

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年11月20日提出
【計算期間】	第3期(自 2019年8月21日至 2020年8月20日)
【ファンド名】	グローバル経済コア
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

〔投資対象資産による属性区分〕

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

〔決算頻度による属性区分〕

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

〔投資対象地域による属性区分(重複使用可能)〕

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

1. 世界の幅広い資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 日本を含む世界*の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、債券、及び不動産投資信託証券(REIT)、並びに金に分散投資します。
※REITは新興国を含みません。
※コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。
- 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。

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。詳しくは後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)マザーファンドの概要」をご覧ください。

- 「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
※「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」は、金現物市場の代表的な指数への連動を目指す上場投資信託証券に投資を行うとともに、組入外貨建資産については対円での為替ヘッジを行います。株式などの主要資産が下落する局面では、金(為替ヘッジあり)にも投資することでリスクの低減を図ります。



? ファミリーファンド方式とは

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

? 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。

2. 世界経済全体の発展を享受します。

- 株式及び債券を投資対象とする各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、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。

基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率

資産	基本資産配分比率 (変動幅) ^{*1, *2}	投資するマザーファンド	各マザーファンド受益証券の 基本組入比率 ^{*2}
株式	37.5% (35.0%~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ^{*3}
		外国株式インデックス マザーファンド	
		新興国株式インデックス マザーファンド	
債券	37.5% (35.0%~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	
		外国債券インデックス マザーファンド	
		新興国債券インデックス マザーファンド	
REIT	10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5.0%
		グローバルREITインデックス マザーファンド	5.0%
金	15.0% (10.0%~20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0%~20.0%）の通り。 ^{*4}

※1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

※2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

※3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

※4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャルペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンド受益証券へ資金を配分し、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。



※基本資産配分比率は、市場動向等に応じて変動幅の範囲で変更する場合があります。

※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50%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

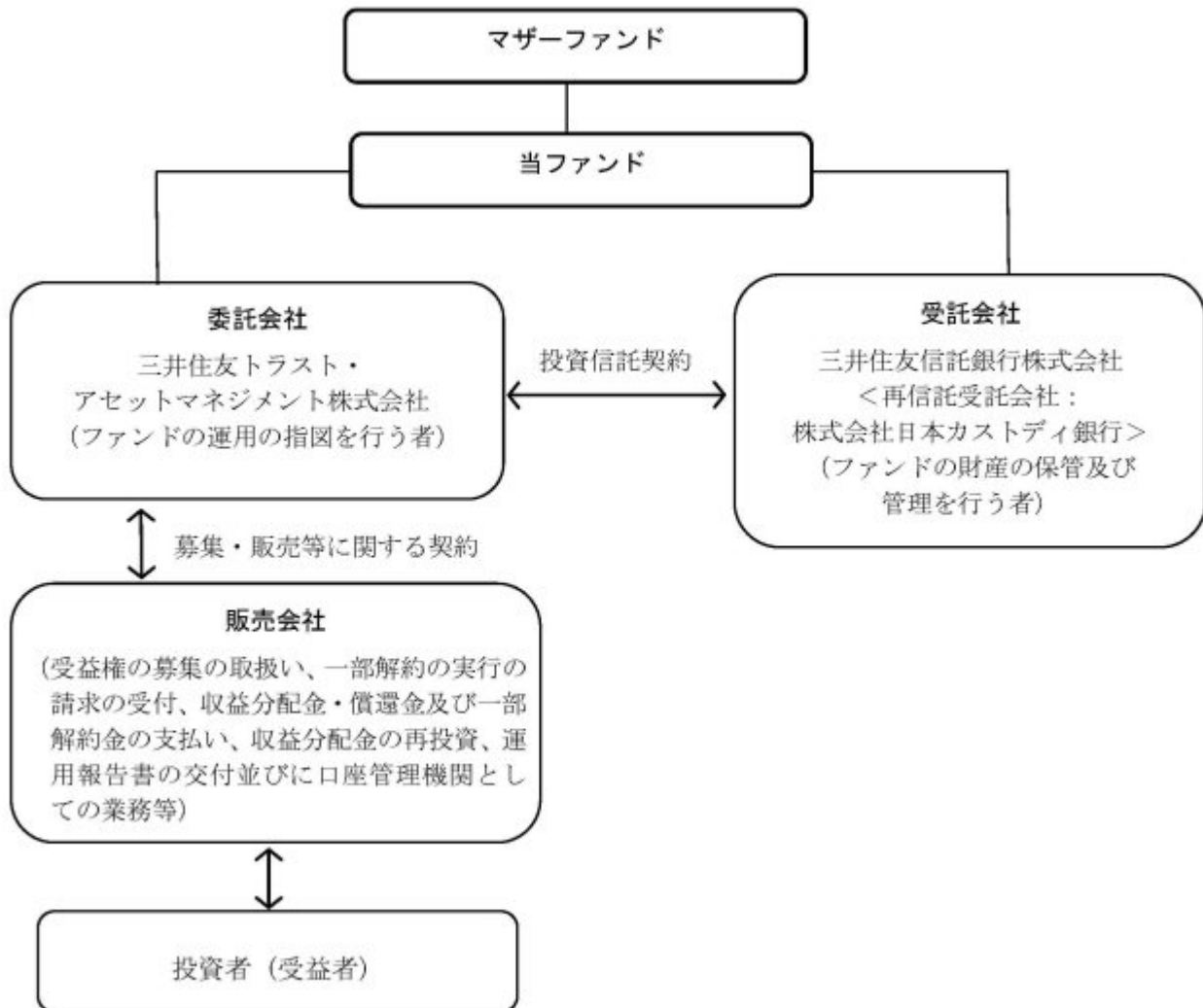
（2）【ファンドの沿革】

2017年11月30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 9月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREIT インデックス マザーファンド」及び「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

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、日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券、及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）、並びに金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券（以下「金」という場合があります。）に実質的に分散投資します。

REITは新興国を含みません。

ロ．基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、以下の通りとします。

基本資産配分比率 （変動幅） ^{1 2}	投資対象マザーファンド	各マザーファンド受益証券 の基本組入比率 ²
<株式> 37.5% (35.0~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ³
	外国株式インデックス マザーファンド	
	新興国株式インデックス マザーファンド	
<債券> 37.5% (35.0~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	5%
	外国債券インデックス マザーファンド	
	新興国債券インデックス マザーファンド	
<REIT> 10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5%
	グローバルREITインデックス マザーファンド	5%
<金> 15.0% (10.0~20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0~20.0%）の通り。 ⁴

- 1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。
 - 2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。
 - 3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。
 - 4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。
- ハ．「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ニ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商

品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの

13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）¹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(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場されている株式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(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)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新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。)への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「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²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、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、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

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

「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）³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。

※3「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。

「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）⁴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もの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。

※4 「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。

「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）⁵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。

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）⁶に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)」とは、新興国の現地通貨建て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。

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）⁷の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）⁸の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

<別に定める金現物に投資する上場投資信託証券>（2020年 9月30日現在）

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

(2)投資態度

主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）⁹（「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。

投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。

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（上場投資信託証券を除きます。）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。

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。

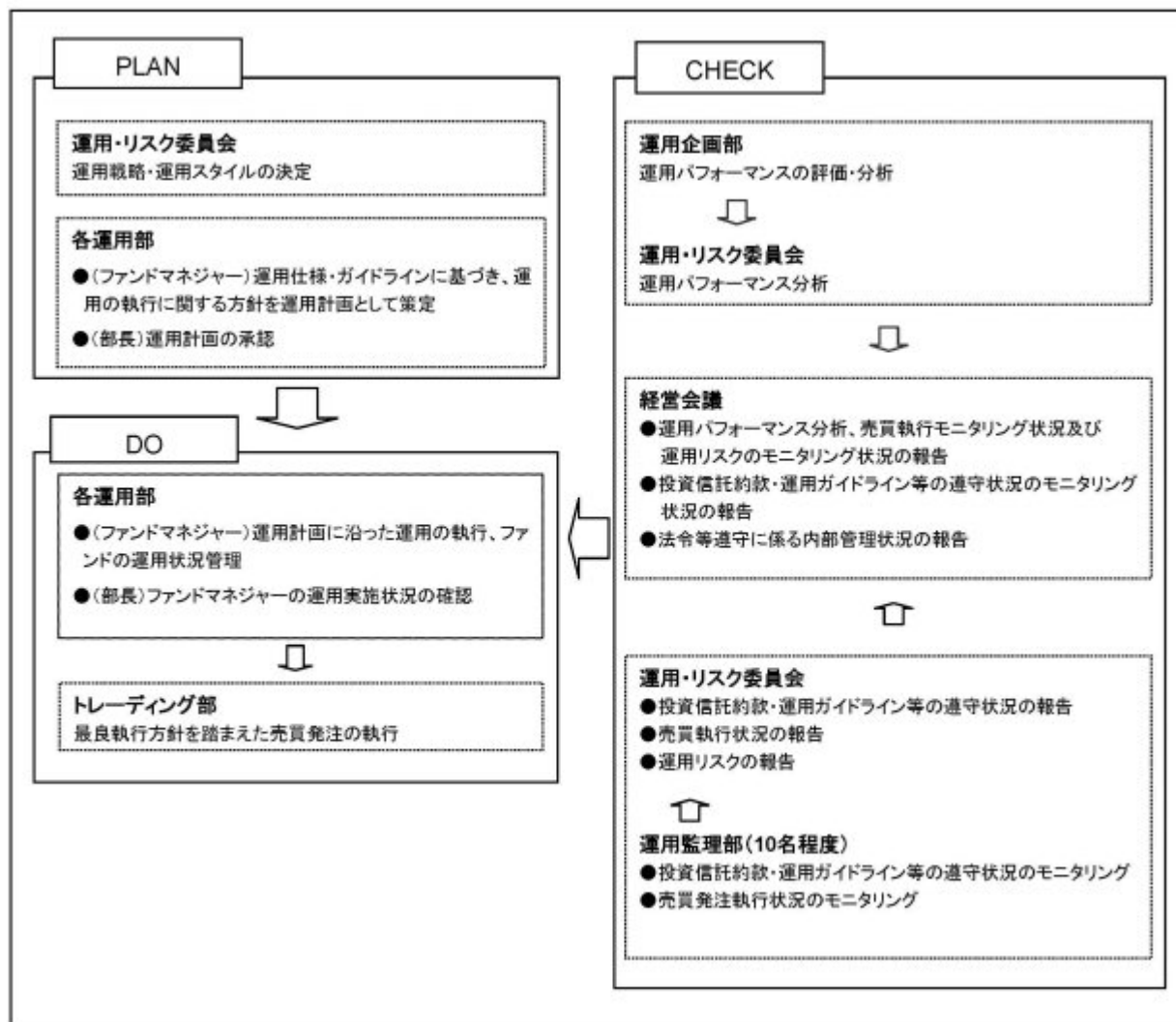
デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

※9 金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)とはLBMA金価格(円ヘッジベース)です(2020年9月30日現在)。LBMA金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格(米ドル建て)を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会(London Bullion Market Association)の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

(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．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

二．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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

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

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (二) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (二) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ) a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。
- ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。
- フ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (二) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- カ．資金の借入れ
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- コ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

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。

なお、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」における外貨建資産については、原則として為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

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。

商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価

格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格変動リスク

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

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>

ファンドは中長期的な成長を目指して、市場環境等の変化や見通しに応じた運用を行うため、委託会社の判断で投資対象とする資産の投資割合を変更します。この投資割合の変更が、ファンドの収益の増加に寄与する場合がありますが、収益の減少や損失の発生の要因となる場合があります。

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

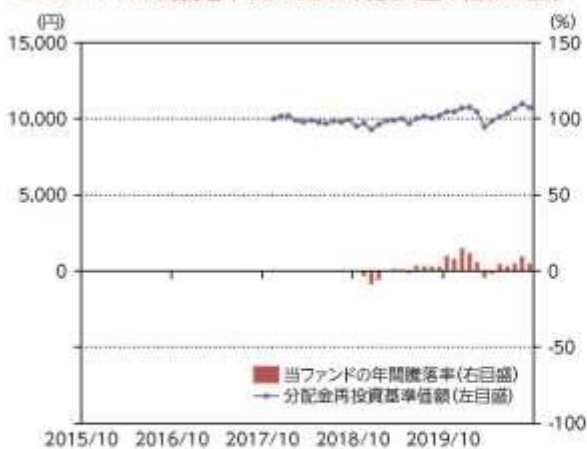
委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを

担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2018年11月～2020年9月の1年11ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2015年10月～2020年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式主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、配当利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、掲載等の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当利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、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動(サービス)に関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより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、説明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 JPMiボック(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(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3% (税抜 3.0%) (1) の率を上限として、販売

会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

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

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

上記及びの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（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0.935%（税抜0.85%）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 0.44% (税抜 0.4%)	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 0.44% (税抜 0.4%)	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。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示していません。

（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ず（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニ

「アNISA（ジュニアニーサ）」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9月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2020年9月30日現在の状況について記載してあります。

【グローバル経済コア】

(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	10,531,284,243	98.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		109,864,278	1.03
合計(純資産総額)		10,641,148,521	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	898,243,824	2.8641	2,572,663,489	2.8168	2,530,173,203	23.78
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	785,669,710	2.9955	2,353,491,404	2.9856	2,345,695,486	22.04
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	1,286,027,853	1.3746	1,767,780,810	1.3431	1,727,264,009	16.23
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	427,052,821	2.9351	1,253,450,202	2.8549	1,219,193,098	11.46
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	684,414,949	1.6482	1,128,062,501	1.6094	1,101,497,418	10.35
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	269,592,117	1.7178	463,131,099	1.7644	475,668,331	4.47
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	275,425,142	1.6056	442,242,147	1.5842	436,328,509	4.10
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	255,506,794	1.5118	386,299,728	1.5498	395,984,429	3.72
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	212,321,702	1.4071	298,759,375	1.4105	299,479,760	2.81

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.97
合計	98.97

(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 (2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
第2期計算期間末 (2019年 8月20日)	12,745,858,008	12,745,858,008	10,021	10,021
第3期計算期間末 (2020年 8月20日)	11,044,987,442	11,044,987,442	10,880	10,880
2019年 9月末日	13,128,114,575		10,216	
10月末日	12,978,200,665		10,460	
11月末日	11,976,985,598		10,473	
12月末日	11,491,290,069		10,711	
2020年 1月末日	11,429,373,827		10,758	
2月末日	10,927,226,150		10,466	
3月末日	10,154,696,774		9,474	
4月末日	10,582,268,823		9,871	
5月末日	10,830,832,013		10,131	
6月末日	10,967,930,283		10,350	
7月末日	11,178,429,890		10,678	
8月末日	11,086,956,383		10,997	
9月末日	10,641,148,521		10,732	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	0
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	4.0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	8.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	3,975,335,196	5,420,865,904	12,719,497,109
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	3,287,324,947	5,855,394,358	10,151,427,698

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	350,000,638,400	98.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,261,902,638	1.76
合計(純資産総額)		356,262,541,038	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	6,225,665,000	1.75

