	0.67
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	45,456	40,026.26	1,819,433,856	54,412.11	2,473,357,254	0.57
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	170,184	12,300.78	2,093,395,944	14,280.49	2,430,311,659	0.56
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	66,209	39,776.92	2,633,590,361	36,554.10	2,420,210,407	0.56
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	387,339	5,872.76	2,274,751,465	6,243.63	2,418,402,795	0.56
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	41,368	43,570.57	1,802,427,522	55,197.05	2,283,391,581	0.53
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	79,356	19,061.73	1,512,662,741	28,563.09	2,266,653,046	0.52
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	105,027	15,685.99	1,647,453,186	21,544.01	2,262,703,032	0.52
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	403,460	6,500.71	2,622,777,264	5,313.30	2,143,705,955	0.49
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	676,285	3,272.48	2,213,130,218	3,165.01	2,140,451,763	0.49
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	236,561	8,328.70	1,970,247,493	9,024.08	2,134,746,335	0.49
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	521,538	4,022.64	2,097,962,124	3,994.19	2,083,125,828	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	740,193	2,619.24	1,938,750,219	2,770.96	2,051,051,117	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	384,034	4,960.34	1,904,942,591	5,250.08	2,016,212,602	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	2.97

素材	4.25
資本財	6.01
商業・専門サービス	1.17
運輸	1.97
自動車・自動車部品	1.51
耐久消費財・アパレル	1.72
消費者サービス	1.51
メディア・娯楽	6.78
小売	6.33
食品・生活必需品小売り	1.50
食品・飲料・タバコ	4.32
家庭用品・パーソナル用品	2.12
ヘルスケア機器・サービス	5.14
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.14
銀行	5.12
各種金融	4.15
保険	3.04
不動産	0.47
ソフトウェア・サービス	12.38
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.40
電気通信サービス	1.99
公益事業	3.18
半導体・半導体製造装置	3.87
小計	96.05
投資信託受益証券	0.06
投資証券	2.24
合計	98.35

(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	249	アメリカドル	41,312,423	4,352,676,886	43,629,780	4,596,833,620	1.06
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	18	カナダドル	3,534,613	284,359,616	3,602,880	289,851,696	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	23	スイスフラン	2,344,531	273,372,315	2,337,490	272,551,334	0.06

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	173	ユーロ	5,730,988.5	719,067,127	5,731,490	719,130,050	0.17
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	17	オーストラリアドル	2,581,394	200,058,035	2,568,700	199,074,250	0.05
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	48	イギリスポンド	2,928,200	411,792,765	2,861,520	402,415,557	0.09

(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	1,300,000.00	138,645,000	136,955,000	0.03
	ユーロ	買建	300,000.00	37,815,000	37,641,000	0.01
	アメリカドル	売建	3,300,000.00	347,655,000	347,655,000	0.08
	ユーロ	売建	450,000.00	56,457,900	56,461,500	0.01
	イギリスポンド	売建	500,000.00	70,315,500	70,310,000	0.02
	オーストラリアドル	売建	600,000.00	46,503,600	46,494,000	0.01

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

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

## 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	5,809,809,443	9.69
	インドネシア	5,631,539,104	9.39
	タイ	5,259,896,139	8.77
	ブラジル	5,188,059,954	8.65
	ポーランド	4,988,836,595	8.32
	ロシア	4,837,034,567	8.06
	マレーシア	4,219,376,512	7.03
	南アフリカ	4,205,253,480	7.01
	コロンビア	3,428,165,774	5.72
	中国	2,988,511,464	4.98
	チェコ	2,982,132,981	4.97
	ハンガリー	2,136,012,202	3.56
	ペルー	1,941,470,768	3.24



	チリ	1,613,478,458	2.69
	トルコ	1,435,614,728	2.39
	フィリピン	117,863,712	0.20
	ウルグアイ	83,540,199	0.14
	ドミニカ共和国	82,820,437	0.14
	小計	56,949,416,517	94.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,030,163,337	5.05
合計(純資産総額)		59,979,579,854	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	91,200,000,000	3.53	3,222,234,494	3.61	3,297,477,451	9.850	2027/6/28	5.50
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	53,750,000	1,601.12	860,607,321	1,716.72	922,737,266	0.000	2023/7/1	1.54
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	115,000,000	706.71	812,717,732	733.37	843,377,340	10.500	2026/12/21	1.41
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000	2,193.11	827,902,422	2,203.06	831,655,421	10.000	2023/1/1	1.39
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000	2,261.48	797,172,463	2,265.79	798,692,636	10.000	2025/1/1	1.33
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000	1,564.54	672,756,342	1,536.25	660,588,979	2.940	2024/10/17	1.10
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,935.79	584,222,210	3,020.01	600,983,383	2.500	2023/1/25	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	111,400,000	506.40	564,139,849	531.40	591,980,202	8.000	2023/12/7	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	507.20	551,079,287	537.34	583,829,580	7.500	2027/6/3	0.97
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000	0.76	557,138,261	0.79	576,322,322	8.375	2024/3/15	0.96
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	34,850,000	1,625.31	566,421,970	1,649.73	574,934,065	0.000	2024/1/1	0.96
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	98,800,000	546.53	539,974,406	572.85	565,985,660	8.500	2029/5/31	0.94
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	133,500,000	412.90	551,224,170	415.24	554,351,394	3.400	2036/6/17	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	136,400,000	417.14	568,983,043	404.23	551,370,239	3.300	2038/6/17	0.92
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000	2,329.51	557,918,790	2,292.48	549,049,539	10.000	2027/1/1	0.92
中国	国債証券	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000	1,579.03	552,662,477	1,552.03	543,212,544	3.250	2026/6/6	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	487.19	527,149,892	500.63	541,687,157	6.500	2022/6/9	0.90
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	1,756.15	501,382,138	1,881.84	537,267,717	0.000	2022/1/1	0.90
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	89,900,000	589.75	530,193,826	584.77	525,714,128	8.000	2030/1/31	0.88
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000	2,941.49	483,876,021	3,106.66	511,045,685	2.500	2026/7/25	0.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000	1,706.77	470,217,465	1,834.43	505,385,873	0.000	2022/7/1	0.84

ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	3,072.69	462,440,643	3,200.11	481,616,735	2.750	2029/10/25	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	552.20	454,188,843	576.84	474,451,624	10.000	2024/12/5	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	407.10	465,321,129	408.24	466,624,989	3.650	2031/6/20	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,950,000	2,940.08	439,541,960	3,112.35	465,296,639	2.500	2027/7/25	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000	2,945.70	440,383,007	3,070.66	459,064,806	2.500	2024/4/25	0.77
マレーシア	国債証券	MGS 4.059% 09/30/24	16,500,000	2,691.25	444,056,357	2,730.13	450,472,949	4.059	2024/9/30	0.75
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	14,050,000	3,098.94	435,402,381	3,189.80	448,167,026	4.000	2023/10/25	0.75
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000	434.39	440,476,124	437.94	444,078,582	4.875	2029/6/22	0.74
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	556.13	496,625,090	494.28	441,400,666	8.750	2048/2/28	0.74

(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	94.95
合計	94.95

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 新興国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン	19,404,057,611	25.19
	中国	8,888,284,761	11.54
	台湾	8,805,385,815	11.43
	韓国	8,361,181,976	10.85
	インド	6,071,979,471	7.88
	ブラジル	3,446,478,472	4.47
	南アフリカ	2,547,199,551	3.31