(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	1,714,300	6,786.53	11,634,153,284	6,932.00	11,883,527,600	3.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,196,300	4,977.37	5,954,433,922	6,469.00	7,738,864,700	2.17
日本	株式	ソニー	電気機器	962,500	7,011.08	6,748,168,702	8,032.00	7,730,800,000	2.17
日本	株式	キーエンス	電気機器	139,200	44,390.56	6,179,166,650	48,980.00	6,818,016,000	1.91
日本	株式	任天堂	その他製品	94,200	44,849.77	4,224,848,958	59,660.00	5,619,972,000	1.58
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,278,300	4,159.89	5,317,598,960	3,744.00	4,785,955,200	1.34
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,051,700	3,747.97	3,941,746,260	4,160.00	4,375,072,000	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,015,400	2,440.42	4,918,431,111	2,150.00	4,333,110,000	1.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,365,900	444.58	4,608,509,075	416.10	4,313,250,990	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	1,319,100	3,328.99	4,391,281,657	3,229.00	4,259,373,900	1.20
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,078,200	2,939.41	3,169,274,212	3,885.00	4,188,807,000	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	195,700	16,201.52	3,170,638,915	19,300.00	3,777,010,000	1.06
日本	株式	日本電産	電気機器	369,800	6,841.56	2,530,011,301	9,805.00	3,625,889,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	304,800	10,169.04	3,099,525,280	11,860.00	3,614,928,000	1.01
日本	株式	信越化学工業	化学	258,400	12,693.03	3,279,881,054	13,685.00	3,536,204,000	0.99
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,053,900	3,124.73	3,293,155,911	2,917.50	3,074,753,250	0.86
日本	株式	村田製作所	電気機器	451,400	6,080.56	2,744,768,413	6,773.00	3,057,332,200	0.86
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,209,700	2,781.86	3,365,227,396	2,473.50	2,992,192,950	0.84
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,099,200	3,122.91	3,432,707,994	2,656.00	2,919,475,200	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	144,500	19,304.39	2,789,484,764	20,120.00	2,907,340,000	0.82
日本	株式	花王	化学	367,900	8,606.12	3,166,193,460	7,887.00	2,901,627,300	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,058,400	2,346.31	2,483,342,800	2,685.00	2,841,804,000	0.80
日本	株式	S M C	機械	48,200	54,719.46	2,637,478,261	58,460.00	2,817,772,000	0.79
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,059,100	1,352.49	2,784,926,460	1,310.50	2,698,450,550	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	97,500	22,083.89	2,153,179,513	27,330.00	2,664,675,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	738,300	3,472.95	2,564,081,040	3,543.00	2,615,796,900	0.73
日本	株式	三菱商事	卸売業	992,200	2,517.06	2,497,430,700	2,512.50	2,492,902,500	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	535,800	4,695.46	2,515,827,534	4,600.00	2,464,680,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	1,310,200	1,661.15	2,176,445,750	1,803.00	2,362,290,600	0.66
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	156,200	15,498.61	2,420,883,160	14,740.00	2,302,388,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別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	0.15
		建設業	2.42
		食料品	3.70
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.17
		医薬品	6.38
		石油・石炭製品	0.39
		ゴム製品	0.54
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.55
		非鉄金属	0.64
		金属製品	0.56
		機械	5.38
		電気機器	15.24
		輸送用機器	6.93
		精密機器	2.70
		その他製品	2.75
		電気・ガス業	1.40
		陸運業	3.67
		海運業	0.14
		空運業	0.32
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	9.97
		卸売業	4.62
		小売業	4.97
		銀行業	4.65
		証券、商品先物取引業	0.77
		保険業	1.82
		その他金融業	1.12
		不動産業	1.91
		サービス業	5.63
	小計	98.24	
合計		98.24	

(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	T O P I X先物	買建	383	円	6,258,532,150	6,225,665,000	1.75

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	481,970,791,000	83.54
地方債証券	日本	31,396,337,778	5.44
特殊債券	日本	38,577,990,407	6.69
社債券	日本	22,179,541,450	3.84
	フランス	1,390,883,000	0.24
	オーストラリア	401,092,000	0.07
	アメリカ	203,702,000	0.04
	小計	24,175,218,450	4.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		788,701,423	0.14
合計(純資産総額)		576,909,039,058	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	100.75	9,491,497,800	0.100	2023/12/20	1.65
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	100.93	7,489,525,400	0.100	2024/9/20	1.30
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	100.87	7,364,094,000	0.100	2024/6/20	1.28
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	101.29	7,029,664,800	0.100	2026/9/20	1.22

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	100.70	6,948,300,000	0.100	2023/9/20	1.20
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,820,000,000	100.98	6,887,405,200	101.01	6,889,495,800	0.100	2025/6/20	1.19
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	102.57	6,482,676,800	0.400	2025/9/20	1.12
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	101.18	6,455,411,600	0.100	2026/3/20	1.12
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	5,870,000,000	101.07	5,932,809,000	100.99	5,928,523,900	0.100	2024/12/20	1.03
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	100.53	5,881,239,000	0.100	2022/12/20	1.02
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	101.46	5,874,881,400	0.100	2028/3/20	1.02
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	101.36	5,271,084,000	0.100	2027/3/20	0.91
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	102.44	5,173,321,000	0.400	2025/6/20	0.90
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	5,007,914,100	0.100	2022/3/20	0.87
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,890,000,000	101.48	4,962,391,100	101.43	4,960,269,300	0.100	2028/6/20	0.86
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	101.22	4,929,608,800	0.100	2029/6/20	0.85
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	101.43	4,909,647,600	0.100	2027/9/20	0.85
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	100.81	4,798,936,800	0.100	2024/3/20	0.83
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	100.42	4,790,081,700	0.100	2022/6/20	0.83
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	101.12	4,692,107,200	0.100	2029/9/20	0.81
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	101.31	4,640,364,400	0.100	2029/3/20	0.80
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	101.39	4,633,614,400	1.000	2021/12/20	0.80
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	101.36	4,530,926,100	0.100	2028/12/20	0.79
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	100.47	4,400,761,200	0.100	2022/9/20	0.76
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	4,250,000,000	102.61	4,360,940,300	102.35	4,350,257,500	0.600	2023/12/20	0.75
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	4,260,000,000	101.46	4,322,272,100	101.40	4,319,767,800	0.100	2028/9/20	0.75
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	100.59	4,104,194,400	0.100	2023/3/20	0.71
日本	国債証券	第416回利付国債(2年)	3,990,000,000	100.47	4,009,041,900	100.48	4,009,152,000	0.100	2022/9/1	0.69
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	101.03	3,990,803,500	0.100	2025/3/20	0.69
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	116.38	3,922,241,900	1.400	2034/9/20	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	83.54

地方債証券	5.44
特殊債券	6.69
社債券	4.19
合計	99.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	276,676,996,795	65.48
	イギリス	17,558,315,562	4.16
	スイス	15,205,740,953	3.60
	カナダ	14,000,037,687	3.31
	フランス	13,571,215,455	3.21
	ドイツ	13,007,241,265	3.08
	オーストラリア	8,201,260,340	1.94
	オランダ	7,842,038,301	1.86
	アイルランド	7,448,711,094	1.76
	スウェーデン	4,284,537,758	1.01
	デンマーク	3,448,435,579	0.82
	香港	3,226,414,567	0.76
	スペイン	3,084,071,350	0.73
	イタリア	2,436,605,879	0.58
	フィンランド	1,678,288,734	0.40
	バミューダ	1,266,615,607	0.30
	ベルギー	1,229,228,924	0.29
	シンガポール	1,161,695,763	0.27
	ジャージー	923,306,925	0.22
	ケイマン	784,483,933	0.19
	イスラエル	774,287,298	0.18
	ノルウェー	744,092,674	0.18
ニュージーランド	437,363,315	0.10	

	ルクセンブルク	293,717,004	0.07
	ポルトガル	231,960,906	0.05
	オーストリア	219,705,880	0.05
	キュラソー	217,774,234	0.05
	リベリア	106,311,353	0.03
	マン島	81,748,392	0.02
	パナマ	64,319,932	0.02
	パプアニューギニア	30,364,667	0.01
	小計	400,236,888,126	94.72
投資信託受益証券	オーストラリア	189,134,685	0.04
	香港	75,025,314	0.02
	小計	264,159,999	0.06
投資証券	アメリカ	8,007,167,117	1.89
	オーストラリア	557,174,537	0.13
	シンガポール	218,410,145	0.05
	イギリス	212,208,488	0.05
	フランス	186,203,581	0.04
	香港	169,092,787	0.04
	カナダ	70,827,687	0.02
	小計	9,421,084,342	2.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,630,933,333	2.99
合計(純資産総額)		422,553,065,800	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	9,046,895,049	2.14
	買建	カナダ	581,287,778	0.14
	買建	ドイツ	1,959,418,205	0.46
	買建	イギリス	751,045,326	0.18
	買建	オーストラリア	358,426,520	0.08

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,324,010,300	0.31

(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	1,628,257	8,519.58	13,872,074,889	12,070.72	19,654,237,592	4.65
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	676,810	19,268.47	13,041,095,711	21,928.10	14,841,162,775	3.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	39,828	256,264.52	10,206,503,639	332,728.30	13,251,902,892	3.14
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	225,961	23,977.92	5,418,076,936	27,697.38	6,258,528,134	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	28,424	150,242.58	4,270,495,322	155,455.11	4,418,656,160	1.05
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,190	150,383.88	4,239,321,828	155,104.91	4,372,407,582	1.03
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	247,547	15,556.32	3,850,921,441	15,558.94	3,851,570,901	0.91
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	280,020	11,860.52	3,321,184,512	12,619.88	3,533,821,038	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	232,638	12,353.51	2,873,896,998	14,522.10	3,378,394,161	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	158,538	20,589.93	3,264,287,146	21,100.75	3,345,271,021	0.79
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	57,796	36,574.84	2,113,879,771	55,971.37	3,234,921,532	0.77
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	69,867	18,130.84	1,266,747,955	44,337.60	3,097,735,518	0.73
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	83,996	32,118.52	2,697,827,516	35,573.13	2,988,000,963	0.71
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	101,081	26,065.98	2,634,775,414	28,789.23	2,910,044,966	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	130,701	19,705.84	2,575,573,070	22,264.55	2,909,999,211	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	286,357	10,564.64	3,025,259,076	10,088.03	2,888,778,007	0.68
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	89,134	32,169.99	2,867,440,342	32,179.06	2,868,249,225	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	388,985	5,913.89	2,300,415,950	6,267.59	2,437,999,274	0.58

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	66,166	39,228.42	2,595,587,778	36,835.80	2,437,278,072	0.58
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	45,295	40,538.48	1,836,190,545	51,771.11	2,344,972,609	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	169,806	12,407.42	2,106,855,631	13,267.32	2,252,870,540	0.53
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	84,561	19,794.85	1,673,872,599	26,180.21	2,213,824,738	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	41,353	44,007.69	1,819,850,349	52,210.18	2,159,047,739	0.51
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	104,882	15,868.09	1,664,278,010	20,578.09	2,158,272,284	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	398,108	6,486.35	2,582,268,822	5,415.90	2,156,113,913	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	428,273	4,211.19	1,803,542,853	4,887.95	2,093,381,293	0.50
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	237,327	8,387.38	1,990,551,751	8,665.02	2,056,443,202	0.49
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	669,946	3,279.46	2,197,066,361	2,994.13	2,005,912,116	0.47
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	522,315	4,034.29	2,107,174,010	3,826.78	1,998,787,730	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	383,648	4,994.78	1,916,238,321	5,175.73	1,985,660,765	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	2.61
		素材	4.31
		資本財	5.97
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	2.06
		自動車・自動車部品	1.51
		耐久消費財・アパレル	1.87
		消費者サービス	1.48
		メディア・娯楽	6.51
		小売	6.12
		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	2.18
	ヘルスケア機器・サービス	5.16
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.30
	銀行	4.78
	各種金融	4.04
	保険	2.91
	不動産	0.45
	ソフトウェア・サービス	12.15
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.06
	電気通信サービス	1.96
	公益事業	3.29
	半導体・半導体製造装置	3.96
	小計	94.72
投資信託受益証券		0.06
投資証券		2.23
合計		97.01

(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	513	アメリカドル	85,981,056	9,096,795,725	85,509,405	9,046,895,049	2.14
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	38	カナダドル	7,367,743	582,272,729	7,355,280	581,287,778	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	47	スイスフラン	4,894,639	563,079,271	4,794,000	551,501,760	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	354	ユーロ	11,608,588	1,441,438,372	11,338,620	1,407,916,445	0.33
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	4,713,849	355,848,461	4,748,000	358,426,520	0.08
	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	94	イギリスポンド	5,663,392.5	770,731,085	5,518,740	751,045,326	0.18

(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	9,170,000.00	966,587,500	970,094,300	0.23
	カナダドル	買建	390,000.00	30,743,310	30,817,800	0.01
	ユーロ	買建	1,700,000.00	210,059,900	211,089,000	0.05
	イギリスポンド	買建	350,000.00	47,473,650	47,628,000	0.01
	スイスフラン	買建	330,000.00	37,633,200	37,963,200	0.01
	オーストラリアドル	買建	350,000.00	26,146,400	26,418,000	0.01

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	123,020,685,545	42.93
	フランス	29,709,572,561	10.37
	イタリア	26,611,563,323	9.29
	ドイツ	21,607,141,026	7.54
	イギリス	18,407,782,676	6.42
	スペイン	17,085,223,333	5.96
	ベルギー	7,363,022,418	2.57
	オーストラリア	6,805,394,191	2.37
	オランダ	5,410,472,609	1.89
	カナダ	5,366,218,132	1.87
	オーストリア	4,495,882,095	1.57
	アイルランド	2,322,533,706	0.81
	メキシコ	2,061,535,300	0.72
	ポーランド	1,788,377,597	0.62
	フィンランド	1,725,795,195	0.60
	デンマーク	1,510,852,948	0.53
	マレーシア	1,418,545,499	0.50
	シンガポール	1,261,245,603	0.44
	イスラエル	1,111,830,529	0.39
	スウェーデン	883,020,473	0.31
	ノルウェー	587,913,665	0.21
	小計	280,554,608,424	97.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,006,070,296	2.10

合計(純資産総額)	286,560,678,720	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	1,535,620,037	0.54
	買建	ドイツ	2,022,568,499	0.71

(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		3,501,011,400	1.22

(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 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,531.87	1,484,994,178	10,579.17	1,491,663,461	0.625	2030/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	12,750,000	11,503.63	1,466,713,335	11,549.55	1,472,568,628	1.625	2029/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	11,502.44	1,437,805,469	11,474.34	1,434,292,578	2.375	2024/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	12,150,000	10,951.53	1,330,612,094	10,915.17	1,326,193,291	1.625	2022/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,924.81	1,281,917,853	11,947.13	1,284,316,945	2.375	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,371.98	1,235,961,551	12,390.99	1,237,860,749	2.625	2029/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	9,500,000	12,591.25	1,196,169,510	12,722.45	1,208,632,750	2.250	2049/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,595.43	1,185,053,151	11,632.21	1,188,812,282	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,487.97	1,166,029,856	11,468.96	1,164,100,251	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/48	7,300,000	15,403.81	1,124,478,769	15,549.29	1,135,098,444	3.375	2048/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000	22,388.34	1,081,357,192	23,455.21	1,132,886,948	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,512.50	1,116,115,279	12,520.76	1,116,852,573	2.875	2028/8/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,258.43	1,125,641,385	13,134.51	1,115,120,437	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.125% 09/30/21	10,300,000	10,854.83	1,118,047,695	10,791.39	1,111,513,517	2.125	2021/9/30	0.39

アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,042.04	1,104,204,849	10,992.04	1,099,204,138	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,887.89	1,088,789,451	10,853.38	1,085,338,551	1.500	2022/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,600.94	1,075,996,262	10,611.40	1,077,058,051	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,772.04	1,072,851,675	12,775.35	1,073,129,400	3.125	2028/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,740.55	1,074,055,975	10,709.15	1,070,915,038	1.250	2021/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,800.83	1,056,174,541	11,828.93	1,058,689,771	2.250	2027/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,912.27	1,042,122,560	10,865.99	1,037,702,104	1.750	2022/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,884.79	1,039,497,910	10,837.68	1,034,998,522	1.750	2022/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	7,000,000	14,464.01	1,012,481,207	14,611.14	1,022,780,176	3.000	2049/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,867.78	1,014,695,564	11,890.10	1,016,603,688	2.250	2027/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/31/26	8,600,000	11,629.32	1,000,121,616	11,653.29	1,002,183,058	2.125	2026/5/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,347.05	996,270,990	11,395.40	1,000,516,460	1.625	2026/11/30	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	7,500,000	12,993.29	974,497,350	13,184.49	988,837,387	2.500	2046/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000	15,594.71	966,872,254	15,866.25	983,707,893	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	10,967.24	987,052,006	10,918.68	982,681,560	1.875	2022/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.375% 11/15/49	7,500,000	13,089.30	981,697,696	13,062.16	979,662,543	2.375	2049/11/15	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	97.90
合計	97.90