	ロシア	1,988,497,830	2.58
	サウジアラビア	1,815,497,274	2.36
	香港	1,759,313,109	2.28
	タイ	1,399,796,396	1.82
	マレーシア	1,274,598,626	1.65
	メキシコ	1,133,817,675	1.47
	インドネシア	1,029,029,177	1.34
	カタール	579,331,283	0.75
	フィリピン	542,556,896	0.70
	バミューダ	534,108,367	0.69
	ポーランド	506,250,050	0.66
	チリ	391,646,840	0.51
	アラブ首長国連邦	353,579,784	0.46
	アメリカ	284,362,222	0.37
	トルコ	252,777,768	0.33
	ハンガリー	153,567,653	0.20
	コロンビア	124,433,740	0.16
	ギリシャ	98,376,537	0.13
	ルクセンブルク	93,854,294	0.12
	エジプト	78,193,095	0.10
	チェコ	77,328,659	0.10
	ジャージー	76,147,769	0.10
	シンガポール	25,746,500	0.03
	ペルー	24,669,191	0.03
	アルゼンチン	20,184,848	0.03
	マン島	16,704,757	0.02
	パキスタン	16,684,008	0.02
	小計	72,175,622,005	93.69
新株予約権証券	タイ	558,943	0.00
投資信託受益証券	ブラジル	146,066,996	0.19
	メキシコ	26,818,401	0.03
	小計	172,885,397	0.22
投資証券	メキシコ	25,942,361	0.03
	南アフリカ	24,244,366	0.03
	小計	50,186,727	0.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,638,114,219	6.02
合計(純資産総額)		77,037,367,291	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	4,647,202,022	6.03

(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		30,551,500	0.04
	売建		94,815,000	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。

## 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	196,529	20,188.07	3,967,541,302	30,449.03	5,984,119,382	7.77
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	603,900	4,549.20	2,747,261,880	7,350.80	4,439,148,120	5.76
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,582,389	1,093.94	2,824,980,172	1,557.30	4,021,554,390	5.22
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	501,244	4,670.29	2,340,956,624	4,947.22	2,479,764,342	3.22
ケイマン	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	369,800	1,755.88	649,327,373	3,606.72	1,333,765,056	1.73
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	306,633	2,057.18	630,799,519	3,068.41	940,878,063	1.22
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	46,871	13,981.25	655,315,244	19,968.61	935,949,151	1.21
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,118,620	87.85	888,981,479	76.84	777,514,761	1.01
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	89,155	3,897.58	347,489,629	8,424.58	751,093,929	0.97
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	605,500	1,269.11	768,448,272	1,132.88	685,958,840	0.89
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	654,500	873.53	571,731,357	758.88	496,686,960	0.64
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	365,523	1,026.33	375,147,367	1,356.11	495,690,309	0.64
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	177,443	3,191.85	566,371,836	2,730.71	484,545,818	0.63
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	8,567	33,188.32	284,324,375	53,119.35	455,073,482	0.59

ブラジル	株式	VALE SA	素材	372,878	960.16	358,023,679	1,194.50	445,404,635	0.58
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	29,357	13,074.32	383,823,065	13,591.43	399,003,904	0.52
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	57,001	7,422.99	423,118,016	6,947.54	396,016,728	0.51
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,464,515	79.01	510,800,117	61.20	395,628,318	0.51
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	13,049	14,753.61	192,519,953	29,736.89	388,036,808	0.50
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	85,728	3,842.19	329,383,923	4,304.25	368,995,601	0.48
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	289,100	1,555.13	449,588,089	1,272.22	367,799,380	0.48
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	1,287,248	320.55	412,631,466	277.45	357,146,958	0.46
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,109,600	135.99	150,896,692	306.00	339,537,600	0.44
ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	40,978	4,798.35	196,627,028	8,105.34	332,140,819	0.43
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	160,804	1,441.57	231,810,362	2,054.92	330,439,356	0.43
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	4,819	28,651.63	138,072,249	67,778.69	326,625,555	0.42
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	617,282	835.92	516,000,622	512.68	316,469,222	0.41
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	96,664	3,056.32	295,437,012	3,245.89	313,761,436	0.41
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	43,246	9,862.74	426,524,470	7,206.62	311,657,662	0.40
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	515,616	707.46	364,782,251	594.06	306,309,419	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	5.31
		素材	6.58
		資本財	2.56
		商業・専門サービス	0.33
		運輸	1.28
		自動車・自動車部品	2.14
		耐久消費財・アパレル	1.13
		消費者サービス	1.59
		メディア・娯楽	8.95
		小売	13.42
		食品・生活必需品小売り	1.27
		食品・飲料・タバコ	3.47
		家庭用品・パーソナル用品	1.08

	ヘルスケア機器・サービス	1.25
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.85
	銀行	11.78
	各種金融	1.92
	保険	2.89
	不動産	2.18
	ソフトウェア・サービス	1.93
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.33
	電気通信サービス	3.28
	公益事業	1.92
	半導体・半導体製造装置	7.24
	小計	93.69
新株予約権証券		0.00
投資信託受益証券		0.22
投資証券		0.07
合計		93.98

(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	784	アメリカドル	39,608,768	4,173,179,796	44,107,840	4,647,202,022	6.03

(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	290,000.00	30,928,500	30,551,500	0.04
	アメリカドル	売建	900,000.00	94,815,000	94,815,000	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。

#### 参考情報

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

 当初設定日：2013年11月8日  
 作成基準日：2020年8月31日

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 12,714円

純資産総額 6.62億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2016年1月	0円
2017年1月	0円
2018年1月	0円
2019年1月	0円
2020年1月	0円
設定後 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	実効投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	43.3%	T 2.375% 05/15/29 T 1.625% 08/15/29	アメリカ	国債	-	2.375% 1.625%	2029/05/15 2029/08/15	0.3% 0.3%
新興国債券 インデックス マザーファンド	21.8%	COLOM 9.85% 06/28/27 BLTN 0% 07/01/23	コロンビア ブラジル	国債	-	9.850% 0.000%	2027/06/28 2023/07/01	1.2% 0.3%
外国株式 インデックス マザーファンド	16.4%	APPLE INC MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェアおよび ソフトウェア・サービス	-	-	0.8% 0.6%
新興国株式 インデックス マザーファンド	8.6%	ALBABA GROUP HOLDING SP ADR TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	小売 メディア・娯楽	-	-	0.7% 0.5%
国内債券 インデックス マザーファンド	6.5%	第138回利付国債(5年) 第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1% 0.1%	2023/12/20 2024/09/20	0.1% 0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	2.5%	トヨタ自動車 ソニー	日本	株式	輸送用機器 電気機器	-	-	0.1% 0.1%

※投資比率及び実効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（5年ベース）



※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン



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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。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ませんとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

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、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およ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 >

##### イ．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。

##### ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

###### （イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

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

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

###### （ハ）公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

##### （照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2013年11月 8日設定）

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

#### （４）【計算期間】

原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年11月8日から2014年1月20日までとします。

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

#### （５）【その他】

##### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

###### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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、本手続きに従います。

## (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場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知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。受託会社は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てします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2019年1月22日から2020年1月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】



## 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2019年 1月21日現在）	第7期 （2020年 1月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,257,725	7,550,736
親投資信託受益証券	676,375,431	697,589,103
未収入金	80,000	9,270,000
流動資産合計	683,713,156	714,409,839
<b>資産合計</b>	683,713,156	714,409,839
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	968,205	8,595,964
未払受託者報酬	188,306	193,684
未払委託者報酬	1,506,432	1,549,390
未払利息	20	3
その他未払費用	18,878	19,307
流動負債合計	2,681,841	10,358,348
<b>負債合計</b>	2,681,841	10,358,348
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	585,537,061	548,384,518
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	95,494,254	155,666,973
（分配準備積立金）	66,378,818	71,838,723
元本等合計	681,031,315	704,051,491
<b>純資産合計</b>	681,031,315	704,051,491
<b>負債純資産合計</b>	683,713,156	714,409,839