(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	43	アメリカ ドル	5,417,789.2	573,202,097	5,423,710.83	573,828,606	0.20
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	27	アメリカ ドル	3,764,701.82	398,305,453	3,774,093.75	399,299,119	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	30	アメリカ ドル	5,292,651.25	559,962,502	5,316,562.5	562,492,312	0.20
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	21	ユーロ	2,358,399	292,842,404	2,358,405	292,843,149	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	28	ユーロ	3,785,292	470,019,707	3,787,840	470,336,092	0.16
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	58	ユーロ	10,108,112	1,255,124,267	10,142,460	1,259,389,258	0.44

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

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

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	14,490,000.00	1,532,661,611	1,532,752,200	0.53
	カナダドル	買建	2,180,000.00	174,142,084	172,263,600	0.06
	ユーロ	買建	12,360,000.00	1,540,336,437	1,534,741,200	0.54
	イギリスポンド	買建	1,920,000.00	260,427,200	261,254,400	0.09

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	18,920,731,651	25.55
	台湾	9,028,760,376	12.19
	韓国	8,800,534,635	11.89
	中国	8,481,416,438	11.46
	インド	6,030,587,783	8.15
	ブラジル	3,149,470,894	4.25
	南アフリカ	2,476,833,577	3.35
	サウジアラビア	2,008,841,463	2.71
	ロシア	1,833,341,720	2.48
	香港	1,595,928,055	2.16
	タイ	1,318,906,841	1.78
	マレーシア	1,255,083,089	1.70
	メキシコ	1,114,779,479	1.51
	インドネシア	908,842,850	1.23
	カタール	579,454,457	0.78
	バミューダ	558,324,355	0.75
	フィリピン	539,140,305	0.73
	ポーランド	469,035,336	0.63
	アラブ首長国連邦	413,182,673	0.56
	チリ	356,691,810	0.48
アメリカ	261,130,518	0.35	

	トルコ	233,174,018	0.31
	オランダ	220,049,116	0.30
	ハンガリー	135,968,883	0.18
	コロンビア	109,893,696	0.15
	ルクセンブルク	105,546,485	0.14
	ギリシャ	92,976,265	0.13
	エジプト	78,427,698	0.11
	チェコ	69,210,205	0.09
	ジャージー	61,189,874	0.08
	シンガポール	23,356,856	0.03
	ペルー	21,745,095	0.03
	パキスタン	16,448,303	0.02
	アルゼンチン	15,997,725	0.02
	マン島	14,195,201	0.02
	小計	71,299,197,725	96.30
投資信託受益証券	ブラジル	125,491,382	0.17
	メキシコ	24,524,402	0.03
	小計	150,015,784	0.20
投資証券	メキシコ	25,182,710	0.03
	南アフリカ	22,349,810	0.03
	小計	47,532,520	0.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,542,865,544	3.43
合計(純資産総額)		74,039,611,573	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,561,085,788	3.46

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

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

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		369,207,100	0.50

(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	202,071	20,551.11	4,152,785,030	29,299.19	5,920,517,431	8.00
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	616,200	4,621.65	2,847,863,361	6,900.07	4,251,826,215	5.74
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	2,652,389	1,124.21	2,981,852,109	1,568.84	4,161,173,959	5.62
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	513,828	4,753.33	2,442,398,664	5,284.56	2,715,354,896	3.67
ケイマン	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	382,700	1,823.22	697,747,521	3,202.29	1,225,516,383	1.66
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	306,633	2,057.18	630,799,519	3,255.32	998,189,304	1.35
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	46,871	13,739.43	643,981,176	18,502.93	867,251,184	1.17
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	91,224	4,014.39	366,209,015	7,951.92	725,406,680	0.98
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,247,620	88.01	901,984,935	68.38	700,798,865	0.95
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	632,500	1,267.58	801,748,361	1,084.49	685,941,506	0.93
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	1,463.04	534,778,425	0.72
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	59,004	7,524.08	443,951,056	7,627.20	450,035,309	0.61
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信 サービス	667,500	874.22	583,546,650	668.16	446,001,806	0.60
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	177,443	3,191.85	566,371,836	2,483.99	440,767,525	0.60
ブラジル	株式	VALE SA	素材	395,778	933.86	369,605,031	1,095.22	433,467,741	0.59
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・ 娯楽	8,789	33,790.54	296,985,099	47,690.40	419,150,996	0.57
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	88,980	3,922.51	349,025,562	4,585.40	408,008,892	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	29,357	13,128.92	385,425,971	12,968.96	380,729,876	0.51
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	1,333,248	324.40	432,511,027	280.27	373,682,749	0.50
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	160,804	1,465.73	235,695,452	2,220.40	357,049,202	0.48
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	296,934	1,554.75	461,660,958	1,192.36	354,054,006	0.48
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,464,515	79.30	512,678,059	54.46	352,080,113	0.48
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・ 娯楽	13,049	15,001.43	195,753,771	26,922.20	351,307,788	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	96,664	3,056.32	295,437,011	3,608.17	348,781,111	0.47

ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP-ADR	消費者サービス	40,978	4,818.39	197,448,175	7,906.43	323,989,853	0.44
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	136.49	151,451,459	273.68	303,678,102	0.41
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	657,360	820.26	539,207,024	450.49	296,138,314	0.40
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	4,819	29,132.90	140,391,493	59,383.20	286,167,641	0.39
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,635,200	44.96	388,242,093	32.62	281,710,447	0.38
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	541,702	701.40	379,952,070	517.72	280,451,314	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.34
		素材	6.73
		資本財	2.58
		商業・専門サービス	0.32
		運輸	1.32
		自動車・自動車部品	2.43
		耐久消費財・アパレル	1.27
		消費者サービス	1.67
		メディア・娯楽	9.16
		小売	13.60
		食品・生活必需品小売り	1.32
		食品・飲料・タバコ	3.44
		家庭用品・パーソナル用品	1.10
		ヘルスケア機器・サービス	1.23
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.97
		銀行	11.68
		各種金融	1.92
		保険	2.97
		不動産	2.18
		ソフトウェア・サービス	2.14
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.96		
電気通信サービス	3.19		
公益事業	1.92		
半導体・半導体製造装置	7.86		
		小計	96.30
投資信託受益証券			0.20
投資証券			0.06
合計			96.57

(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	452	アメリカドル	24,280,644	2,568,892,135	24,206,860	2,561,085,788	3.46

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,490,000.00	367,869,500	369,207,100	0.50

(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	5,710,057,902	9.74
	インドネシア	5,660,038,249	9.65
	タイ	5,325,187,820	9.08
	ブラジル	5,137,099,841	8.76
	ポーランド	4,874,777,052	8.31
	ロシア	4,618,345,648	7.87
	マレーシア	4,379,519,501	7.47
	南アフリカ	4,185,078,231	7.14
	中国	3,645,534,167	6.22
	コロンビア	3,279,530,900	5.59
	チェコ	2,620,451,901	4.47
	ハンガリー	2,164,985,698	3.69
	ペルー	1,912,071,968	3.26

	チリ	1,662,452,361	2.83
	トルコ	1,262,529,652	2.15
	フィリピン	118,110,765	0.20
	ウルグアイ	85,942,623	0.15
	ドミニカ共和国	83,400,848	0.14
	小計	56,725,115,127	96.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,929,282,507	3.29
合計(純資産総額)		58,654,397,634	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	91,700,000,000	3.42	3,136,947,901	3.49	3,202,030,484	9.850	2027/6/28	5.46
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	53,750,000	1,537.24	826,271,069	1,624.46	873,149,858	0.000	2023/7/1	1.49
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	115,000,000	694.48	798,661,294	725.75	834,619,688	10.500	2026/12/21	1.42
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	51,000,000	1,569.73	800,564,028	1,551.64	791,337,585	0.000	2024/1/1	1.35
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000	2,105.61	794,871,021	2,079.90	785,162,283	10.000	2023/1/1	1.34
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000	2,171.25	765,367,117	2,119.90	747,267,691	10.000	2025/1/1	1.27
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000	1,581.86	680,202,213	1,555.85	669,018,734	2.940	2024/10/17	1.14
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	104,800,000	534.53	560,197,101	558.00	584,787,269	8.500	2029/5/31	1.00
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	144,100,000	410.22	591,139,054	405.44	584,242,786	3.300	2038/6/17	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	111,400,000	493.85	550,152,910	517.89	576,937,570	8.000	2023/12/7	0.98
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,812.61	559,709,390	2,895.94	576,293,473	2.500	2023/1/25	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	494.63	537,416,164	525.04	570,459,611	7.500	2027/6/3	0.97
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	133,500,000	406.81	543,094,020	412.81	551,106,663	3.400	2036/6/17	0.94
中国	国債証券	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000	1,596.51	558,779,184	1,572.00	550,203,052	3.250	2026/6/6	0.94
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	93,900,000	579.71	544,350,142	569.28	534,558,028	8.000	2030/1/31	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	475.12	514,080,059	488.47	528,530,123	6.500	2022/6/9	0.90
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	1,686.08	481,378,144	1,804.19	515,098,293	0.000	2022/1/1	0.88
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000	2,236.57	535,659,114	2,123.50	508,578,920	10.000	2027/1/1	0.87
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	16,900,000	2,822.76	477,046,645	3,004.05	507,685,092	2.500	2026/7/25	0.87
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000	1,638.68	451,456,871	1,752.33	482,767,856	0.000	2022/7/1	0.82
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	401.10	458,457,985	407.53	465,806,904	3.650	2031/6/20	0.79

ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	2,943.77	443,037,539	3,094.78	465,765,730	2.750	2029/10/25	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	538.51	442,927,962	561.42	461,776,043	10.000	2024/12/5	0.79
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,950,000	2,816.72	421,099,640	3,014.02	450,597,096	2.500	2027/7/25	0.77
マレーシア	国債証券	MGS 4.059% 09/30/24	16,500,000	2,706.13	446,512,615	2,721.63	449,069,895	4.059	2024/9/30	0.77
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000	2,822.10	421,905,398	2,957.13	442,091,129	2.500	2024/4/25	0.75
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000	427.98	433,979,427	432.53	438,592,194	4.875	2029/6/22	0.75
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	15,650,000	2,677.20	418,982,510	2,783.63	435,638,396	3.885	2029/8/15	0.74
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	14,050,000	2,968.92	417,133,750	3,057.92	429,638,069	4.000	2023/10/25	0.73
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	546.51	488,035,662	479.95	428,600,931	8.750	2048/2/28	0.73

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.71
合計	96.71

(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。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	101,786,886,220	96.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,319,802,135	3.16
合計(純資産総額)		105,106,688,355	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,313,268,000	3.15

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,858	773,617.3	8,399,936,643	596,000	6,471,368,000	6.16
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,212	694,711.26	7,789,102,647	538,000	6,032,056,000	5.74
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,965	292,740.75	4,966,346,823	355,500	6,031,057,500	5.74
日本	投資証券	GLP投資法人	32,239	138,605.46	4,468,501,424	162,800	5,248,509,200	4.99
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	36,258	182,410.83	6,613,851,874	132,000	4,786,056,000	4.55
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,997	290,879.82	4,653,204,480	269,000	4,303,193,000	4.09
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	22,340	218,254.73	4,875,810,668	161,300	3,603,442,000	3.43
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,065	221,183.06	4,659,221,158	162,400	3,420,956,000	3.25
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,650	340,226.28	3,623,409,882	311,000	3,312,150,000	3.15
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	15,849	165,784.09	2,627,512,042	180,300	2,857,574,700	2.72
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	23,978	194,111.68	4,654,409,863	116,700	2,798,232,600	2.66
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	32,978	89,743.29	2,959,554,217	77,600	2,559,092,800	2.43
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,981	464,477.55	3,242,517,776	326,500	2,279,296,500	2.17
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,726	661,063.5	2,463,122,601	607,000	2,261,682,000	2.15
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	5,618	519,882.65	2,920,700,727	399,500	2,244,391,000	2.14
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,326	270,311.26	1,980,300,290	301,500	2,208,789,000	2.10
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,495	161,653.79	2,019,864,106	176,200	2,201,619,000	2.09
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,468	772,529.5	2,679,132,306	629,000	2,181,372,000	2.08
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	36,119	77,422.58	2,796,426,167	51,700	1,867,352,300	1.78
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,639	459,082.14	1,670,599,939	502,000	1,826,778,000	1.74
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,171	165,515.24	2,180,001,226	136,900	1,803,109,900	1.72
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,145	97,680.21	1,381,686,570	108,800	1,538,976,000	1.46
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,893	338,661.1	1,657,068,762	307,000	1,502,151,000	1.43
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	46,882	56,673.73	2,656,977,809	31,200	1,462,718,400	1.39
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,389	792,579.44	1,893,472,282	604,000	1,442,956,000	1.37
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,372	138,838.12	1,578,867,100	121,100	1,377,149,200	1.31
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,315	202,315.26	1,479,936,126	185,900	1,359,858,500	1.29

日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,721	445,839.68	1,658,969,449	358,000	1,332,118,000	1.27
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,642	442,218.64	1,610,560,286	356,500	1,298,373,000	1.24
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,404	170,938.1	1,778,439,992	122,900	1,278,651,600	1.22

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.84
合計	96.84

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,928	円	3,304,534,160	3,313,268,000	3.15

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	58,252,167,496	73.59
	オーストラリア	5,782,588,306	7.30
	イギリス	4,112,348,924	5.19
	シンガポール	3,551,178,678	4.49
	カナダ	1,492,820,404	1.89
	フランス	1,410,001,240	1.78
	香港	1,372,975,763	1.73
	ベルギー	1,114,111,886	1.41
	ニュージーランド	401,103,357	0.51
	スペイン	370,364,979	0.47
	ドイツ	228,126,986	0.29

	ガーンジー	161,404,646	0.20
	オランダ	131,092,825	0.17
	アイルランド	104,405,861	0.13
	韓国	60,347,910	0.08
	イスラエル	50,277,644	0.06
	マン島	18,869,042	0.02
	イタリア	12,335,371	0.02
	小計	78,626,521,318	99.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		535,247,109	0.68
合計(純資産総額)		79,161,768,427	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		173,047,100	0.22

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	498,936	9,139.18	4,559,869,570	10,538.73	5,258,155,783	6.64
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	59,811	59,886.06	3,581,845,691	80,774.06	4,831,177,781	6.10
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	181,786	13,227.67	2,404,605,589	15,607.61	2,837,246,082	3.58
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	102,798	21,975.61	2,259,049,642	23,372.27	2,402,623,434	3.04
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	282,311	7,820.05	2,207,687,720	5,766.09	1,627,833,457	2.06
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,116,874	1,067.42	1,192,183,250	1,372.40	1,532,807,036	1.94
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	233,464	7,411.42	1,730,300,628	6,464.37	1,509,200,012	1.91
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	95,226	20,687.20	1,969,959,517	15,607.61	1,486,250,841	1.88
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	207,008	13,868.72	2,870,936,336	6,770.14	1,401,473,555	1.77
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,381	16,200.42	1,286,005,781	16,920.59	1,343,173,672	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	231,806	8,238.45	1,909,722,455	5,405.32	1,252,986,072	1.58
香港	投資証券	LINK REIT	1,400,300	1,092.54	1,529,892,590	849.71	1,189,852,414	1.50
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	249,651	5,613.74	1,401,477,802	4,504.96	1,124,668,768	1.42
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	375,077	2,999.42	1,125,017,206	2,962.40	1,111,128,105	1.40

アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	360,061	3,294.61	1,186,261,291	2,861.88	1,030,454,975	1.30
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	797,070	1,141.79	910,090,621	1,267.27	1,010,102,963	1.28
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	86,316	10,950.29	945,186,094	11,345.99	979,340,645	1.24
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	65,722	15,571.64	1,023,399,587	14,842.68	975,490,746	1.23
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	247,782	3,620.47	897,088,784	3,910.36	968,918,804	1.22
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	76,458	13,502.19	1,032,350,902	12,202.97	933,014,833	1.18
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	43,602	30,920.04	1,348,176,020	21,117.67	920,773,083	1.16
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	356,655	2,442.92	871,280,346	2,474.66	882,600,576	1.11
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	94,598	13,418.61	1,269,374,047	8,493.62	803,479,843	1.01
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	116,158	8,334.92	968,168,102	6,890.75	800,416,203	1.01
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	113,082	6,880.17	778,023,837	6,522.57	737,585,261	0.93
アメリカ	投資証券	UDR INC	196,851	4,714.44	928,043,803	3,419.45	673,123,333	0.85
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	352,528	2,047.23	721,705,898	1,861.02	656,062,364	0.83
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	64,913	11,079.37	719,195,535	9,460.63	614,118,265	0.78
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,460,393	259.68	898,614,232	172.11	595,593,154	0.75
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	77,876	6,946.82	540,991,178	7,561.52	588,861,399	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 (%)
投資証券	99.32
合計	99.32

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,000,000.00	105,350,000	105,790,000	0.13
	ユーロ	買建	80,000.00	9,843,120	9,933,600	0.01
	イギリスポンド	買建	90,000.00	12,207,510	12,247,200	0.02
	オーストラリアドル	買建	240,000.00	17,928,960	18,115,200	0.02
	香港ドル	買建	900,000.00	12,234,600	12,276,000	0.02
	シンガポールドル	買建	190,000.00	14,599,030	14,685,100	0.02

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	31,991,684,118	99.75
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		80,624,623	0.25
合計（純資産総額）		32,072,308,741	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	売建		33,081,426,608	103.15

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 （％）
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	16,696,790	1,838.39	30,695,252,057	1,916.03	31,991,684,118	99.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.75
合計	99.75

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	312,708,447.00	33,080,462,704	33,081,426,608	103.15

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2017年11月30日
 作成基準日：2020年9月30日

基準価額・純資産の推移


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 10,732円

純資産総額 106.41億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年8月	0円
2019年8月	0円
2020年8月	0円
-	-
-	-

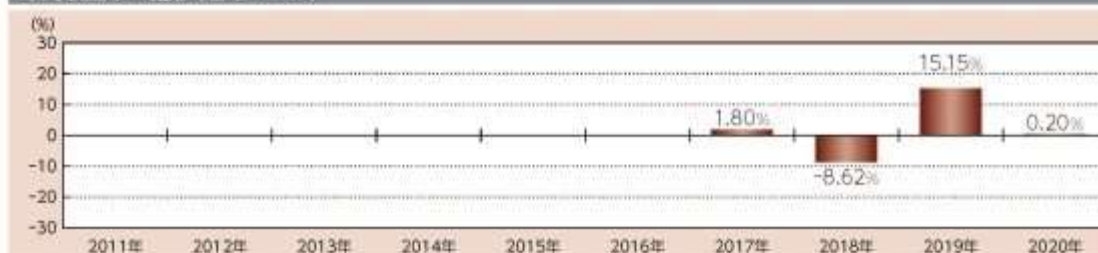
**設定来
分配金合計額** 0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率	
外国株式インデックスマザーファンド	23.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ウェアラブル機器	-	-	1.1%	
		MICROSOFT CORP.	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%	
外国債券インデックスマザーファンド	22.0%	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.1%	
		T 1.625% 08/15/29	アメリカ	国債	-	1.625%	2029/08/15	0.1%	
ゴールドマザーファンド (海替ヘッジあり)	16.2%	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	-	-	-	16.2%	
新興国株式インデックスマザーファンド	11.5%	ALIBABA GROUP HOLDINGS SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	0.9%	
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.7%	
新興国債券インデックスマザーファンド	10.4%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.6%	
		BLTN 0% 07/01/23	ブラジル	国債	-	0.000%	2023/07/01	0.2%	
J-REITインデックスマザーファンド	4.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%	
グローバルREITインデックスマザーファンド	4.1%	アジアリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%	
		PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.3%	
国内株式インデックスマザーファンド	3.7%	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.3%	
		トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%	
国内債券インデックスマザーファンド	2.8%	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.1%	
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	-	0.1%	2023/12/20	0.0%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	-	0.1%	2024/09/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


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

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】
1【申込（販売）手続等】
< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2017年11月30日（設定日）から2027年 8月20日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年11月30日から2018年8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え、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びそ

の内容を監督官庁に届け出ます。

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）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にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）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3期計算期間(2019年8月21日から2020年8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】

【グローバル経済コア】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2019年 8月20日現在)	第3期 (2020年 8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	169,064,818	136,218,018
親投資信託受益証券	12,651,925,042	10,922,074,855
未収入金	10,660,686	70,178,378
流動資産合計	12,831,650,546	11,128,471,251
資産合計	12,831,650,546	11,128,471,251
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,148,466	33,151,095
未払受託者報酬	3,370,986	2,943,437
未払委託者報酬	53,935,681	47,094,769
未払利息	364	231
その他未払費用	337,041	294,277
流動負債合計	85,792,538	83,483,809
負債合計	85,792,538	83,483,809
純資産の部		
元本等		
元本	12,719,497,109	10,151,427,698
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	26,360,899	893,559,744
(分配準備積立金)	337,823,036	780,557,747
元本等合計	12,745,858,008	11,044,987,442
純資産合計	12,745,858,008	11,044,987,442
負債純資産合計	12,831,650,546	11,128,471,251

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自 2018年 8月21日	至 2019年 8月20日	自 2019年 8月21日	至 2020年 8月20日
営業収益				
受取利息		76		567
有価証券売買等損益		644,793,864		1,127,113,231
営業収益合計		644,793,940		1,127,113,798
営業費用				
支払利息		121,114		66,128
受託者報酬		6,870,878		6,334,630
委託者報酬		109,933,834		101,353,815
その他費用		692,701		633,619
営業費用合計		117,618,527		108,388,192
営業利益又は営業損失()		527,175,413		1,018,725,606
経常利益又は経常損失()		527,175,413		1,018,725,606
当期純利益又は当期純損失()		527,175,413		1,018,725,606
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()		112,039,470		251,567,066
期首剰余金又は期首欠損金()		521,605,120		26,360,899
剰余金増加額又は欠損金減少額		193,999,234		133,916,905
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		193,999,234		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		133,916,905
剰余金減少額又は欠損金増加額		61,169,158		33,876,600
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		33,876,600
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		61,169,158		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		26,360,899		893,559,744

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第2期 (2019年 8月20日現在)	第3期 (2020年 8月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,719,497,109口	10,151,427,698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) 1.0021円 (10,021円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0880円 (10,880円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期 自 2018年 8月21日 至 2019年 8月20日	第3期 自 2019年 8月21日 至 2020年 8月20日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>245,108,236円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>55,865,657円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>92,714,800円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>393,688,693円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,719,497,109口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>309円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	245,108,236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	55,865,657円	分配準備積立金額	D	92,714,800円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	393,688,693円	当ファンドの期末残存口数	F	12,719,497,109口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	309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	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>199,754,456円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>377,447,638円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>115,677,802円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>203,355,653円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>896,235,549円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>10,151,427,698口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>882円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	199,754,456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	377,447,638円	収益調整金額	C	115,677,802円	分配準備積立金額	D	203,355,653円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	896,235,549円	当ファンドの期末残存口数	F	10,151,427,698口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	882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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	245,108,236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	55,865,657円																																																											
分配準備積立金額	D	92,714,800円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	393,688,693円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	12,719,497,109口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	309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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	199,754,456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	377,447,638円																																																											
収益調整金額	C	115,677,802円																																																											
分配準備積立金額	D	203,355,653円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	896,235,549円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,151,427,698口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	882円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 2019年 8月21日 至 2020年 8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3期 (2020年 8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2期	第3期
	自 2018年 8月21日 至 2019年 8月20日	自 2019年 8月21日 至 2020年 8月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,165,027,817円	12,719,497,109円
期中追加設定元本額	3,975,335,196円	3,287,324,947円
期中一部解約元本額	5,420,865,904円	5,855,394,358円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	(2019年 8月20日現在)	(2020年 8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	550,335,861	888,053,033
合計	550,335,861	888,053,033

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	276,096,707	474,278,923
	グローバルREITインデックス マザーファンド	282,338,708	453,379,497
	新興国株式インデックス マザーファンド	435,751,395	1,279,104,644
	国内株式インデックス マザーファンド	261,093,524	394,721,189
	外国株式インデックス マザーファンド	926,663,484	2,654,427,549
	国内債券インデックス マザーファンド	216,774,021	305,087,757
	外国債券インデックス マザーファンド	802,847,987	2,405,171,999
	新興国債券インデックス マザーファンド	699,960,184	1,153,814,367
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	1,310,800,793	1,802,088,930
合計		5,212,326,803	10,922,074,855

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,199,207,688
株式	326,737,392,360
派生商品評価勘定	58,687,400
未収入金	34,564,700
未収配当金	417,686,542
差入委託証拠金	81,400,000
流動資産合計	329,528,938,690
資産合計	329,528,938,690
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,463,550
前受金	56,244,200
未払解約金	169,624,670
未払利息	3,736

	2020年 8月20日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	228,336,156
負債合計	228,336,156
純資産の部	
元本等	
元本	217,825,843,779
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	111,474,758,755
元本等合計	329,300,602,534
純資産合計	329,300,602,534
負債純資産合計	329,528,938,690

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
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>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</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 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	217,825,843,779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 1.5118円 (1万口当たり純資産額) (15,118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 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
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 8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 8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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	204,872,395,529円
期中追加設定元本額	55,906,214,458円
期中一部解約元本額	42,952,766,208円
期末元本額	217,825,843,779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）	534,322,704円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,080,103,091円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,351,328円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,394,222,803円
世界経済インデックスファンド	2,335,633,574円
日本株式インデックス・オープン	4,045,217,511円
DCマイセレクション25	6,927,097,644円
DCマイセレクション50	19,533,030,804円
DCマイセレクション75	18,208,920,570円
DC日本株式インデックス・オープン	5,800,685,047円

区分	2020年 8月20日現在
DCマイセレクションS25	2,970,758,684円
DCマイセレクションS50	8,315,957,315円
DCマイセレクションS75	5,351,813,382円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,091,134,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	346,864,481円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	714,128,264円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	478,957,731円
DC世界経済インデックスファンド	2,964,951,006円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,060,485,924円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,332,333円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	34,140,400円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	31,881,137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）	260,124,427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）	67,199,210円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	247,078,531円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	53,440,067円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	262,455,557円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,478,949,170円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	654,089,120円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,752,007,387円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	626,409,918円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	39,822,658円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	693,361,865円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	33,884,049円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	402,083,286円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	506,292,181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）	828,789,835円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,453,815,279円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,950,265,255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）	7,132,578,799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）	336,427,056円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	356,043,614円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,476,493,092円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	209,147,080円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,675,866円
SMT インデックスバランス・オープン	66,805,916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

区分	2020年 8月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	25,064,891円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	81,838,533円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	14,374,035円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,087,266円
グローバル経済コア	261,093,524円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	19,327,287円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	46,608,922円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,065,249円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	815,925,174円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	118,092,882円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	228,391円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	303,371円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	105,800円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	129,051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）	49,860,085,460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）	1,847,124,468円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	70,191,452円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,378,445円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		6,938,243,176
合計		6,938,243,176

(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 8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	2,359,000,800	-	2,415,245,000	56,244,200
合計		2,359,000,800	-	2,415,245,000	56,244,200

(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	6,900	2,667.00	18,402,300	
日本水産	198,000	482.00	95,436,000	
マルハニチロ	28,600	2,276.00	65,093,600	
カネコ種苗	6,000	1,405.00	8,430,000	
サカタのタネ	23,600	3,445.00	81,302,000	
ホクト	15,100	2,145.00	32,389,500	
ホクリヨウ	3,100	639.00	1,980,900	
住石ホールディングス	40,000	117.00	4,680,000	
日鉄鉱業	4,500	4,210.00	18,945,000	
三井松島ホールディングス	7,700	731.00	5,628,700	
国際石油開発帝石	728,100	656.30	477,852,030	
石油資源開発	25,900	1,785.00	46,231,500	
K & O エナジーグループ	9,600	1,489.00	14,294,400	
ヒノキヤグループ	4,900	1,782.00	8,731,800	
ショーボンドホールディングス	30,800	5,130.00	158,004,000	
ミライト・ホールディングス	58,800	1,489.00	87,553,200	
タマホーム	10,700	1,245.00	13,321,500	
サンヨーホームズ	1,700	606.00	1,030,200	
日本アクア	7,900	610.00	4,819,000	
ファーストコーポレーション	6,000	602.00	3,612,000	
ベステラ	3,400	999.00	3,396,600	
T A T E R U	36,700	164.00	6,018,800	
キャンディル	3,300	648.00	2,138,400	
スペースバリューホールディングス	24,100	355.00	8,555,500	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	705.00	2,679,000	
第一カッター興業	2,400	2,298.00	5,515,200	
明豊ファシリティワークス	6,400	576.00	3,686,400	
安藤・間	117,900	673.00	79,346,700	
東急建設	58,000	472.00	27,376,000	
コムシスホールディングス	70,200	3,135.00	220,077,000	
ピーアールホールディングス	21,600	638.00	13,780,800	
高松コンストラクショングループ	12,300	2,218.00	27,281,400	
東建コーポレーション	6,100	6,610.00	40,321,000	

ソネック	2,000	820.00	1,640,000
ヤマウラ	8,600	806.00	6,931,600
大成建設	152,500	3,505.00	534,512,500
大林組	457,200	1,007.00	460,400,400
清水建設	464,000	794.00	368,416,000
飛島建設	13,100	1,090.00	14,279,000
長谷工コーポレーション	177,000	1,419.00	251,163,000
松井建設	18,000	699.00	12,582,000
銭高組	2,000	3,735.00	7,470,000
鹿島建設	358,900	1,311.00	470,517,900
不動テトラ	11,900	1,398.00	16,636,200
大末建設	5,300	845.00	4,478,500
鉄建建設	9,900	2,016.00	19,958,400
西松建設	35,200	1,978.00	69,625,600
三井住友建設	110,500	429.00	47,404,500
大豊建設	10,300	2,498.00	25,729,400
前田建設工業	114,500	757.00	86,676,500
佐田建設	9,800	411.00	4,027,800
ナカノフドー建設	12,500	369.00	4,612,500
奥村組	21,500	2,497.00	53,685,500
東鉄工業	19,600	2,626.00	51,469,600
イチケン	3,300	1,545.00	5,098,500
富士ピー・エス	6,700	567.00	3,798,900
浅沼組	5,100	4,145.00	21,139,500
戸田建設	189,900	685.00	130,081,500
熊谷組	21,200	2,612.00	55,374,400
北野建設	2,800	2,490.00	6,972,000
植木組	2,000	2,534.00	5,068,000
矢作建設工業	20,200	842.00	17,008,400
ピーエス三菱	15,000	560.00	8,400,000
日本ハウスホールディングス	31,200	252.00	7,862,400
大東建託	49,900	8,955.00	446,854,500
新日本建設	19,400	811.00	15,733,400
N I P P O	37,800	2,786.00	105,310,800
東亜道路工業	2,800	3,325.00	9,310,000
前田道路	40,400	1,975.00	79,790,000
日本道路	4,400	7,430.00	32,692,000
東亜建設工業	14,300	1,554.00	22,222,200
日本国土開発	44,500	574.00	25,543,000
若築建設	8,200	1,150.00	9,430,000
東洋建設	51,300	395.00	20,263,500
五洋建設	181,300	638.00	115,669,400