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	2018年 1月23日 至 2019年 1月21日	自	2019年 1月22日 至 2020年 1月20日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		44,016,686		73,143,672
営業収益合計		44,016,686		73,143,674
営業費用				
支払利息		6,554		4,183
受託者報酬		377,471		378,708
委託者報酬		3,019,692		3,029,513
その他費用		38,086		37,776
営業費用合計		3,441,803		3,450,180
営業利益又は営業損失（ ）		47,458,489		69,693,494
経常利益又は経常損失（ ）		47,458,489		69,693,494
当期純利益又は当期純損失（ ）		47,458,489		69,693,494
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（ ）		6,019,569		7,357,118
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		144,317,713		95,494,254
剰余金増加額又は欠損金減少額		24,704,975		18,892,632
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		24,704,975		18,892,632
剰余金減少額又は欠損金増加額		32,089,514		21,056,289
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		32,089,514		21,056,289
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		95,494,254		155,666,973

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期計算期間は2019年 1月22日から2020年 1月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第6期 (2019年 1月21日現在)	第7期 (2020年 1月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	585,537,061口	548,384,518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) 1.1631円 (11,631円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2839円 (12,839円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月21日			第7期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日		
分配金の計算過程			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	17,338,163円	費用控除後の配当等収益額	A	18,565,431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	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	53,963,064円	収益調整金額	C	83,828,250円
分配準備積立金額	D	49,040,655円	分配準備積立金額	D	53,273,292円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	120,341,882円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	155,666,973円
当ファンドの期末残存口数	F	585,537,061口	当ファンドの期末残存口数	F	548,384,518口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,055円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,838円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第7期 (2020年 1月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第6期	第7期
	自 2018年 1月23日 至 2019年 1月21日	自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	593,226,099円	585,537,061円
期中追加設定元本額	126,811,279円	89,841,976円
期中一部解約元本額	134,500,317円	126,994,519円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第6期 (2019年 1月21日現在)	第7期 (2020年 1月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	38,846,792	67,771,776
合計	38,846,792	67,771,776

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	17,787,534	55,781,706	
	国内株式インデックス マザーファンド	10,575,098	17,191,936	
	外国株式インデックス マザーファンド	40,736,684	120,812,783	
	国内債券インデックス マザーファンド	31,734,181	44,938,773	
	外国債券インデックス マザーファンド	104,746,791	300,361,423	
	新興国債券インデックス マザーファンド	87,261,882	158,502,482	
合計		292,842,170	697,589,103	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

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

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
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>
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 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	389,894,814,663口
2. 担保資産	<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 101,311,000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 1.4161円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,161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 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。



	2020年 1月20日現在

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	307,793,237,795円
期中追加設定元本額	97,749,611,981円
期中一部解約元本額	15,648,035,113円
期末元本額	389,894,814,663円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,839,285,767円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,650,875円
S M T 国内債券インデックス・オープン	17,332,710,246円
世界経済インデックスファンド	1,869,306,614円
D Cマイセレクション25	21,252,199,623円
D Cマイセレクション50	23,168,740,519円
D Cマイセレクション75	6,371,777,295円
D C日本債券インデックス・オープン	459,542,355円
D C日本債券インデックス・オープンS	88,509,223,009円
D C日本債券インデックス・オープンP	68,916,948,989円
D CマイセレクションS25	8,655,291,479円
D CマイセレクションS50	9,475,068,222円
D CマイセレクションS75	1,838,727,821円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	1,112,558,453円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	1,346,065,005円

区分	2020年 1月20日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	453,822,866円
DC世界経済インデックスファンド	2,486,762,850円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	68,546,638円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	5,496,023円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	44,435,718円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	14,180,873円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	936,306円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	161,716,625円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	231,587,330円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	61,254,888円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	117,574,514円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,111,739,738円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	930,509,324円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,513,182,848円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	820,044,231円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	95,005,916円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,211,878,840円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	27,776,710円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,383,977,068円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,776,688,251円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	161,330,595円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,620,204,076円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,724,567,598円
分散投資コア戦略ファンドA	11,833,697,737円
分散投資コア戦略ファンドS	10,615,265,979円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	76,270,900円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	869,987,338円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,244,957円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,734,181円
SMT インデックスバランス・オープン	58,227,470円
SMT 世界経済インデックス・オープン	13,513,452円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	12,930,591円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	29,226,361円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,650,006円
グローバル経済コア	222,955,829円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,272,440円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,284,127円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	18,784円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,633円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,089円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	76,881,958,565円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 1月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,895,770,250
地方債証券		168,689,356
特殊債券		292,534,368
社債券		78,522,670
合計		5,435,516,644

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	158,403,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,165,000	
第42回道路債券	100,000,000	111,093,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,785,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,953,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,861,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,184,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	238,856,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,841,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,212,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,233,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,290,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,649,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,302,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,652,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,746,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,784,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,239,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,697,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,566,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	306,655,790	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,900,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	227,430,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,370,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,246,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,158,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,690,000	



第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,563,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,604,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,833,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,374,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	623,736,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,702,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,351,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,246,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	152,515,480	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,909,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,807,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	234,208,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	105,028,380	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,970,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,813,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,673,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,400,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,133,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,253,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,114,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,164,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,039,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,515,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	107,146,590	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	318,082,440	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,799,900	
	100,000,000	101,079,000	

第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,165,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,179,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	527,363,200	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,918,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,300,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,254,940	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	101,103,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,181,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	385,812,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	309,075,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	101,019,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	113,570,600	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,325,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	402,600,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,124,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	135,119,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	43,732,400	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,943,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	238,046,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,740,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	237,672,000	
第21回地方公共団体金融機構債券（5年）	400,000,000	400,044,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,577,620	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,709,930	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,785,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	118,082,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,866,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,589,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	510,380,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,257,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,586,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,840,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,091,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,068,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,586,000	

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

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

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

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

	第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,932,000	
	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	115,257,000	
	第57回日本学生支援債券	100,000,000	99,992,000	
	第58回日本学生支援債券	300,000,000	299,976,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	110,745,000	
	い第795号商工債	200,000,000	200,038,000	
	い第800号商工債	200,000,000	200,120,000	
	い第802号商工債	100,000,000	100,088,000	
	い第804号商工債	300,000,000	300,282,000	
	い第795号農林債	100,000,000	99,967,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,932,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,112,000	
	第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,278,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,286,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,588,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,317,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,260,000	
	第218号商工債（3年）	300,000,000	300,360,000	
	第221号商工債（3年）	200,000,000	200,264,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,518,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	119,447,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,282,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,998,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	203,542,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,572,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,824,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,535,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,636,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,511,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,836,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,608,000	
	特殊債券合計	36,193,834,000	38,039,161,885	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFM）円貨社債	100,000,000	99,862,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFM）円貨社債	100,000,000	100,187,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFM）円貨社債	200,000,000	199,588,000	
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,559,000	

第2回B・P・C・E・S・A円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	99,890,000	
第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 非上位円貨社債	100,000,000	100,451,000	
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	99,863,000	
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	100,010,000	
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	99,714,000	
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円 貨社債	400,000,000	399,772,000	
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	200,000,000	199,964,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	99,878,000	
第1回H S B C・ホールディングス・ビーエ ルシー円貨社債	100,000,000	100,302,000	
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グ ループ・インク円貨社債	200,000,000	208,286,000	
第12回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	400,000,000	400,104,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,890,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,525,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,610,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,873,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	100,206,000	
第11回アサヒグループホールディングス株 式会社無担保社債	100,000,000	100,259,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	102,089,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,248,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,601,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,985,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
第7回J・フロント リテイリング株式会社 無担保社債	100,000,000	99,997,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	102,799,000	
第11回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,015,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	99,927,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	101,161,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,937,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,504,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,498,000	