世紀東急工業	22,000	800.00	17,600,000
福田組	5,300	4,725.00	25,042,500
住友林業	115,800	1,584.00	183,427,200
日本基礎技術	15,400	401.00	6,175,400
巴コーポレーション	20,300	354.00	7,186,200
大和ハウス工業	452,400	2,725.00	1,232,790,000
ライト工業	26,200	1,569.00	41,107,800
積水ハウス	495,900	2,104.00	1,043,373,600
日特建設	11,900	771.00	9,174,900
北陸電気工事	7,900	991.00	7,828,900
ユアテック	26,200	606.00	15,877,200
日本リーテック	9,600	2,865.00	27,504,000
四電工	2,500	2,303.00	5,757,500
中電工	18,400	2,239.00	41,197,600
関電工	65,000	834.00	54,210,000
きんでん	108,600	1,708.00	185,488,800
東京エネシス	15,200	743.00	11,293,600
トーエネック	4,600	3,530.00	16,238,000
住友電設	12,900	2,262.00	29,179,800
日本電設工業	25,100	2,098.00	52,659,800
協和エクシオ	69,300	2,739.00	189,812,700
新日本空調	12,100	2,084.00	25,216,400
九電工	32,100	2,993.00	96,075,300
三機工業	33,000	1,143.00	37,719,000
日揮ホールディングス	140,700	1,180.00	166,026,000
中外炉工業	4,900	1,462.00	7,163,800
ヤマト	14,600	613.00	8,949,800
太平電業	11,000	2,212.00	24,332,000
高砂熱学工業	38,500	1,438.00	55,363,000
三晃金属工業	2,000	2,089.00	4,178,000
朝日工業社	3,100	2,879.00	8,924,900
明星工業	29,600	798.00	23,620,800
大気社	22,200	2,924.00	64,912,800
ダイダン	10,900	2,586.00	28,187,400
日比谷総合設備	14,700	1,778.00	26,136,600
フィル・カンパニー	2,600	1,645.00	4,277,000
OSJBホールディングス	72,100	226.00	16,294,600
東洋エンジニアリング	19,200	323.00	6,201,600
レイズネクスト	24,500	1,272.00	31,164,000
日本製粉	42,800	1,689.00	72,289,200
日清製粉グループ本社	165,300	1,725.00	285,142,500
日東富士製粉	1,100	5,990.00	6,589,000

昭和産業	13,400	3,515.00	47,101,000
鳥越製粉	13,000	900.00	11,700,000
中部飼料	17,900	1,570.00	28,103,000
フィード・ワン	98,300	192.00	18,873,600
東洋精糖	2,500	1,228.00	3,070,000
日本甜菜製糖	7,600	1,692.00	12,859,200
三井製糖	12,800	1,930.00	24,704,000
塩水港精糖	15,800	234.00	3,697,200
日新製糖	6,900	1,747.00	12,054,300
森永製菓	34,300	3,975.00	136,342,500
中村屋	3,800	4,050.00	15,390,000
江崎グリコ	40,300	4,710.00	189,813,000
名糖産業	7,000	1,455.00	10,185,000
井村屋グループ	8,300	2,436.00	20,218,800
不二家	9,300	2,130.00	19,809,000
山崎製パン	109,700	1,753.00	192,304,100
第一屋製パン	2,800	970.00	2,716,000
モロゾフ	2,500	5,250.00	13,125,000
亀田製菓	8,300	5,320.00	44,156,000
寿スピリッツ	14,100	4,135.00	58,303,500
カルビー	66,700	3,330.00	222,111,000
森永乳業	27,100	5,170.00	140,107,000
六甲バター	9,700	1,717.00	16,654,900
ヤクルト本社	100,700	6,190.00	623,333,000
明治ホールディングス	96,800	8,680.00	840,224,000
雪印メグミルク	35,200	2,438.00	85,817,600
プリマハム	22,900	3,015.00	69,043,500
日本ハム	55,900	4,900.00	273,910,000
林兼産業	4,800	556.00	2,668,800
丸大食品	15,600	1,808.00	28,204,800
S Foods	11,700	2,959.00	34,620,300
柿安本店	5,100	2,480.00	12,648,000
伊藤ハム米久ホールディングス	94,200	677.00	63,773,400
サッポロホールディングス	49,900	1,863.00	92,963,700
アサヒグループホールディングス	306,500	3,601.00	1,103,706,500
キリンホールディングス	620,600	2,097.00	1,301,398,200
宝ホールディングス	108,500	996.00	108,066,000
オエノンホールディングス	41,600	419.00	17,430,400
養命酒製造	4,500	1,764.00	7,938,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	112,000	1,708.00	191,296,000
サントリー食品インターナショナル	97,900	3,865.00	378,383,500
ダイドーグループホールディングス	7,500	4,785.00	35,887,500

伊藤園	44,400	6,280.00	278,832,000
キーコーヒー	14,400	2,103.00	30,283,200
ユニカフェ	4,400	938.00	4,127,200
ジャパンフーズ	2,100	1,207.00	2,534,700
日清オイリオグループ	18,800	3,195.00	60,066,000
不二製油グループ本社	35,700	3,000.00	107,100,000
かどや製油	1,600	3,710.00	5,936,000
J・オイルミルズ	7,600	3,760.00	28,576,000
キッコーマン	105,300	5,690.00	599,157,000
味の素	323,200	1,986.00	641,875,200
キューピー	81,500	2,026.00	165,119,000
ハウス食品グループ本社	54,700	3,500.00	191,450,000
カゴメ	59,800	3,275.00	195,845,000
焼津水産化学工業	7,100	907.00	6,439,700
アリアケジャパン	13,400	7,320.00	98,088,000
ピエトロ	1,900	1,659.00	3,152,100
エバラ食品工業	3,600	2,195.00	7,902,000
やまみ	1,300	2,022.00	2,628,600
ニチレイ	69,700	2,900.00	202,130,000
東洋水産	75,300	6,330.00	476,649,000
イトアンド	5,100	1,819.00	9,276,900
大冷	1,900	2,150.00	4,085,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	910.00	7,371,000
日清食品ホールディングス	62,200	10,760.00	669,272,000
永谷園ホールディングス	7,100	2,242.00	15,918,200
一正蒲鉾	5,700	1,043.00	5,945,100
フジッコ	15,800	2,011.00	31,773,800
ロック・フィールド	15,800	1,260.00	19,908,000
日本たばこ産業	784,600	2,009.50	1,576,653,700
ケンコーマヨネーズ	8,200	1,737.00	14,243,400
わらべや日洋ホールディングス	9,600	1,526.00	14,649,600
なとり	8,200	1,950.00	15,990,000
イフジ産業	2,500	846.00	2,115,000
ピククルスコーポレーション	3,200	2,726.00	8,723,200
北の達人コーポレーション	51,100	524.00	26,776,400
ユーグレナ	63,100	747.00	47,135,700
ミヨシ油脂	5,100	1,125.00	5,737,500
理研ビタミン	13,800	2,211.00	30,511,800
片倉工業	19,500	1,144.00	22,308,000
ゲンゼ	10,600	3,690.00	39,114,000
東洋紡	56,700	1,478.00	83,802,600
ユニチカ	43,000	366.00	15,738,000

富士紡ホールディングス	7,000	3,500.00	24,500,000
倉敷紡績	14,400	1,958.00	28,195,200
シキボウ	7,500	979.00	7,342,500
日本毛織	47,400	942.00	44,650,800
トーア紡コーポレーション	5,700	450.00	2,565,000
帝国繊維	16,300	2,555.00	41,646,500
帝人	116,800	1,663.00	194,238,400
東レ	1,034,800	494.30	511,501,640
サカイオーベックス	4,000	2,100.00	8,400,000
住江織物	3,100	1,706.00	5,288,600
日本フェルト	9,100	456.00	4,149,600
イチカワ	2,400	1,302.00	3,124,800
日東製網	1,700	1,389.00	2,361,300
アツギ	12,100	496.00	6,001,600
ダイニック	5,400	743.00	4,012,200
セーレン	35,500	1,223.00	43,416,500
ソトー	5,900	946.00	5,581,400
東海染工	2,100	1,110.00	2,331,000
小松マテーレ	23,700	763.00	18,083,100
ワコールホールディングス	35,700	1,822.00	65,045,400
ホギメディカル	16,300	3,310.00	53,953,000
T S Iホールディングス	43,900	325.00	14,267,500
マツオカコーポレーション	4,200	1,950.00	8,190,000
ワールド	20,400	1,634.00	33,333,600
三陽商会	7,400	591.00	4,373,400
ナイガイ	5,700	358.00	2,040,600
オンワードホールディングス	86,400	285.00	24,624,000
ルックホールディングス	5,100	731.00	3,728,100
ゴールドウイン	25,900	6,980.00	180,782,000
デサント	28,000	1,816.00	50,848,000
キング	7,100	541.00	3,841,100
ヤマトインターナショナル	13,100	374.00	4,899,400
特種東海製紙	9,100	4,630.00	42,133,000
王子ホールディングス	596,900	463.00	276,364,700
日本製紙	63,100	1,349.00	85,121,900
三菱製紙	16,200	327.00	5,297,400
北越コーポレーション	85,100	356.00	30,295,600
中越パルプ工業	6,000	1,468.00	8,808,000
巴川製紙所	4,200	838.00	3,519,600
大王製紙	63,000	1,449.00	91,287,000
阿波製紙	3,700	491.00	1,816,700
レンゴー	135,000	798.00	107,730,000

トーマック	8,800	1,622.00	14,273,600
ザ・パック	10,800	2,663.00	28,760,400
クラレ	224,900	1,095.00	246,265,500
旭化成	946,500	870.00	823,455,000
共和レザー	7,800	550.00	4,290,000
昭和電工	108,400	2,106.00	228,290,400
住友化学	1,049,100	347.00	364,037,700
住友精化	6,300	3,605.00	22,711,500
日産化学	79,300	5,370.00	425,841,000
ラサ工業	5,000	1,644.00	8,220,000
クレハ	12,200	4,540.00	55,388,000
多木化学	5,600	5,950.00	33,320,000
テイカ	10,500	1,303.00	13,681,500
石原産業	25,600	705.00	18,048,000
片倉コープアグリ	3,700	1,218.00	4,506,600
日本曹達	21,100	2,986.00	63,004,600
東ソー	220,700	1,463.00	322,884,100
トクヤマ	41,200	2,500.00	103,000,000
セントラル硝子	29,200	2,015.00	58,838,000
東亜合成	89,600	1,031.00	92,377,600
大阪ソーダ	14,500	2,467.00	35,771,500
関東電化工業	33,900	744.00	25,221,600
デンカ	52,100	2,885.00	150,308,500
信越化学工業	245,200	12,790.00	3,136,108,000
日本カーバイド工業	5,000	1,160.00	5,800,000
堺化学工業	9,200	1,964.00	18,068,800
第一稀元素化学工業	15,500	732.00	11,346,000
エア・ウォーター	132,800	1,417.00	188,177,600
大陽日酸	137,200	1,823.00	250,115,600
日本化学工業	4,400	2,218.00	9,759,200
東邦アセチレン	2,100	1,263.00	2,652,300
日本パーカライジング	72,000	1,037.00	74,664,000
高压ガス工業	22,600	784.00	17,718,400
チタン工業	1,800	1,710.00	3,078,000
四国化成工業	20,900	1,079.00	22,551,100
戸田工業	3,300	2,179.00	7,190,700
ステラ ケミファ	7,800	2,624.00	20,467,200
保土谷化学工業	5,300	5,030.00	26,659,000
日本触媒	22,200	5,420.00	120,324,000
大日精化工業	12,600	2,092.00	26,359,200
カネカ	36,900	2,669.00	98,486,100
三菱瓦斯化学	132,800	1,845.00	245,016,000

三井化学	132,500	2,391.00	316,807,500
J S R	133,100	2,276.00	302,935,600
東京応化工業	24,500	5,130.00	125,685,000
大阪有機化学工業	13,200	2,586.00	34,135,200
三菱ケミカルホールディングス	954,600	606.50	578,964,900
K Hネオケム	23,500	2,200.00	51,700,000
ダイセル	185,900	721.00	134,033,900
住友ベークライト	22,400	2,733.00	61,219,200
積水化学工業	302,000	1,650.00	498,300,000
日本ゼオン	128,800	1,089.00	140,263,200
アイカ工業	42,800	3,615.00	154,722,000
宇部興産	72,100	1,851.00	133,457,100
積水樹脂	25,700	2,143.00	55,075,100
タキロンシーアイ	30,900	698.00	21,568,200
旭有機材	8,100	1,265.00	10,246,500
ニチバン	7,500	1,507.00	11,302,500
リケンテクノス	35,900	395.00	14,180,500
大倉工業	6,700	1,518.00	10,170,600
積水化成成品工業	19,100	528.00	10,084,800
群栄化学工業	3,300	2,386.00	7,873,800
タイガースポリマー	7,500	431.00	3,232,500
ミライアル	5,000	1,001.00	5,005,000
ダイキアクシス	5,100	875.00	4,462,500
ダイキョーニシカワ	30,100	530.00	15,953,000
竹本容器	5,100	905.00	4,615,500
森六ホールディングス	7,700	1,605.00	12,358,500
日本化薬	88,400	1,048.00	92,643,200
カーリットホールディングス	15,200	478.00	7,265,600
日本精化	11,500	1,535.00	17,652,500
扶桑化学工業	14,500	3,570.00	51,765,000
トリケミカル研究所	3,200	9,780.00	31,296,000
A D E K A	65,700	1,498.00	98,418,600
日油	53,800	4,200.00	225,960,000
新日本理化	23,600	159.00	3,752,400
ハリマ化成グループ	11,800	912.00	10,761,600
花王	349,100	8,185.00	2,857,383,500
第一工業製薬	5,300	4,320.00	22,896,000
石原ケミカル	3,900	1,991.00	7,764,900
日華化学	4,800	890.00	4,272,000
ニイタカ	3,000	3,405.00	10,215,000
三洋化成工業	8,500	4,765.00	40,502,500
有機合成薬品工業	10,900	331.00	3,607,900

大日本塗料	16,100	870.00	14,007,000
日本ペイントホールディングス	117,800	7,970.00	938,866,000
関西ペイント	160,400	2,371.00	380,308,400
神東塗料	11,200	163.00	1,825,600
中国塗料	40,600	988.00	40,112,800
日本特殊塗料	10,700	911.00	9,747,700
藤倉化成	19,300	482.00	9,302,600
太陽ホールディングス	10,500	5,430.00	57,015,000
D I C	60,300	2,529.00	152,498,700
サカタインクス	31,200	990.00	30,888,000
東洋インキＳＣホールディングス	30,200	1,920.00	57,984,000
T & K T O K A	11,100	730.00	8,103,000
富士フィルムホールディングス	279,500	4,972.00	1,389,674,000
資生堂	289,700	5,776.00	1,673,307,200
ライオン	189,600	2,355.00	446,508,000
高砂香料工業	9,100	1,990.00	18,109,000
マンダム	32,800	1,681.00	55,136,800
ミルボン	19,500	5,740.00	111,930,000
ファンケル	59,000	3,250.00	191,750,000
コーセー	27,400	12,070.00	330,718,000
コタ	8,400	1,205.00	10,122,000
シーボン	1,900	1,826.00	3,469,400
ポーラ・オルビスホールディングス	62,200	1,898.00	118,055,600
ノエビアホールディングス	12,400	4,765.00	59,086,000
アジュバンコスメジャパン	3,300	960.00	3,168,000
エステー	9,400	2,086.00	19,608,400
アグロ カネショウ	5,500	1,504.00	8,272,000
コニシ	24,000	1,439.00	34,536,000
長谷川香料	25,100	2,148.00	53,914,800
星光P M C	8,300	648.00	5,378,400
小林製薬	40,900	9,320.00	381,188,000
荒川化学工業	13,100	1,191.00	15,602,100
メック	10,000	1,830.00	18,300,000
日本高純度化学	4,000	2,600.00	10,400,000
タカラバイオ	38,200	2,979.00	113,797,800
J C U	17,700	3,445.00	60,976,500
新田ゼラチン	9,100	672.00	6,115,200
O A T アグリオ	2,800	1,052.00	2,945,600
デクセリアルズ	37,700	981.00	36,983,700
アース製薬	10,100	7,690.00	77,669,000
北興化学工業	13,600	636.00	8,649,600
大成ラミック	4,800	2,774.00	13,315,200