第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,589,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,515,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,470,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,329,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,781,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,866,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,342,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,683,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,279,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,119,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,744,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,157,000	
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,747,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,692,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,224,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,912,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,270,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,472,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,474,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,438,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,138,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,184,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,963,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,077,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,217,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,134,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,071,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,769,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,940,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,612,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,616,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	99,935,000	
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,240,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,460,000	

第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,362,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,007,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,632,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,622,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	99,767,000	
第11回株式会社りそなホールディングス無担保社債	700,000,000	699,118,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	122,330,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,085,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,120,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,266,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	101,860,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,784,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	306,453,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,680,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,253,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,992,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第66回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	302,412,000	
第73回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	300,852,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,495,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,975,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,956,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,792,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,866,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,969,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,335,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,710,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,782,000	

第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,770,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,630,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,842,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,583,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,860,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,335,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,869,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,074,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,376,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,010,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,754,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	102,477,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,799,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,009,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	237,314,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,226,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,716,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,370,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,910,100	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,683,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,075,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,594,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,974,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	134,695,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,647,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,729,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	113,162,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,691,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	99,173,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,030,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,081,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,169,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	203,718,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,598,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,685,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,300,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,660,000	

第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,019,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,283,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,775,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,915,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,182,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,196,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,245,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,870,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,776,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,737,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,916,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,261,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,283,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,993,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,507,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,817,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,907,700	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,061,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,036,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,261,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,893,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,592,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,486,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,122,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,540,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,346,000	
第320回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,756,740	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,878,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,919,000	
第344回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,132,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,947,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	109,591,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,159,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,604,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,469,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,832,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,686,000	
第6回S C S K株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,062,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	201,626,000	

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

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

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	203,008,903,193口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.6257円 (1万口当たり純資産額) (16,257円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2020年 1月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年 1月20日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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>
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 1月20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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	181,739,336,499円
期中追加設定元本額	51,251,961,477円
期中一部解約元本額	29,982,394,783円
期末元本額	203,008,903,193円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	559,063,044円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,997,301,248円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,277,177円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,057,166,177円
世界経済インデックスファンド	2,080,464,545円
日本株式インデックス・オープン	4,500,548,585円
D C マイセレクション 2 5	6,748,996,395円
D C マイセレクション 5 0	19,027,312,135円
D C マイセレクション 7 5	17,415,606,000円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,618,766,223円
D C マイセレクション S 2 5	2,695,869,350円
D C マイセレクション S 5 0	7,744,694,552円
D C マイセレクション S 7 5	5,072,799,228円
D C 日本株式インデックス・オープン S	6,653,644,108円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	393,934,872円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	716,156,764円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	473,266,215円
D C 世界経済インデックスファンド	2,766,417,382円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,034,612,598円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,194,356円



区分	2020年 1月20日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	33,948,947円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,943,720円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	276,314,405円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,582,381円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	75,539,439円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	264,035,831円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	56,048,776円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	368,611,727円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,636,501,447円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	686,722,574円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,983,925,235円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	600,280,766円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	37,927,462円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	752,163,743円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	34,607,624円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	423,317,624円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	547,913,255円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,230,406円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	819,115,458円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,705,766,199円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,752,075,138円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,095,776,300円
分散投資コア戦略ファンドA	6,030,497,337円
分散投資コア戦略ファンドS	17,579,200,422円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	284,135,512円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	297,717,848円
コア投資戦略ファンド(切替型)	704,217,606円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,918,392円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,575,098円
SMT インデックスバランス・オープン	69,486,963円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,463,135,319円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	520,269,860円
SMT 世界経済インデックス・オープン	18,093,806円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	63,295,123円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	10,349,611円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,741,669円
グローバル経済コア	267,806,303円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,994,199円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	40,666,396円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,755,589円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	353,247,293円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	26,581,000円

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2020年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	2,805,878,500	-	2,845,980,000	40,101,500
	合計	2,805,878,500	-	2,845,980,000	40,101,500

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 外国債券インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

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

##### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 1月20日現在
	1.有価証券の評価基準及び評価方法

	2020年 1月20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(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</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 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,679,824,519口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8675円 (1万口当たり純資産額) (28,675円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

	2020年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	91,483,392,692円
期中追加設定元本額	62,509,950,196円
期中一部解約元本額	12,313,518,369円
期末元本額	141,679,824,519円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,689,881,349円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	688,322,638円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,006,398,968円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,897,036円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,455,214,801円
世界経済インデックスファンド	6,689,763,647円
D C マイセレクション 2 5	1,702,076,585円
D C マイセレクション 5 0	1,294,867,794円
D C マイセレクション 7 5	831,946,004円



区分	2020年 1月20日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	1,938,284,715円
D C マイセレクション S 2 5	685,327,844円
D C マイセレクション S 5 0	531,262,675円
D C マイセレクション S 7 5	242,427,942円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	48,697,997円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	68,339,372円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	32,632,956円
D C 世界経済インデックスファンド	8,958,987,619円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	611,484,286円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	31,987,808円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,747,312円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,138,242円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	46,626,802円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	92,073,128円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	137,813,524円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	152,774,848円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	335,226,966円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,014,527,437円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	597,425,357円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,127,720,248円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	852,112,883円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	75,409,913円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	601,562,557円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	34,983,381円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	222,572,323円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	290,769,644円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	931,346,094円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	2,056,785,309円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	890,520,865円
外国債券ファンド・シリーズ 1	562,059,470円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,211,955,403円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,086,483,704円
分散投資コア戦略ファンド A	1,715,712,713円
分散投資コア戦略ファンド S	6,523,939,020円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	297,020,210円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,883,841,213円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,032,487,587円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	219,103,308円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,746,791円
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）	1,059,216,372円
S M T インデックスバランス・オープン	213,956,806円
外国債券 S M T B セレクション（SMA専用）	22,717,047,812円
S M T 世界経済インデックス・オープン	88,253,627円

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年 1月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		8,107,142,982
合計		8,107,142,982

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2020年 1月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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	3,884,320,824	-	3,885,280,443	959,619
	合計	3,884,320,824	-	3,885,280,443	959,619

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2020年 1月20日現在）

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

### (注)時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 204銘柄	100.0%	48.2%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 297銘柄	100.0%	37.3%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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 1月20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 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,149,497,764口

	2020年 1月20日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.9657円 (29,657円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 1月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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



	2020年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	141,058,766,855円
期中追加設定元本額	23,858,444,019円
期中一部解約元本額	23,767,713,110円
期末元本額	141,149,497,764円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,390,187,399円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,893,375円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,798,478,245円
世界経済インデックスファンド	7,440,741,384円
外国株式インデックス・オープン	648,785,530円

区分	2020年 1月20日現在
D Cマイセレクション2 5	1,089,454,460円
D Cマイセレクション5 0	4,794,545,753円
D Cマイセレクション7 5	4,993,152,340円
D C外国株式インデックス・オープン	8,792,383,738円
D CマイセレクションS 2 5	429,309,786円
D CマイセレクションS 5 0	1,958,559,156円
D CマイセレクションS 7 5	1,449,456,937円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	110,392,384円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	196,654,078円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	129,992,820円
D C世界経済インデックスファンド	9,688,919,173円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,891,071,009円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,057,136円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,144,782円
外国株式インデックス・オープンV A 1（適格機関投資家専用）	38,586,502円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	40,922,929円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	148,612,591円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	31,470,073円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	207,145,386円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	627,080,633円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	336,507,368円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,225,349,882円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	1,705,255,989円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	64,710,090円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	321,004,422円
グローバルバランスファンドV A 3 5（適格機関投資家専用）	7,863,163円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	102,506,742円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,805,529,064円
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）	1,923,957,810円
外国株式ファンド・シリーズ1	999,585,968円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,262,207,614円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,508,807,799円
分散投資コア戦略ファンドA	2,488,858,275円
分散投資コア戦略ファンドS	7,633,634,186円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,011,081,626円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,101,331,619円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,505,453,418円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	748,449,933円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	40,736,684円
S M T インデックスバランス・オープン	247,951,709円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,256,342,909円
外国株式S M T Bセレクション（SMA専用）	29,611,751,672円
S M T 世界経済インデックス・オープン	97,720,924円

区分	2020年 1月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	344,728,012円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	58,834,251円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,608,981円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	54,326,217円
グローバル経済コア	898,506,723円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	8,258,223円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	772,204円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,457,720円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	65,377,187円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	58,867円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	66,613円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,359円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	81,330円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,171,841,682円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	741,635,435円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,591,013,175円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	73,893,487円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	341,366,833円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2020年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	12,412,588,561	-	12,680,442,879	267,854,318
	合計	12,412,588,561	-	12,680,442,879	267,854,318

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2020年 1月20日現在)

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

## (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	34,273	32.67	1,119,698.91	

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 610銘柄	96.9%			67.5%
	投資証券 41銘柄			3.1%	2.2%
カナダドル	株式 85銘柄	99.2%			3.6%
	投資証券 5銘柄			0.8%	0.0%
ユーロ	株式 236銘柄	99.1%			11.2%
	投資証券 5銘柄			0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式 93銘柄	98.9%			5.7%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	91.1%			2.3%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券 7銘柄			6.8%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 34銘柄	93.6%			1.1%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.6%	0.1%
シンガポールドル	株式 20銘柄	88.4%			0.4%
	投資証券 5銘柄			11.6%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,313,360,525
コール・ローン	941,100,347
国債証券	57,436,870,553
未収利息	830,228,749
前払費用	85,522,964
流動資産合計	60,607,083,138
資産合計	60,607,083,138
負債の部	
流動負債	
未払解約金	120,633,302
未払利息	377
流動負債合計	120,633,679
負債合計	120,633,679
純資産の部	
元本等	
元本	33,299,525,287
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	27,186,924,172
元本等合計	60,486,449,459
純資産合計	60,486,449,459
負債純資産合計	60,607,083,138

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2020年 1月20日現在

## (貸借対照表に関する注記)

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 1月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。



	2020年 1月20日現在
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

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

区分	2020年 1月20日現在
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,823,854,114円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	97,764,927円
分散投資コア戦略ファンドA	238,608,738円
分散投資コア戦略ファンドS	1,162,765,699円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	247,408,584円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,410,307,452円
コア投資戦略ファンド（切替型）	144,618,229円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	187,696,489円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	87,261,882円
SMT インデックスバランス・オープン	185,823,171円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,225,015,997円
SMT 世界経済インデックス・オープン	104,955,096円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	121,777,144円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	183,824,296円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,406,406円
グローバル経済コア	720,157,475円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	28,048,658円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,567,889円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	22,339円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	23,809円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	25,278円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	26,454円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	96,902,724円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	275,740,363円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	204,183,190
合計	204,183,190

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	22,700,000.00	29,367,557.50			
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	93,452,861.25			
		MBONO 5.75% 03/05/26	51,600,000.00	49,057,152.00			
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	80,796,030.00			
		MBONO 6.5% 06/10/21	83,000,000.00	82,753,490.00			
		MBONO 6.75% 03/09/23	300,000.00	300,010.50			
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	83,164,672.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000.00	95,923,542.50			
		MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	53,235,951.00			
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	65,912,625.00			
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	25,834,560.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	81,800,000.00	91,321,929.00			
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	55,447,296.50			
		MBONO 8% 09/05/24	39,800,000.00	41,770,100.00			
		MBONO 8% 11/07/47	54,800,000.00	60,569,892.00			
		MBONO 8% 12/07/23	112,900,000.00	117,627,687.50			
			メキシコペソ 小計		968,550,000.00	1,026,535,356.75 (6,066,823,958)	
			ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	25,934,640.13	
	BLTN 0% 07/01/21			22,550,000.00	21,104,317.24		
BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00			24,245,956.05			
BLTN 0% 07/01/23	48,550,000.00			39,851,621.78			
BNTNF 10% 01/01/23	31,850,000.00			35,502,212.77			
BNTNF 10% 01/01/25	24,450,000.00			28,168,851.38			
BNTNF 10% 01/01/27	22,150,000.00			26,170,607.33			
BNTNF 10% 01/01/29	12,700,000.00			15,362,366.54			
BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00			1,696,625.00			
BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00			513,281.25			
BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00			2,065,062.50			
	ブラジルリアル 小計			222,100,000.00	220,615,541.97 (5,841,899,551)		
	チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/21	825,000,000.00	849,293,311.35			

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

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

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

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

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

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.6%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	2.8%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	6.2%
ペルーヌエボソル	国債証券 8銘柄	100.0%	3.6%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 16銘柄	100.0%	3.9%
チェココルナ	国債証券 10銘柄	100.0%	3.8%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.0%	3.8%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.1%
ロシアルーブル	国債証券 20銘柄	100.0%	9.2%
マレーシアリンギット	国債証券 14銘柄	100.0%	6.4%
タイバーツ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.8%



フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券	24銘柄	100.0%	10.6%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	9.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 1月20日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	2,301,442,730
コール・ローン	104,271,977
株式	69,368,831,475
投資信託受益証券	246,376,472
投資証券	168,158,006
派生商品評価勘定	73,475,431
未収入金	2,470,810
未収配当金	63,282,796
差入委託証拠金	855,480,950
流動資産合計	73,183,790,647
資産合計	73,183,790,647
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	196,795
前受金	73,268,636
未払金	19,848,121
未払株式払込金	1,800,864
未払解約金	134,384,998
未払利息	41
流動負債合計	229,499,455
負債合計	229,499,455
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	23,263,694,840
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	49,690,596,352
元本等合計	72,954,291,192
純資産合計	72,954,291,192
負債純資産合計	73,183,790,647

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2020年 1月20日現在
	<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 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

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

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 1月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

	2020年 1月20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 1月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	19,183,829,395円
期中追加設定元本額	5,573,513,977円
期中一部解約元本額	1,493,648,532円
期末元本額	23,263,694,840円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,229,169,628円
世界経済インデックスファンド	3,341,714,946円
D C 新興国株式インデックス・オープン	4,269,703,017円
D C 世界経済インデックスファンド	4,394,505,833円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	209,102,636円
分散投資コア戦略ファンドA	347,760,091円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,634,607円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	459,734,910円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	484,087,793円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	339,457,426円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,787,534円
S M T インデックスバランス・オープン	108,865,193円
S M T 世界経済インデックス・オープン	63,230,215円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	225,584,918円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,908,299円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	1,477,416円
グローバル経済コア	423,042,879円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	15,644,376円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	26,252円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	29,706円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	33,160円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	36,269円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	50,157,736円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2020年 1月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,064,571,223	-	3,137,839,859	73,268,636
	合計	3,064,571,223	-	3,137,839,859	73,268,636

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2020年 1月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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 売建	44,082,000	-	44,072,000	10,000
	アメリカドル	44,082,000	-	44,072,000	10,000
	合計	44,082,000	-	44,072,000	10,000