クミアイ化学工業	60,300	1,058.00	63,797,400
日本農薬	26,000	520.00	13,520,000
アキレス	10,100	1,847.00	18,654,700
有沢製作所	23,100	842.00	19,450,200
日東電工	100,600	6,330.00	636,798,000
レック	15,500	1,670.00	25,885,000
三光合成	16,700	258.00	4,308,600
きもと	24,800	155.00	3,844,000
藤森工業	13,100	3,820.00	50,042,000
前澤化成工業	9,300	1,000.00	9,300,000
未来工業	7,800	1,899.00	14,812,200
ウェーブロックホールディングス	5,000	795.00	3,975,000
J S P	8,500	1,576.00	13,396,000
エフピコ	16,000	8,310.00	132,960,000
天馬	9,700	1,887.00	18,303,900
信越ポリマー	26,200	858.00	22,479,600
東リ	36,300	248.00	9,002,400
ニフコ	53,500	2,646.00	141,561,000
バルカー	11,800	1,825.00	21,535,000
ユニ・チャーム	309,100	4,651.00	1,437,624,100
ショーエイコーポレーション	2,200	1,154.00	2,538,800
協和キリン	146,700	2,771.00	406,505,700
武田薬品工業	1,213,000	4,023.00	4,879,899,000
アステラス製薬	1,264,100	1,712.50	2,164,771,250
大日本住友製薬	108,100	1,383.00	149,502,300
塩野義製薬	183,400	6,250.00	1,146,250,000
わかもと製薬	17,300	262.00	4,532,600
あすか製薬	16,600	1,196.00	19,853,600
日本新薬	38,200	9,200.00	351,440,000
バイオフェルミン製薬	2,500	2,401.00	6,002,500
中外製薬	456,000	4,862.00	2,217,072,000
科研製薬	25,000	5,080.00	127,000,000
エーザイ	174,500	9,359.00	1,633,145,500
ロート製薬	74,800	3,520.00	263,296,000
小野薬品工業	334,800	3,298.00	1,104,170,400
久光製薬	38,600	5,000.00	193,000,000
持田製薬	20,200	3,955.00	79,891,000
参天製薬	271,700	2,019.00	548,562,300
扶桑薬品工業	5,100	2,661.00	13,571,100
日本ケミファ	1,900	2,411.00	4,580,900
ツムラ	45,200	2,971.00	134,289,200
日医工	41,300	1,200.00	49,560,000

キッセイ薬品工業	25,800	2,379.00	61,378,200
生化学工業	28,300	1,045.00	29,573,500
栄研化学	25,600	1,862.00	47,667,200
日水製薬	6,100	1,111.00	6,777,100
鳥居薬品	9,100	2,882.00	26,226,200
JCRファーマ	10,300	12,000.00	123,600,000
東和薬品	18,700	2,162.00	40,429,400
富士製薬工業	9,900	1,116.00	11,048,400
沢井製薬	29,900	5,360.00	160,264,000
ゼリア新薬工業	26,400	1,917.00	50,608,800
第一三共	417,200	9,600.00	4,005,120,000
キョーリン製薬ホールディングス	32,200	2,015.00	64,883,000
大幸薬品	17,800	2,873.00	51,139,400
ダイト	9,000	3,530.00	31,770,000
大塚ホールディングス	303,000	4,619.00	1,399,557,000
大正製薬ホールディングス	30,800	6,550.00	201,740,000
ペプチドリーム	74,100	4,370.00	323,817,000
日本コークス工業	123,200	63.00	7,761,600
ニチレキ	17,200	1,623.00	27,915,600
ユシロ化学工業	8,200	1,300.00	10,660,000
ビーピー・カストロール	5,200	1,120.00	5,824,000
富士石油	38,900	187.00	7,274,300
MORESCO	5,300	999.00	5,294,700
出光興産	161,800	2,339.00	378,450,200
ENEOSホールディングス	2,193,300	410.30	899,910,990
コスモエネルギーホールディングス	42,200	1,630.00	68,786,000
横浜ゴム	84,400	1,622.00	136,896,800
TOYO TIRE	76,700	1,718.00	131,770,600
ブリヂストン	387,700	3,299.00	1,279,022,300
住友ゴム工業	131,000	988.00	129,428,000
藤倉コンポジット	12,700	339.00	4,305,300
オカモト	8,900	4,285.00	38,136,500
フコク	6,400	631.00	4,038,400
ニッタ	16,400	2,288.00	37,523,200
住友理工	28,300	546.00	15,451,800
三ツ星ベルト	19,200	1,662.00	31,910,400
バンドー化学	25,600	617.00	15,795,200
日東紡績	21,700	4,000.00	86,800,000
AGC	133,900	2,980.00	399,022,000
日本板硝子	69,800	402.00	28,059,600
石塚硝子	2,700	1,779.00	4,803,300
日本山村硝子	6,100	842.00	5,136,200

日本電気硝子	54,100	1,851.00	100,139,100
オハラ	5,800	1,026.00	5,950,800
住友大阪セメント	27,600	3,440.00	94,944,000
太平洋セメント	92,100	2,430.00	223,803,000
日本ヒューム	14,700	743.00	10,922,100
日本コンクリート工業	31,600	275.00	8,690,000
三谷セキサン	6,800	6,080.00	41,344,000
アジアパイルホールディングス	20,900	473.00	9,885,700
東海カーボン	142,600	940.00	134,044,000
日本カーボン	8,100	3,305.00	26,770,500
東洋炭素	8,600	1,649.00	14,181,400
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	3,190.00	25,839,000
TOTO	104,200	4,620.00	481,404,000
日本碍子	175,100	1,507.00	263,875,700
日本特殊陶業	110,900	1,799.00	199,509,100
MARUWA	5,600	8,690.00	48,664,000
品川リフラクトリーズ	3,900	2,192.00	8,548,800
黒崎播磨	2,900	3,180.00	9,222,000
ヨータイ	11,700	712.00	8,330,400
イソライト工業	7,700	415.00	3,195,500
東京窯業	18,800	301.00	5,658,800
ニッカトー	6,700	641.00	4,294,700
フジインコーポレーテッド	13,000	3,650.00	47,450,000
クニミネ工業	6,000	960.00	5,760,000
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,000.00	2,500,000
ニチアス	39,900	2,412.00	96,238,800
ニチハ	20,300	2,422.00	49,166,600
日本製鉄	645,300	1,008.50	650,785,050
神戸製鋼所	264,000	397.00	104,808,000
中山製鋼所	20,200	346.00	6,989,200
合同製鐵	7,800	1,898.00	14,804,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	389,500	781.00	304,199,500
東京製鐵	70,300	690.00	48,507,000
共英製鋼	16,300	1,278.00	20,831,400
大和工業	30,700	2,557.00	78,499,900
東京鐵鋼	6,000	1,521.00	9,126,000
大阪製鐵	7,700	1,088.00	8,377,600
淀川製鋼所	19,500	1,910.00	37,245,000
丸一鋼管	46,800	2,817.00	131,835,600
モリ工業	4,300	2,222.00	9,554,600
大同特殊鋼	23,600	3,375.00	79,650,000
日本高周波鋼業	5,500	340.00	1,870,000

日本冶金工業	12,000	1,510.00	18,120,000
山陽特殊製鋼	9,900	894.00	8,850,600
愛知製鋼	8,100	2,572.00	20,833,200
日立金属	155,400	1,624.00	252,369,600
日本金属	3,300	543.00	1,791,900
大太平洋金属	9,800	1,682.00	16,483,600
新日本電工	93,300	189.00	17,633,700
栗本鐵工所	7,100	1,814.00	12,879,400
虹技	2,200	1,241.00	2,730,200
三菱製鋼	10,800	556.00	6,004,800
日亜鋼業	21,300	279.00	5,942,700
日本精線	2,400	3,080.00	7,392,000
エンビプロ・ホールディングス	6,200	516.00	3,199,200
シンニッタン	22,700	213.00	4,835,100
新家工業	3,300	1,027.00	3,389,100
大紀アルミニウム工業所	24,000	525.00	12,600,000
日本軽金属ホールディングス	365,500	192.00	70,176,000
三井金属鉱業	39,000	2,499.00	97,461,000
東邦亜鉛	7,500	1,763.00	13,222,500
三菱マテリアル	95,300	2,215.00	211,089,500
住友金属鉱山	184,300	3,283.00	605,056,900
D O W Aホールディングス	36,500	3,220.00	117,530,000
古河機械金属	25,800	1,044.00	26,935,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	900.00	13,590,000
東邦チタニウム	26,000	673.00	17,498,000
U A C J	21,900	1,902.00	41,653,800
C Kサンエツ	3,100	3,180.00	9,858,000
古河電気工業	44,800	2,447.00	109,625,600
住友電気工業	539,200	1,249.50	673,730,400
フジクラ	174,100	307.00	53,448,700
昭和電線ホールディングス	16,900	1,115.00	18,843,500
東京特殊電線	2,200	2,258.00	4,967,600
タツタ電線	28,800	575.00	16,560,000
カナレ電気	2,500	1,607.00	4,017,500
平河ヒューテック	7,300	924.00	6,745,200
リョービ	17,800	1,130.00	20,114,000
アーレスティ	19,300	323.00	6,233,900
アサヒホールディングス	25,300	3,550.00	89,815,000
稲葉製作所	8,100	1,296.00	10,497,600
宮地エンジニアリンググループ	4,400	1,615.00	7,106,000
トーカロ	40,100	1,098.00	44,029,800
アルファC o	5,100	931.00	4,748,100

SUMCO	184,500	1,464.00	270,108,000
川田テクノロジーズ	2,900	4,475.00	12,977,500
RS Technologies	4,700	3,485.00	16,379,500
信和	8,300	682.00	5,660,600
東洋製罐グループホールディングス	91,800	1,187.00	108,966,600
ホッカンホールディングス	7,900	1,496.00	11,818,400
コロナ	8,000	984.00	7,872,000
横河ブリッジホールディングス	26,800	1,852.00	49,633,600
駒井ハルテック	2,700	1,335.00	3,604,500
高田機工	1,300	2,310.00	3,003,000
三和ホールディングス	135,900	966.00	131,279,400
文化シャッター	42,500	715.00	30,387,500
三協立山	18,600	880.00	16,368,000
アルインコ	10,500	913.00	9,586,500
東洋シャッター	3,500	711.00	2,488,500
LIXILグループ	212,700	1,724.00	366,694,800
日本フィルコン	10,000	530.00	5,300,000
ノーリツ	29,900	1,274.00	38,092,600
長府製作所	14,700	2,068.00	30,399,600
リンナイ	28,000	9,440.00	264,320,000
ダイニチ工業	7,800	668.00	5,210,400
日東精工	18,100	448.00	8,108,800
三洋工業	1,900	1,887.00	3,585,300
岡部	29,200	768.00	22,425,600
ジーテクト	17,900	996.00	17,828,400
東プレ	26,900	1,113.00	29,939,700
高周波熱錬	27,800	503.00	13,983,400
東京製綱	10,300	523.00	5,386,900
サンコール	10,800	389.00	4,201,200
モリテック スチール	11,200	292.00	3,270,400
パイオラックス	21,300	1,571.00	33,462,300
エイチワン	14,100	512.00	7,219,200
日本発條	154,700	647.00	100,090,900
中央発條	1,700	2,509.00	4,265,300
アドバネクス	2,100	1,373.00	2,883,300
立川ブラインド工業	6,300	1,197.00	7,541,100
三益半導体工業	11,200	2,029.00	22,724,800
日本ドライケミカル	3,600	1,522.00	5,479,200
日本製綱所	43,800	1,545.00	67,671,000
三浦工業	62,400	4,325.00	269,880,000
タクマ	48,900	1,671.00	81,711,900
ツガミ	30,000	1,040.00	31,200,000

オークマ	16,800	4,760.00	79,968,000
芝浦機械	16,400	2,053.00	33,669,200
アマダ	179,000	869.00	155,551,000
アイダエンジニアリング	37,900	679.00	25,734,100
滝澤鉄工所	4,500	1,006.00	4,527,000
F U J I	62,000	1,952.00	121,024,000
牧野フライス製作所	16,900	3,480.00	58,812,000
オーエスジー	71,200	1,490.00	106,088,000
ダイジェット工業	1,700	1,324.00	2,250,800
旭ダイヤモンド工業	38,100	468.00	17,830,800
D M G 森精機	91,300	1,270.00	115,951,000
ソディック	31,500	805.00	25,357,500
ディスコ	19,600	24,800.00	486,080,000
日東工器	7,900	1,925.00	15,207,500
日進工具	5,700	2,443.00	13,925,100
パンチ工業	13,200	399.00	5,266,800
富士ダイス	6,400	666.00	4,262,400
豊和工業	8,100	830.00	6,723,000
O K K	5,900	349.00	2,059,100
東洋機械金属	10,500	403.00	4,231,500
津田駒工業	2,800	764.00	2,139,200
エンシュウ	3,600	899.00	3,236,400
島精機製作所	22,800	1,438.00	32,786,400
オプトラン	18,100	2,221.00	40,200,100
N C ホールディングス	4,500	586.00	2,637,000
イワキポンプ	9,200	936.00	8,611,200
フリュー	14,200	1,057.00	15,009,400
ヤマシンフィルタ	31,400	1,250.00	39,250,000
日阪製作所	17,900	788.00	14,105,200
やまびこ	28,000	1,030.00	28,840,000
平田機工	6,800	6,110.00	41,548,000
ペガサスミシン製造	14,800	266.00	3,936,800
マルマエ	5,400	987.00	5,329,800
タツモ	6,200	1,448.00	8,977,600
ナプテスコ	85,000	3,230.00	274,550,000
三井海洋開発	15,400	1,721.00	26,503,400
レオン自動機	14,200	1,080.00	15,336,000
S M C	45,700	59,190.00	2,704,983,000
ホソカワミクロン	5,100	5,520.00	28,152,000
ユニオンツール	5,400	2,789.00	15,060,600
オイレス工業	18,700	1,399.00	26,161,300
日精エー・エス・ビー機械	4,200	3,535.00	14,847,000

サトーホールディングス	20,600	2,034.00	41,900,400
技研製作所	12,700	3,905.00	49,593,500
日本エアータック	4,700	1,269.00	5,964,300
カワタ	4,300	774.00	3,328,200
日精樹脂工業	12,300	830.00	10,209,000
オカダアイヨン	4,600	952.00	4,379,200
ワイエイシーホールディングス	6,200	619.00	3,837,800
小松製作所	660,400	2,214.50	1,462,455,800
住友重機械工業	83,500	2,508.00	209,418,000
日立建機	58,500	3,590.00	210,015,000
日工	20,200	649.00	13,109,800
巴工業	5,800	1,850.00	10,730,000
井関農機	14,700	1,149.00	16,890,300
TOWA	14,800	1,116.00	16,516,800
丸山製作所	3,100	1,243.00	3,853,300
北川鉄工所	6,700	1,380.00	9,246,000
ローツェ	6,400	5,080.00	32,512,000
タカキタ	5,200	635.00	3,302,000
クボタ	773,600	1,728.50	1,337,167,600
荏原実業	3,700	2,850.00	10,545,000
三菱化工機	5,100	1,796.00	9,159,600
月島機械	27,000	1,235.00	33,345,000
帝国電機製作所	12,100	1,125.00	13,612,500
新東工業	34,800	705.00	24,534,000
澁谷工業	12,800	2,942.00	37,657,600
アイチ コーポレーション	25,400	802.00	20,370,800
小森コーポレーション	37,200	703.00	26,151,600
鶴見製作所	11,300	1,844.00	20,837,200
住友精密工業	2,200	2,105.00	4,631,000
日本ギア工業	6,100	275.00	1,677,500
酒井重工業	2,800	2,316.00	6,484,800
荏原製作所	60,500	2,778.00	168,069,000
石井鐵工所	1,900	2,600.00	4,940,000
西島製作所	14,900	815.00	12,143,500
北越工業	15,100	1,083.00	16,353,300
ダイキン工業	185,800	19,255.00	3,577,579,000
オルガノ	5,300	5,520.00	29,256,000
トーヨーカネツ	6,400	2,320.00	14,848,000
栗田工業	78,900	3,230.00	254,847,000
椿本チエイン	20,900	2,496.00	52,166,400
大同工業	7,200	569.00	4,096,800
木村化工機	12,500	411.00	5,137,500