(注)時価の算定方法

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

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

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



	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	247,600	112.73	27,911,948.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	24.86	6,277,150.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,314,140	15.50	51,369,170.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	87.71	5,043,325.00	
	メキシコペソ 小計	7,696,855		262,213,436.45 (1,549,681,409)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	78.00	1,435,200.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	297,600	31.85	9,478,560.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	409,040	29.85	12,209,844.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	26.27	1,986,012.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	34.27	507,196.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	14.78	931,140.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	21.57	2,264,850.00	
	SUZANO SA	50,679	43.78	2,218,726.62	
	VALE SA	310,478	57.00	17,697,246.00	
	EMBRAER SA	69,700	19.55	1,362,635.00	
	WEG SA	84,872	36.80	3,123,289.60	
	CCR SA	125,600	19.03	2,390,168.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	49.49	3,066,004.48	
	RUMO SA	97,700	24.30	2,374,110.00	
	COGNA EDUCACAO	138,184	11.67	1,612,607.28	
	B2W CIA DIGITAL	20,960	71.26	1,493,609.60	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	28.33	1,805,074.28	
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	59.22	4,909,752.54	
	MAGAZINE LUIZA SA	70,100	54.35	3,809,935.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	28.75	2,185,000.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	23.39	970,685.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	90.04	1,332,592.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,500	115.68	2,834,160.00	
	AMBEV SA	470,500	18.70	8,798,350.00	
	BRF SA	52,500	35.75	1,876,875.00	
	JBS SA	106,400	29.75	3,165,400.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	62,900	45.88	2,885,852.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	63.00	1,266,300.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	46,200	74.10	3,423,420.00	
	HYPERA SA	35,300	37.42	1,320,926.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,362	33.58	3,907,435.96	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	405,653	35.45	14,380,398.85	
BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	50.12	4,425,596.00		
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	483,781	34.94	16,903,308.14		
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	446,767	13.60	6,076,031.20		
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	200,703	45.34	9,099,874.02		

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 56銘柄	100.0%			14.3%
メキシコペソ	株式 23銘柄	94.0%			2.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.4%		0.1%
	投資証券 1銘柄			3.6%	0.1%
ブラジルレアル	株式 50銘柄	95.9%			6.9%
	投資信託受 益証券 5銘柄		4.1%		0.3%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
コロンビアペソ	株式 7銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%			0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 18銘柄	100.0%			0.9%
香港ドル	株式 210銘柄	100.0%			21.1%
マレーシアリングギット	株式 40銘柄	100.0%			1.8%
タイバーツ	株式 41銘柄	100.0%			2.5%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%			0.9%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.0%			1.9%
韓国ウォン	株式 110銘柄	100.0%			11.8%

新台幣ドル	株式	88銘柄	100.0%			11.4%
インドルピー	株式	84銘柄	100.0%			8.7%
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式	44銘柄	96.6%			4.4%
	投資証券	3銘柄			3.4%	0.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	7銘柄	100.0%			0.6%
香港・オフショア人 民元	株式	218銘柄	100.0%			4.2%
サウジアラビアリアル	株式	33銘柄	100.0%			2.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間(2020年1月21日から2020年7月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （2020年 1月20日現在）	第8期中間計算期間 （2020年 7月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,550,736	8,688,117
親投資信託受益証券	697,589,103	665,534,750
未収入金	9,270,000	90,000
流動資産合計	714,409,839	674,312,867
資産合計	714,409,839	674,312,867
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,595,964	377,820
未払受託者報酬	193,684	179,870
未払委託者報酬	1,549,390	1,438,912
未払利息	3	10
その他未払費用	19,307	17,929
流動負債合計	10,358,348	2,014,541
負債合計	10,358,348	2,014,541
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	548,384,518	534,762,003
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	155,666,973	137,536,323
（分配準備積立金）	71,838,723	63,432,005
元本等合計	704,051,491	672,298,326
純資産合計	704,051,491	672,298,326
負債純資産合計	714,409,839	674,312,867

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自 2019年 1月22日 至 2019年 7月21日	第8期中間計算期間 自 2020年 1月21日 至 2020年 7月20日
営業収益		
受取利息	2	29
有価証券売買等損益	31,576,393	14,944,353
営業収益合計	31,576,395	14,944,324
営業費用		
支払利息	2,307	2,142
受託者報酬	185,024	179,870
委託者報酬	1,480,123	1,438,912
その他費用	18,469	17,944
営業費用合計	1,685,923	1,638,868
営業利益又は営業損失（ ）	29,890,472	16,583,192
経常利益又は経常損失（ ）	29,890,472	16,583,192
中間純利益又は中間純損失（ ）	29,890,472	16,583,192
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,089,084	5,538,573
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	95,494,254	155,666,973
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,886,319	12,032,905
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,886,319	12,032,905
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,222,115	19,118,936
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,222,115	19,118,936
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	122,959,846	137,536,323



## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第7期 (2020年 1月20日現在)	第8期中間計算期間 (2020年 7月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	548,384,518口	534,762,003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) 1.2839円 (12,839円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2572円 (12,572円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第8期中間計算期間 (2020年 7月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第8期中間計算期間 (2020年 7月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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7期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日	第8期中間計算期間 自 2020年 1月21日 至 2020年 7月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	585,537,061円	548,384,518円
期中追加設定元本額	89,841,976円	54,643,859円
期中一部解約元本額	126,994,519円	68,266,374円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,079,501,028
国債証券	458,303,406,250

	2020年 7月20日現在
項目	金額（円）
地方債証券	29,843,867,116
特殊債券	38,316,304,834
社債券	22,046,241,430
未収入金	488,680
未収利息	918,905,644
前払費用	19,235,476
流動資産合計	550,527,950,458
資産合計	550,527,950,458
負債の部	
流動負債	
未払金	695,778,020
未払解約金	151,995,637
未払利息	1,322
流動負債合計	847,774,979
負債合計	847,774,979
純資産の部	
元本等	
元本	390,188,520,115
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	159,491,655,364
元本等合計	549,680,175,479
純資産合計	549,680,175,479
負債純資産合計	550,527,950,458

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
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>
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 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	390,188,520,115口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 101,583,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4088円 (1万口当たり純資産額) (14,088円)

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2020年 1月21日

区分	2020年 7月20日現在
期首元本額	389,894,814,663円
期中追加設定元本額	29,845,789,308円
期中一部解約元本額	29,552,083,856円
期末元本額	390,188,520,115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）	3,658,150,510円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,334,750円
S M T 国内債券インデックス・オープン	18,556,820,888円
世界経済インデックスファンド	2,039,305,759円
D C マイセレクション 2 5	21,796,171,766円
D C マイセレクション 5 0	23,392,230,989円
D C マイセレクション 7 5	6,046,469,763円
D C 日本債券インデックス・オープン	457,319,389円
D C 日本債券インデックス・オープン S	90,674,165,975円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,673,831,835円
D C マイセレクション S 2 5	9,413,392,056円
D C マイセレクション S 5 0	9,944,632,377円
D C マイセレクション S 7 5	1,978,930,372円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,093,247,852円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,472,173,942円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	503,207,185円
D C 世界経済インデックスファンド	2,620,748,007円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	66,114,948円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,278,813円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	42,611,891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）	894,939円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	148,980,442円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	206,128,280円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	52,312,423円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	79,817,855円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,889,241,065円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	842,422,028円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,477,723,723円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	757,354,409円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	88,531,520円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,135,291,425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）	25,275,848円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,316,721,221円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,643,195,684円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	149,420,301円

区分	2020年 7月20日現在
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,079,143,220円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,805,028,879円
分散投資コア戦略ファンドA	11,701,304,508円
分散投資コア戦略ファンドS	10,388,137,228円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,238,244円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	941,301,693円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,363,987円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,474,064円
SMT インデックスバランス・オープン	56,557,277円
SMT 世界経済インデックス・オープン	15,136,894円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	27,527,250円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	40,527,188円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,720,279円
グローバル経済コア	220,124,516円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,568,503円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,300,158円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	263,308円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	224,938円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	53,780円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	34,459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）	72,430,635,219円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	15,125,474円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,618,026,005
株式	320,847,468,200
派生商品評価勘定	13,885,250
未収配当金	492,862,081
前払金	13,375,200
差入委託証拠金	97,410,000
流動資産合計	324,083,026,736
資産合計	324,083,026,736
負債の部	