アネスト岩田	22,800	793.00	18,080,400
ダイフク	74,500	9,490.00	707,005,000
サムコ	3,700	2,673.00	9,890,100
加藤製作所	8,100	1,105.00	8,950,500
油研工業	2,600	1,407.00	3,658,200
タダノ	70,500	886.00	62,463,000
フジテック	53,000	2,098.00	111,194,000
C K D	40,000	1,590.00	63,600,000
キトー	11,100	1,106.00	12,276,600
平和	40,700	1,767.00	71,916,900
理想科学工業	12,900	1,292.00	16,666,800
S A N K Y O	32,500	2,841.00	92,332,500
日本金銭機械	16,200	558.00	9,039,600
マースグループホールディングス	9,300	1,632.00	15,177,600
フクシマガリレイ	9,000	3,430.00	30,870,000
オーイズミ	6,300	353.00	2,223,900
ダイコク電機	6,800	1,052.00	7,153,600
竹内製作所	24,400	2,071.00	50,532,400
アマノ	38,200	2,191.00	83,696,200
J U K I	20,300	453.00	9,195,900
蛇の目ミシン工業	13,400	634.00	8,495,600
マックス	22,300	1,588.00	35,412,400
グローリー	37,500	2,238.00	83,925,000
新晃工業	13,600	1,390.00	18,904,000
大和冷機工業	23,500	908.00	21,338,000
セガサミーホールディングス	144,700	1,250.00	180,875,000
日本ピストンリング	5,400	1,057.00	5,707,800
リケン	6,800	2,633.00	17,904,400
T P R	19,700	1,350.00	26,595,000
ツバキ・ナカシマ	28,000	782.00	21,896,000
ホシザキ	45,900	8,040.00	369,036,000
大豊工業	12,000	507.00	6,084,000
日本精工	274,600	800.00	219,680,000
N T N	337,400	200.00	67,480,000
ジェイテクト	139,900	826.00	115,557,400
不二越	13,600	3,215.00	43,724,000
日本トムソン	43,400	328.00	14,235,200
T H K	90,900	2,354.00	213,978,600
ユーシン精機	11,400	691.00	7,877,400
前澤給装工業	5,300	2,065.00	10,944,500
イーグル工業	18,100	731.00	13,231,100
前澤工業	9,900	440.00	4,356,000

日本ピラー工業	14,800	1,426.00	21,104,800
キット	59,200	630.00	37,296,000
マキタ	190,100	4,785.00	909,628,500
日立造船	116,000	407.00	47,212,000
三菱重工業	244,400	2,617.50	639,717,000
I H I	105,100	1,490.00	156,599,000
スター精密	22,500	1,302.00	29,295,000
日清紡ホールディングス	89,300	715.00	63,849,500
イビデン	89,400	3,465.00	309,771,000
コニカミノルタ	320,500	329.00	105,444,500
ブラザー工業	178,400	1,750.00	312,200,000
ミネベアミツミ	271,000	1,809.00	490,239,000
日立製作所	700,600	3,546.00	2,484,327,600
三菱電機	1,458,000	1,430.50	2,085,669,000
富士電機	87,900	3,175.00	279,082,500
東洋電機製造	5,400	1,094.00	5,907,600
安川電機	157,000	3,700.00	580,900,000
シンフォニアテクノロジー	19,000	1,033.00	19,627,000
明電舎	26,900	1,678.00	45,138,200
オリジン	4,000	1,213.00	4,852,000
山洋電気	7,200	4,895.00	35,244,000
デンヨー	12,500	2,037.00	25,462,500
東芝テック	18,300	4,395.00	80,428,500
芝浦メカトロニクス	2,800	2,859.00	8,005,200
マブチモーター	40,500	3,735.00	151,267,500
日本電産	351,000	8,753.00	3,072,303,000
トレックス・セミコンダクター	8,900	1,124.00	10,003,600
東光高岳	8,800	1,000.00	8,800,000
ダイヘン	16,000	3,895.00	62,320,000
ヤーマン	24,300	1,297.00	31,517,100
JVCケンウッド	123,000	152.00	18,696,000
ミマキエンジニアリング	14,800	379.00	5,609,200
I - P E X	7,100	1,928.00	13,688,800
日新電機	34,300	1,040.00	35,672,000
大崎電気工業	29,200	523.00	15,271,600
オムロン	130,700	7,710.00	1,007,697,000
日東工業	21,500	1,872.00	40,248,000
I D E C	21,100	1,691.00	35,680,100
正興電機製作所	4,100	998.00	4,091,800
不二電機工業	2,900	1,328.00	3,851,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	49,000	1,715.00	84,035,000
サクサホールディングス	3,500	1,307.00	4,574,500

メルコホールディングス	5,300	2,665.00	14,124,500
テクノメディカ	3,600	1,736.00	6,249,600
日本電気	176,900	5,570.00	985,333,000
富士通	140,600	13,820.00	1,943,092,000
沖電気工業	59,300	992.00	58,825,600
岩崎通信機	6,400	839.00	5,369,600
電気興業	7,100	2,338.00	16,599,800
サンケン電気	16,000	2,214.00	35,424,000
ナカヨ	2,900	1,321.00	3,830,900
アイホン	8,300	1,402.00	11,636,600
ルネサスエレクトロニクス	623,600	645.00	402,222,000
セイコーエプソン	181,000	1,221.00	221,001,000
ワコム	99,000	645.00	63,855,000
アルバック	26,800	3,620.00	97,016,000
アクセル	6,800	867.00	5,895,600
E I Z O	11,400	3,855.00	43,947,000
日本信号	37,200	1,004.00	37,348,800
京三製作所	34,400	479.00	16,477,600
能美防災	19,600	2,070.00	40,572,000
ホーチキ	11,100	1,162.00	12,898,200
星和電機	8,300	541.00	4,490,300
エレコム	16,500	5,230.00	86,295,000
パナソニック	1,665,800	940.00	1,565,852,000
シャープ	168,800	1,222.00	206,273,600
アンリツ	93,900	2,302.00	216,157,800
富士通ゼネラル	39,600	2,755.00	109,098,000
ソニー	913,300	8,354.00	7,629,708,200
T D K	70,400	11,130.00	783,552,000
帝国通信工業	7,000	1,164.00	8,148,000
タムラ製作所	49,000	469.00	22,981,000
アルプスアルパイン	129,500	1,515.00	196,192,500
池上通信機	4,600	778.00	3,578,800
鈴木	8,100	676.00	5,475,600
日本トリム	2,100	3,790.00	7,959,000
ローランド ディー . ジー .	9,100	1,187.00	10,801,700
フォスター電機	15,400	1,084.00	16,693,600
S M K	3,800	2,355.00	8,949,000
ヨコオ	9,700	2,711.00	26,296,700
ホシデン	40,500	902.00	36,531,000
ヒロセ電機	22,500	12,230.00	275,175,000
日本航空電子工業	33,500	1,286.00	43,081,000
T O A	15,800	731.00	11,549,800

マクセルホールディングス	32,000	1,001.00	32,032,000	
古野電気	19,400	946.00	18,352,400	
ユニデンホールディングス	4,100	1,546.00	6,338,600	
スマダコーポレーション	13,400	619.00	8,294,600	
アイコム	8,100	2,653.00	21,489,300	
リオン	6,400	2,176.00	13,926,400	
本多通信工業	14,000	411.00	5,754,000	
横河電機	133,800	1,662.00	222,375,600	
新電元工業	5,200	1,943.00	10,103,600	
アズビル	92,100	3,455.00	318,205,500	
東亜ディーケーケー	8,000	840.00	6,720,000	
日本光電工業	60,400	3,620.00	218,648,000	
チノー	5,100	1,340.00	6,834,000	
共和電業	15,500	416.00	6,448,000	
日本電子材料	5,800	1,788.00	10,370,400	
堀場製作所	28,900	5,980.00	172,822,000	
アドバンテスト	108,400	5,100.00	552,840,000	
小野測器	7,400	482.00	3,566,800	
エスベック	13,300	1,718.00	22,849,400	
キーエンス	132,100	44,430.00	5,869,203,000	
日置電機	7,200	3,320.00	23,904,000	
シスメックス	104,300	8,361.00	872,052,300	
日本マイクロニクス	25,900	1,129.00	29,241,100	
メガチップス	13,900	2,098.00	29,162,200	
O B A R A G R O U P	8,700	3,550.00	30,885,000	
澤藤電機	2,200	1,630.00	3,586,000	
原田工業	7,600	865.00	6,574,000	
コーセル	20,100	855.00	17,185,500	
イリソ電子工業	12,400	3,685.00	45,694,000	
オブテックスグループ	24,400	1,260.00	30,744,000	
千代田インテグレ	6,500	1,580.00	10,270,000	
アイ・オー・データ機器	5,300	1,055.00	5,591,500	
レーザーテック	64,100	8,460.00	542,286,000	
スタンレー電気	102,400	3,055.00	312,832,000	
岩崎電気	6,100	1,439.00	8,777,900	
ウシオ電機	81,000	1,331.00	107,811,000	
岡谷電機産業	13,600	298.00	4,052,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	15,500	292.00	4,526,000	
エノモト	5,000	994.00	4,970,000	
日本セラミック	15,100	2,343.00	35,379,300	
遠藤照明	8,400	630.00	5,292,000	
古河電池	10,900	1,130.00	12,317,000	

双信電機	8,700	394.00	3,427,800
山一電機	11,000	1,270.00	13,970,000
図研	9,700	2,804.00	27,198,800
日本電子	28,900	3,140.00	90,746,000
カシオ計算機	129,100	1,593.00	205,656,300
ファナック	137,100	19,005.00	2,605,585,500
日本シイエムケイ	35,700	421.00	15,029,700
エンプラス	7,700	2,192.00	16,878,400
大真空	5,700	1,716.00	9,781,200
ローム	60,700	7,000.00	424,900,000
浜松ホトニクス	104,700	4,825.00	505,177,500
三井ハイテック	16,500	1,614.00	26,631,000
新光電気工業	49,300	1,635.00	80,605,500
京セラ	205,200	6,164.00	1,264,852,800
太陽誘電	65,000	2,943.00	191,295,000
村田製作所	428,400	6,355.00	2,722,482,000
双葉電子工業	23,700	890.00	21,093,000
北陸電気工業	6,600	870.00	5,742,000
ニチコン	50,300	741.00	37,272,300
日本ケミコン	11,100	1,639.00	18,192,900
K O A	22,600	973.00	21,989,800
市光工業	23,100	472.00	10,903,200
小糸製作所	87,500	4,995.00	437,062,500
ミツバ	26,800	373.00	9,996,400
S C R E E Nホールディングス	25,300	5,130.00	129,789,000
キャノン電子	13,800	1,467.00	20,244,600
キャノン	724,500	1,849.50	1,339,962,750
リコー	371,100	769.00	285,375,900
象印マホービン	39,900	1,525.00	60,847,500
M U T O Hホールディングス	2,300	1,501.00	3,452,300
東京エレクトロン	92,500	27,770.00	2,568,725,000
トヨタ紡織	42,500	1,372.00	58,310,000
芦森工業	3,100	879.00	2,724,900
ユニプレス	28,300	870.00	24,621,000
豊田自動織機	118,000	6,040.00	712,720,000
モリタホールディングス	25,500	1,894.00	48,297,000
三櫻工業	18,600	641.00	11,922,600
デンソー	321,000	4,251.00	1,364,571,000
東海理化電機製作所	38,400	1,442.00	55,372,800
三井E & Sホールディングス	52,700	441.00	23,240,700
川崎重工業	113,400	1,469.00	166,584,600
名村造船所	46,900	153.00	7,175,700

日本車輛製造	5,300	2,433.00	12,894,900
三菱ロジスネクスト	19,300	963.00	18,585,900
近畿車輛	2,200	1,235.00	2,717,000
日産自動車	1,719,500	416.00	715,312,000
いすゞ自動車	422,400	972.50	410,784,000
トヨタ自動車	1,626,800	7,084.00	11,524,251,200
日野自動車	182,100	695.00	126,559,500
三菱自動車工業	539,700	246.00	132,766,200
エフテック	10,300	466.00	4,799,800
レシップホールディングス	5,700	560.00	3,192,000
G M B	2,700	616.00	1,663,200
ファルテック	2,700	602.00	1,625,400
武蔵精密工業	32,500	999.00	32,467,500
日産車体	28,500	864.00	24,624,000
新明和工業	39,300	933.00	36,666,900
極東開発工業	27,100	1,349.00	36,557,900
日信工業	29,700	2,227.00	66,141,900
トピー工業	12,000	1,127.00	13,524,000
ティラド	5,300	1,267.00	6,715,100
曙ブレーキ工業	80,000	176.00	14,080,000
タチエス	24,000	881.00	21,144,000
N O K	78,400	1,109.00	86,945,600
フタバ産業	40,700	504.00	20,512,800
K Y B	16,300	2,059.00	33,561,700
大同メタル工業	28,100	504.00	14,162,400
プレス工業	72,500	299.00	21,677,500
ミクニ	18,800	260.00	4,888,000
太平洋工業	30,600	882.00	26,989,200
ケーヒン	33,500	2,574.00	86,229,000
河西工業	19,800	397.00	7,860,600
アイシン精機	120,100	3,640.00	437,164,000
マツダ	429,000	646.00	277,134,000
今仙電機製作所	13,600	638.00	8,676,800
本田技研工業	1,147,900	2,655.00	3,047,674,500
スズキ	289,000	4,141.00	1,196,749,000
S U B A R U	452,600	2,187.00	989,836,200
安永	7,100	989.00	7,021,900
ヤマハ発動機	206,000	1,668.00	343,608,000
ショーワ	34,400	2,275.00	78,260,000
T B K	17,500	410.00	7,175,000
エクセディ	19,800	1,393.00	27,581,400
豊田合成	47,100	2,233.00	105,174,300

愛三工業	23,000	479.00	11,017,000
盟和産業	2,300	890.00	2,047,000
日本プラスト	11,600	389.00	4,512,400
ヨロズ	13,700	972.00	13,316,400
エフ・シー・シー	23,900	1,839.00	43,952,100
シマノ	54,600	23,070.00	1,259,622,000
テイ・エス テック	33,900	3,140.00	106,446,000
ジャムコ	7,400	684.00	5,061,600
テルモ	412,600	4,247.00	1,752,312,200
クリエートメディック	4,900	980.00	4,802,000
日機装	47,100	1,006.00	47,382,600
日本エム・ディ・エム	8,400	2,034.00	17,085,600
島津製作所	174,200	3,170.00	552,214,000
JMS	12,400	891.00	11,048,400
長野計器	10,600	835.00	8,851,000
ブイ・テクノロジー	6,800	3,805.00	25,874,000
東京計器	9,300	907.00	8,435,100
愛知時計電機	1,900	4,505.00	8,559,500
インターアクション	7,800	1,766.00	13,774,800
オーバル	13,200	217.00	2,864,400
東京精密	26,400	3,225.00	85,140,000
マニー	58,100	2,764.00	160,588,400
ニコン	222,700	836.00	186,177,200
トプコン	73,500	796.00	58,506,000
オリンパス	806,700	2,104.50	1,697,700,150
理研計器	12,900	2,455.00	31,669,500
タムロン	11,800	1,705.00	20,119,000
HOYA	289,200	10,070.00	2,912,244,000
シード	6,200	692.00	4,290,400
ノーリツ鋼機	9,900	1,463.00	14,483,700
エー・アンド・デイ	13,300	643.00	8,551,900
朝日インテック	165,100	3,130.00	516,763,000
シチズン時計	170,900	317.00	54,175,300
リズム時計工業	4,600	609.00	2,801,400
大研医器	10,200	558.00	5,691,600
メニコン	20,700	5,960.00	123,372,000
シンシア	1,700	383.00	651,100
松風	6,600	1,407.00	9,286,200
セイコーホールディングス	20,600	1,509.00	31,085,400
ニプロ	100,900	1,188.00	119,869,200
中本パックス	3,700	1,568.00	5,801,600
スノーピーク	8,600	1,438.00	12,366,800