	2020年 7月20日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	27,276,950
未払解約金	63,003,057
未払利息	3,206
流動負債合計	90,283,213
<b>負債合計</b>	90,283,213
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	217,294,758,819
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	106,697,984,704
元本等合計	323,992,743,523
<b>純資産合計</b>	323,992,743,523
<b>負債純資産合計</b>	324,083,026,736

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2020年 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		217,294,758,819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)	1.4910円 (14,910円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

		2020年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<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>	

## （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 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	



区分	2020年 7月20日現在
期首	2020年 1月21日
期首元本額	203,008,903,193円
期中追加設定元本額	36,168,003,927円
期中一部解約元本額	21,882,148,301円
期末元本額	217,294,758,819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)	537,078,392円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,064,590,551円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,344,527円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,449,900,599円
世界経済インデックスファンド	2,301,865,668円
日本株式インデックス・オープン	4,147,794,997円
DCマイセレクション25	6,899,369,650円
DCマイセレクション50	19,435,865,683円
DCマイセレクション75	18,090,033,032円
DC日本株式インデックス・オープン	5,819,997,297円
DCマイセレクションS25	2,937,253,894円
DCマイセレクションS50	8,264,385,927円
DCマイセレクションS75	5,323,075,184円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,049,075,538円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	344,306,902円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	707,824,484円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	471,727,852円
DC世界経済インデックスファンド	2,935,060,021円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,059,616,554円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,350,869円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	35,161,415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)	260,267,263円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,628,611円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	67,446,832円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	251,518,762円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	52,460,062円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	274,377,858円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,508,858,180円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	663,715,865円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,782,394,568円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	607,464,519円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	38,731,034円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	695,613,451円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	34,307,613円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	409,002,248円

区分	2020年 7月20日現在
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	510,324,763円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	52,581,925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）	828,981,519円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,586,240,667円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,950,734,571円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,687,113,627円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,064,328,730円
分散投資コア戦略ファンドA	5,501,749,681円
分散投資コア戦略ファンドS	15,115,390,823円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	330,696,466円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	352,379,639円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,031,583,665円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	208,386,838円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,948,901円
SMT インデックスバランス・オープン	67,758,675円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	12,641,059,306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	24,005,228円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	79,176,151円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	13,779,123円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,873,427円
グローバル経済コア	265,333,185円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	19,057,101円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	47,140,232円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,697,814円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	761,423,048円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	111,994,533円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	219,064円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	247,053円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	90,692円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	119,755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）	50,019,744,278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）	1,853,958,909円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	49,165,340円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,380,613円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 7月20日現在）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,906,775,200	-	2,893,400,000	13,375,200
合計		2,906,775,200	-	2,893,400,000	13,375,200

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 7月20日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	224,502,443
コール・ローン	5,716,036,352
国債証券	281,192,390,332
派生商品評価勘定	20,173,443
未収入金	11,223,228
未収利息	1,805,069,096
前払金	358,371
前払費用	115,028,148
差入委託証拠金	519,910,365
流動資産合計	289,604,691,778
資産合計	289,604,691,778
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,860,485
未払金	502,400
未払解約金	2,383,963,319
未払利息	7,001
流動負債合計	2,388,333,205
負債合計	2,388,333,205
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	96,593,356,851
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	190,623,001,722
元本等合計	287,216,358,573
純資産合計	287,216,358,573
負債純資産合計	289,604,691,778

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2020年 7月20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 7月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,593,356,851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 2.9735円 (1万口当たり純資産額) (29,735円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

(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 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	141,679,824,519円
期中追加設定元本額	7,913,978,641円
期中一部解約元本額	53,000,446,309円
期末元本額	96,593,356,851円
期末元本額の内訳	

区分	2020年 7月20日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	1,611,996,053円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	629,910,845円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	427,119,141円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,038,305,129円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,981,925円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,549,014,957円
世界経済インデックスファンド	6,760,967,917円
DCマイセレクション25	1,770,330,537円
DCマイセレクション50	1,424,230,504円
DCマイセレクション75	866,815,094円
DC外国債券インデックス・オープン	2,015,814,072円
DCマイセレクションS25	749,947,416円
DCマイセレクションS50	605,737,737円
DCマイセレクションS75	276,926,718円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	44,257,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	69,527,724円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	33,614,481円
DC世界経済インデックスファンド	8,650,842,853円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	555,233,721円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	30,248,726円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,580,123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）	38,862,694円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	80,395,079円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	120,180,214円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	125,758,699円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	219,256,461円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,809,603,018円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	515,478,671円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,968,229,112円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	758,464,747円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	67,707,556円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	535,703,532円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	30,955,203円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	209,978,153円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	262,079,936円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	868,072,584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）	1,263,556,498円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	786,227,298円
外国債券ファンド・シリーズ1	592,001,372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	1,698,682,884円

区分	2020年 7月20日現在
分散投資コア戦略ファンドS	6,316,052,062円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	318,311,111円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,036,889,075円
コア投資戦略ファンド(切替型)	614,192,318円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	197,429,464円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	97,237,814円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,091,262,263円
SMT インデックスバランス・オープン	190,149,297円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	20,755,313,608円
SMT 世界経済インデックス・オープン	108,891,412円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	108,644,924円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	189,221,767円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,950,264円
グローバル経済コア	815,701,361円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	9,315,133円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	243,725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)	19,500,773円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	189,281円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	263,741円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	100,762円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	152,764円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	630,794,156円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,301,111,451円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	343,825,473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)	363,477,494円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	67,387,140円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2020年 7月20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	3,548,180,635	-	3,547,822,264	358,371
	合計	3,548,180,635	-	3,547,822,264	358,371

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2020年 7月20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	3,340,659,371	-	3,357,330,700	16,671,329
	アメリカドル	1,499,992,986	-	1,504,580,000	4,587,014
	カナダドル	158,534,502	-	159,011,100	476,598
	ユーロ	1,431,318,117	-	1,442,900,000	11,581,883
	イギリスポンド	250,813,766	-	250,839,600	25,834
合計		3,340,659,371	-	3,357,330,700	16,671,329

### (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。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 7月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,676,129,911
コール・ローン	616,603,367
株式	398,865,731,160
投資信託受益証券	265,590,527
投資証券	9,581,887,916
派生商品評価勘定	272,861,801
未収入金	11,828,494
未収配当金	358,364,167
差入委託証拠金	3,421,571,167
流動資産合計	417,070,568,510
資産合計	417,070,568,510
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,477,407
前受金	272,075,344
未払解約金	771,188,750
未払利息	755



	2020年 7月20日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,044,742,256
負債合計	1,044,742,256
純資産の部	
元本等	
元本	149,616,758,230
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	266,409,068,024
元本等合計	416,025,826,254
純資産合計	416,025,826,254
負債純資産合計	417,070,568,510

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2020年 7月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <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 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	149,616,758,230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 2.7806円 (1万口当たり純資産額) (27,806円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2020年 7月20日現在
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>

(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 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	141,149,497,764円
期中追加設定元本額	25,377,709,533円
期中一部解約元本額	16,910,449,067円
期末元本額	149,616,758,230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）	2,372,828,935円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,792,911円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,994,521,363円
世界経済インデックスファンド	8,314,996,994円
外国株式インデックス・オープン	772,543,900円

区分	2020年 7月20日現在
D Cマイセレクション2 5	993,498,887円
D Cマイセレクション5 0	4,795,488,638円
D Cマイセレクション7 5	5,072,918,722円
D C外国株式インデックス・オープン	9,669,554,709円
D CマイセレクションS 2 5	415,914,110円
D CマイセレクションS 5 0	2,039,387,959円
D CマイセレクションS 7 5	1,469,076,245円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	92,380,237円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	203,833,385円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	135,528,518円
D C世界経済インデックスファンド	10,517,357,970円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	2,184,827,856円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,671,179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）	37,753,699円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	38,245,510円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	141,172,231円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	29,639,871円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	154,989,666円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	561,083,340円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	317,667,989円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,087,365,708円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	1,682,459,329円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	64,095,016円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	300,757,700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）	7,911,099円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	101,032,578円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,704,780,444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）	1,842,295,551円
外国株式ファンド・シリーズ1	978,744,060円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,236,946,543円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,428,373,745円
分散投資コア戦略ファンドA	2,109,567,375円
分散投資コア戦略ファンドS	6,081,166,286円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,150,807,239円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,166,375,479円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,178,690,581円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	734,131,376円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	39,242,636円
S M T インデックスバランス・オープン	221,463,583円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,221,448,205円
外国株式S M T Bセレクション（SMA専用）	34,513,549,682円
S M T 世界経済インデックス・オープン	122,766,288円

区分	2020年 7月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	412,414,793円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	72,939,157円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,287,783円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	73,391,047円
グローバル経済コア	978,332,800円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,705,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,355,224円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	463,823,625円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	76,831,136円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	742,790円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	859,335円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	309,635円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	408,145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）	1,089,319,718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）	1,475,620,932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）	1,758,660,026円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	245,392,916円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	63,644,419円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	368,096,231円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	794,988,771円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	399,488,655円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2020年 7月20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	6,662,863,256	-	6,934,938,600	272,075,344
合計		6,662,863,256	-	6,934,938,600	272,075,344

(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 7月20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				
	売建	496,405,850	-	497,096,800	690,950
	アメリカドル	385,648,900	-	385,960,900	312,000
	ユーロ	67,364,550	-	67,534,500	169,950
	デンマーククローネ	25,420,000	-	25,575,000	155,000
	オーストラリアドル	17,972,400	-	18,026,400	54,000
合計		496,405,850	-	497,096,800	690,950

## (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。

## 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 7月20日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,558,483,118
コール・ローン	681,869,699
国債証券	55,903,765,532
未収利息	695,646,792
前払費用	68,219,517
流動資産合計	58,907,984,658
資産合計	58,907,984,658
負債の部	
流動負債	
未払解約金	40,600,319
未払利息	835
流動負債合計	40,601,154
負債合計	40,601,154
純資産の部	
元本等	
元本	35,476,011,936
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	23,391,371,568
元本等合計	58,867,383,504
純資産合計	58,867,383,504
負債純資産合計	58,907,984,658

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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>
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 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,476,011,936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 1.6594円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (16,594円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月20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</p> <p>売買目的有価証券</p>

	2020年 7月20日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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)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>

## (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 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	33,299,525,287円
期中追加設定元本額	3,131,440,230円
期中一部解約元本額	954,953,581円
期末元本額	35,476,011,936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	4,209,988,234円
世界経済インデックスファンド	6,140,660,173円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,585,760,665円
DC世界経済インデックスファンド	7,775,654,996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)	1,819,562,149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)	87,793,013円
分散投資コア戦略ファンドA	248,881,880円
分散投資コア戦略ファンドS	1,192,669,310円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	286,155,179円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,668,678,603円



区分	2020年 7月20日現在
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）	188,041,005円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	89,869,095円
SMT インデックスバランス・オープン	161,980,985円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,308,492,490円
SMT 世界経済インデックス・オープン	139,436,776円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	149,047,084円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	247,133,215円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,466,330円
グローバル経済コア	711,656,936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	285,301円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	308,724円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	106,411円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	138,495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）	90,796,660円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	91,875,863円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	302,662,308円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	311,584,720円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

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 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,451,606,930
コール・ローン	51,972,490
株式	69,051,163,644
投資信託受益証券	175,014,286
投資証券	52,687,916
派生商品評価勘定	268,568,832
未収入金	6,348,738
未収配当金	386,032,040
前払金	1,933,171
差入委託証拠金	948,360,985
流動資産合計	73,393,689,032

	2020年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産合計	73,393,689,032
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,273,037
前受金	267,295,795
未払解約金	51,832,823
未払利息	63
流動負債合計	320,401,718
負債合計	320,401,718
純資産の部	
元本等	
元本	25,594,913,865
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	47,478,373,449
元本等合計	73,073,287,314
純資産合計	73,073,287,314
負債純資産合計	73,393,689,032

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

2020年 7月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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、当該先物取引に係るものであります。</p> <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 7月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,594,913,865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 2.8550円 (1万口当たり純資産額) (28,550円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2020年 7月20日現在
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>

(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 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	23,263,694,840円
期中追加設定元本額	2,857,075,337円
期中一部解約元本額	525,856,312円
期末元本額	25,594,913,865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	7,762,612,721円
世界経済インデックスファンド	3,855,132,512円
DC新興国株式インデックス・オープン	4,499,882,865円
DC世界経済インデックスファンド	4,918,804,960円

区分	2020年 7月20日現在
新興国株式インデックス・オープン( S M A 専用)	155,978,417円
分散投資コア戦略ファンドA	362,298,375円
分散投資コア戦略ファンドS	1,279,448,650円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	537,427,190円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	614,996,226円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	340,585,658円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	20,135,128円
S M T インデックスバランス・オープン	113,102,162円
S M T 世界経済インデックス・オープン	93,430,817円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	291,121,016円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	59,372,032円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,213,330円
グローバル経済コア	442,351,762円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	20,415,361円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030	363,633円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040	422,463円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050	152,727円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060	199,870円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	177,237,700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)	47,228,290円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2020年 7月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,525,695,846	-	3,792,991,641	267,295,795
	合計	3,525,695,846	-	3,792,991,641	267,295,795

(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## 【純資産額計算書】

（2020年 8月31日現在）

資産総額	662,487,415円
負債総額	800,495円
純資産総額（ - ）	661,686,920円
発行済口数	520,421,337口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2714円
（1万口当たり純資産額）	（12,714円）

（参考）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2020年 8月31日現在）

資産総額	565,221,071,874円
負債総額	11,089,287,002円
純資産総額（ - ）	554,131,784,872円
発行済口数	394,005,751,264口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4064円
（1万口当たり純資産額）	（14,064円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2020年 8月31日現在）

資産総額	333,660,658,341円
負債総額	138,821,030円
純資産総額（ - ）	333,521,837,311円
発行済口数	217,986,044,353口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5300円
（1万口当たり純資産額）	（15,300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 8月31日現在)

資産総額	288,979,270,641円
負債総額	78,036,010円
純資産総額（ - ）	288,901,234,631円
発行済口数	97,198,017,167口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9723円
（1万口当たり純資産額）	（29,723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 8月31日現在)

資産総額	434,628,091,090円
負債総額	1,140,681,892円
純資産総額（ - ）	433,487,409,198円
発行済口数	147,854,989,019口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9318円
（1万口当たり純資産額）	（29,318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 8月31日現在)

資産総額	59,997,840,451円
負債総額	18,260,597円
純資産総額（ - ）	59,979,579,854円
発行済口数	36,319,531,438口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6514円
（1万口当たり純資産額）	（16,514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 8月31日現在)

資産総額	77,694,799,946円
負債総額	657,432,655円
純資産総額（ - ）	77,037,367,291円
発行済口数	25,812,998,636口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9844円
（1万口当たり純資産額）	（29,844円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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



則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2020年 8月31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。

#### [ D0（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 - D0 - 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10月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年8月31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	529	12,612,155
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	294,431
単位型公社債投資信託	36	258,622
合計	644	13,165,208

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	株主資本				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	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連



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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	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10月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

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
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。
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。
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。
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	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。

## 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【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。



**独立監査人の監査報告書**

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3月19日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2019年1月22日から2020年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2020年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年9月18日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2020年1月21日から2020年7月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2020年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年1月21日から2020年7月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。