パラマウントベッドホールディングス	15,400	4,215.00	64,911,000
トランザクション	8,000	1,152.00	9,216,000
粧美堂	4,200	372.00	1,562,400
ニホンフラッシュ	13,600	1,491.00	20,277,600
前田工織	16,100	2,502.00	40,282,200
永大産業	19,100	296.00	5,653,600
アートネイチャー	15,600	594.00	9,266,400
バンダイナムコホールディングス	150,700	6,436.00	969,905,200
アイフィスジャパン	3,700	728.00	2,693,600
共立印刷	24,400	131.00	3,196,400
SHOEI	12,800	3,050.00	39,040,000
フランスベッドホールディングス	20,600	836.00	17,221,600
パイロットコーポレーション	25,800	3,160.00	81,528,000
萩原工業	8,100	1,421.00	11,510,100
トッパン・フォームズ	31,200	962.00	30,014,400
フジシールインターナショナル	32,700	1,853.00	60,593,100
タカラトミー	65,400	857.00	56,047,800
廣済堂	10,200	746.00	7,609,200
エステールホールディングス	3,900	612.00	2,386,800
タカノ	5,700	624.00	3,556,800
プロネクサス	12,500	1,072.00	13,400,000
ホクシン	9,000	116.00	1,044,000
ウッドワン	4,900	1,200.00	5,880,000
大建工業	9,800	1,583.00	15,513,400
凸版印刷	205,800	1,684.00	346,567,200
大日本印刷	190,800	2,244.00	428,155,200
共同印刷	4,500	2,622.00	11,799,000
NISSHA	29,900	1,128.00	33,727,200
光村印刷	1,300	1,451.00	1,886,300
TAKARA & COMPANY	7,000	2,193.00	15,351,000
アシックス	128,900	1,400.00	180,460,000
ツツミ	4,500	1,810.00	8,145,000
小松ウオール工業	4,400	1,713.00	7,537,200
ヤマハ	86,700	5,000.00	433,500,000
河合楽器製作所	4,500	2,638.00	11,871,000
クリナップ	13,600	506.00	6,881,600
ピジョン	93,600	4,700.00	439,920,000
オリバー	3,100	2,491.00	7,722,100
兼松サステック	900	1,378.00	1,240,200
キングジム	12,100	871.00	10,539,100
リンテック	34,700	2,468.00	85,639,600
イトーキ	28,900	343.00	9,912,700

任天堂	89,400	53,300.00	4,765,020,000
三菱鉛筆	24,000	1,244.00	29,856,000
タカラスタANDARD	30,100	1,352.00	40,695,200
コクヨ	69,900	1,196.00	83,600,400
ナカバヤシ	14,300	612.00	8,751,600
グローブライド	6,500	2,451.00	15,931,500
オカムラ	50,900	741.00	37,716,900
美津濃	13,200	1,849.00	24,406,800
東京電力ホールディングス	1,163,900	308.00	358,481,200
中部電力	446,000	1,314.00	586,044,000
関西電力	552,400	1,025.00	566,210,000
中国電力	210,300	1,303.00	274,020,900
北陸電力	133,300	716.00	95,442,800
東北電力	364,200	1,056.00	384,595,200
四国電力	131,300	770.00	101,101,000
九州電力	300,500	940.00	282,470,000
北海道電力	136,400	432.00	58,924,800
沖縄電力	28,300	1,663.00	47,062,900
電源開発	116,000	1,608.00	186,528,000
エフオン	7,800	652.00	5,085,600
イーレックス	20,800	1,279.00	26,603,200
レノバ	24,300	1,151.00	27,969,300
東京瓦斯	280,400	2,365.50	663,286,200
大阪瓦斯	282,900	2,124.00	600,879,600
東邦瓦斯	71,700	4,800.00	344,160,000
北海道瓦斯	7,800	1,578.00	12,308,400
広島ガス	30,000	356.00	10,680,000
西部瓦斯	16,400	2,427.00	39,802,800
静岡ガス	41,400	867.00	35,893,800
メタウォーター	7,000	4,505.00	31,535,000
SBSホールディングス	10,800	2,059.00	22,237,200
東武鉄道	152,000	3,345.00	508,440,000
相鉄ホールディングス	46,600	2,851.00	132,856,600
東急	367,700	1,363.00	501,175,100
京浜急行電鉄	187,200	1,566.00	293,155,200
小田急電鉄	216,800	2,562.00	555,441,600
京王電鉄	75,600	6,280.00	474,768,000
京成電鉄	101,500	2,975.00	301,962,500
富士急行	19,900	3,085.00	61,391,500
新京成電鉄	3,700	2,190.00	8,103,000
東日本旅客鉄道	256,600	6,678.00	1,713,574,800
西日本旅客鉄道	129,900	5,158.00	670,024,200

東海旅客鉄道	121,200	14,815.00	1,795,578,000
西武ホールディングス	190,300	1,101.00	209,520,300
鴻池運輸	23,200	1,080.00	25,056,000
西日本鉄道	40,400	2,922.00	118,048,800
ハマキョウレックス	11,200	3,310.00	37,072,000
サカイ引越センター	7,700	4,660.00	35,882,000
近鉄グループホールディングス	138,100	4,595.00	634,569,500
阪急阪神ホールディングス	184,200	3,410.00	628,122,000
南海電気鉄道	65,400	2,281.00	149,177,400
京阪ホールディングス	61,500	4,530.00	278,595,000
神戸電鉄	3,300	3,615.00	11,929,500
名古屋鉄道	113,500	2,937.00	333,349,500
山陽電気鉄道	9,900	2,147.00	21,255,300
日本通運	47,800	5,940.00	283,932,000
ヤマトホールディングス	242,100	2,747.00	665,048,700
山九	38,400	4,190.00	160,896,000
丸運	7,900	222.00	1,753,800
丸全昭和運輸	11,200	3,310.00	37,072,000
センコーグループホールディングス	76,100	898.00	68,337,800
トナミホールディングス	3,300	5,720.00	18,876,000
ニッコンホールディングス	49,400	2,120.00	104,728,000
日本石油輸送	1,500	2,599.00	3,898,500
福山通運	17,700	4,775.00	84,517,500
セイノーホールディングス	103,400	1,566.00	161,924,400
エスライン	4,100	915.00	3,751,500
神奈川中央交通	3,400	3,935.00	13,379,000
日立物流	25,300	3,500.00	88,550,000
丸和運輸機関	14,600	4,205.00	61,393,000
C & F ロジホールディングス	14,000	1,796.00	25,144,000
九州旅客鉄道	121,000	2,291.00	277,211,000
S Gホールディングス	144,900	4,910.00	711,459,000
日本郵船	116,000	1,638.00	190,008,000
商船三井	87,900	1,881.00	165,339,900
川崎汽船	42,500	1,127.00	47,897,500
N S ユナイテッド海運	8,200	1,370.00	11,234,000
飯野海運	68,100	354.00	24,107,400
共栄タンカー	3,700	769.00	2,845,300
乾汽船	8,000	805.00	6,440,000
日本航空	244,200	2,029.00	495,481,800
A N Aホールディングス	252,400	2,433.00	614,089,200
パスコ	2,700	1,306.00	3,526,200
トランコム	3,900	7,290.00	28,431,000

日新	11,900	1,497.00	17,814,300
三菱倉庫	43,800	3,060.00	134,028,000
三井倉庫ホールディングス	15,800	1,680.00	26,544,000
住友倉庫	49,700	1,314.00	65,305,800
澁澤倉庫	7,600	1,986.00	15,093,600
東陽倉庫	24,900	321.00	7,992,900
日本トランスシティ	30,400	502.00	15,260,800
ケイヒン	2,700	1,265.00	3,415,500
中央倉庫	8,400	991.00	8,324,400
川西倉庫	2,500	1,049.00	2,622,500
安田倉庫	11,300	891.00	10,068,300
ファイズホールディングス	2,900	1,070.00	3,103,000
東洋埠頭	4,200	1,414.00	5,938,800
宇徳	11,800	459.00	5,416,200
上組	77,000	2,126.00	163,702,000
サンリツ	3,300	601.00	1,983,300
キムラユニティー	3,700	1,043.00	3,859,100
キューソー流通システム	3,400	1,453.00	4,940,200
近鉄エクスプレス	29,300	2,059.00	60,328,700
東海運	7,900	278.00	2,196,200
エーアイティー	9,700	985.00	9,554,500
内外トランスライン	4,800	1,049.00	5,035,200
日本コンセプト	4,400	1,246.00	5,482,400
NEC ネットエスアイ	40,700	2,076.00	84,493,200
クロスキャット	4,100	1,120.00	4,592,000
システナ	51,200	1,787.00	91,494,400
デジタルアーツ	7,100	8,590.00	60,989,000
日鉄ソリューションズ	21,600	3,105.00	67,068,000
キューブシステム	8,000	1,136.00	9,088,000
エイジア	2,800	1,817.00	5,087,600
コア	6,300	1,355.00	8,536,500
ラクーンホールディングス	6,900	1,156.00	7,976,400
ソリトンシステムズ	7,400	1,801.00	13,327,400
ソフトクリエイティブホールディングス	6,400	2,490.00	15,936,000
T I S	143,200	2,210.00	316,472,000
ネオス	5,700	664.00	3,784,800
電算システム	5,100	3,785.00	19,303,500
グリー	88,500	507.00	44,869,500
コーエーテクモホールディングス	29,300	4,290.00	125,697,000
三菱総合研究所	6,200	4,050.00	25,110,000
電算	1,700	2,190.00	3,723,000
A G S	8,500	811.00	6,893,500

ファインデックス	12,400	1,154.00	14,309,600
ブレインパッド	3,800	3,930.00	14,934,000
K L a b	26,000	941.00	24,466,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,600	945.00	16,632,000
イーブুকイニシアティブジャパン	2,200	3,810.00	8,382,000
ネクソン	360,400	2,586.00	931,994,400
アイスタイル	41,200	324.00	13,348,800
エムアップホールディングス	4,300	3,675.00	15,802,500
エイチーム	10,300	902.00	9,290,600
エニグモ	13,800	1,540.00	21,252,000
テクノスジャパン	11,500	821.00	9,441,500
コロプラ	47,300	980.00	46,354,000
ブロードリーフ	71,600	511.00	36,587,600
クロス・マーケティンググループ	7,400	310.00	2,294,000
デジタルハーツホールディングス	7,900	964.00	7,615,600
システム情報	11,000	1,304.00	14,344,000
メディアドゥ	4,600	6,500.00	29,900,000
じげん	36,500	345.00	12,592,500
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	756.00	2,721,600
サイバーリンクス	2,500	1,983.00	4,957,500
フィックスターズ	15,500	1,124.00	17,422,000
C A R T A H O L D I N G S	6,000	1,188.00	7,128,000
オブティム	7,600	3,195.00	24,282,000
セレス	5,000	1,564.00	7,820,000
S H I F T	5,800	12,200.00	70,760,000
ティーガイア	12,900	2,139.00	27,593,100
セック	2,200	2,900.00	6,380,000
日本アジアグループ	15,100	296.00	4,469,600
テクマトリックス	20,300	2,285.00	46,385,500
プロシップ	4,400	1,469.00	6,463,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,700	2,129.00	73,876,300
G M O ペイメントゲートウェイ	30,300	11,580.00	350,874,000
ザッパラス	7,100	401.00	2,847,100
システムリサーチ	4,000	1,767.00	7,068,000
インターネットイニシアティブ	21,200	4,350.00	92,220,000
さくらインターネット	16,000	587.00	9,392,000
ヴィンクス	4,300	1,149.00	4,940,700
G M O クラウド	3,200	9,280.00	29,696,000
S R A ホールディングス	7,700	2,391.00	18,410,700
システムインテグレータ	5,000	836.00	4,180,000
朝日ネット	10,500	959.00	10,069,500
e B A S E	17,300	1,247.00	21,573,100

アバント	14,000	1,057.00	14,798,000
アドソル日進	5,200	2,682.00	13,946,400
フリービット	7,900	776.00	6,130,400
コムチュア	16,200	2,284.00	37,000,800
サイバーコム	2,700	1,805.00	4,873,500
アステリア	9,300	621.00	5,775,300
アイル	8,200	1,655.00	13,571,000
マークラインズ	6,100	2,028.00	12,370,800
メディカル・データ・ビジョン	16,500	1,634.00	26,961,000
ショーケース	3,600	623.00	2,242,800
モバイルファクトリー	3,500	1,186.00	4,151,000
テラスカイ	5,200	4,470.00	23,244,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,301.00	7,675,900
P C Iホールディングス	5,700	1,047.00	5,967,900
パイプドHD	2,100	1,491.00	3,131,100
アイビーシー	2,700	977.00	2,637,900
ネオジャパン	2,800	2,740.00	7,672,000
P R T I M E S	2,600	2,250.00	5,850,000
ランドコンピュータ	2,500	1,022.00	2,555,000
ダブルスタンダード	1,900	4,960.00	9,424,000
オープンドア	7,400	1,186.00	8,776,400
マイネット	4,700	1,595.00	7,496,500
アカツキ	5,200	3,990.00	20,748,000
ベネフィットジャパン	1,300	1,917.00	2,492,100
U b i c o mホールディングス	3,300	1,957.00	6,458,100
L I N E	43,800	5,420.00	237,396,000
カナミックネットワーク	13,500	794.00	10,719,000
ノムラシステムコーポレーション	7,000	417.00	2,919,000
チェンジ	5,000	12,650.00	63,250,000
シンクロ・フード	7,200	339.00	2,440,800
オークネット	7,900	1,109.00	8,761,100
セグエグループ	4,000	910.00	3,640,000
エイトレッド	2,500	2,014.00	5,035,000
A O I T Y O H o l d i n g s	15,300	408.00	6,242,400
マクロミル	29,700	784.00	23,284,800
ビーグリー	3,000	1,770.00	5,310,000
オロ	4,600	3,140.00	14,444,000
ユーザーローカル	1,500	3,790.00	5,685,000
テモナ	3,400	1,183.00	4,022,200
ニーズウェル	3,200	762.00	2,438,400
サインポスト	3,200	1,338.00	4,281,600
ソルクシーズ	5,900	780.00	4,602,000

フェイス	5,500	1,037.00	5,703,500
プロトコーポレーション	13,100	1,201.00	15,733,100
ハイマックス	1,900	2,006.00	3,811,400
野村総合研究所	202,900	2,941.00	596,728,900
サイバネットシステム	10,600	760.00	8,056,000
C Eホールディングス	8,300	505.00	4,191,500
日本システム技術	2,500	1,501.00	3,752,500
インテージホールディングス	18,200	908.00	16,525,600
東邦システムサイエンス	4,100	937.00	3,841,700
ソースネクスト	69,200	274.00	18,960,800
インフォコム	15,700	3,460.00	54,322,000
HEROZ	2,100	3,800.00	7,980,000
ラクスル	11,600	3,025.00	35,090,000
F I G	17,000	231.00	3,927,000
システムサポート	3,400	1,795.00	6,103,000
イーソル	8,100	1,081.00	8,756,100
アルテリア・ネットワークス	16,000	1,868.00	29,888,000
東海ソフト	1,300	1,240.00	1,612,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,076.00	3,012,800
トビラシステムズ	1,600	2,008.00	3,212,800
フォーカスシステムズ	9,300	785.00	7,300,500
クレスコ	9,000	1,313.00	11,817,000
フジ・メディア・ホールディングス	138,100	1,045.00	144,314,500
オービック	49,600	18,630.00	924,048,000
ジャストシステム	23,300	7,740.00	180,342,000
T D Cソフト	12,900	943.00	12,164,700
Zホールディングス	1,965,200	654.00	1,285,240,800
トレンドマイクロ	76,400	6,600.00	504,240,000
I Dホールディングス	5,700	1,424.00	8,116,800
日本オラクル	29,000	12,650.00	366,850,000
アルファシステムズ	4,500	3,655.00	16,447,500
フューチャー	17,500	1,832.00	32,060,000
C A C Holdings	9,600	1,324.00	12,710,400
S Bテクノロジー	5,200	3,270.00	17,004,000
トーセ	4,200	931.00	3,910,200
オービックビジネスコンサルタント	14,700	6,570.00	96,579,000
伊藤忠テクノソリューションズ	65,300	4,080.00	266,424,000
アイティフォー	17,800	823.00	14,649,400
東計電算	2,200	4,170.00	9,174,000
エクスネット	2,600	959.00	2,493,400
大塚商会	77,500	5,390.00	417,725,000
サイボウズ	16,800	3,250.00	54,600,000

ソフトブレン	12,100	867.00	10,490,700
電通国際情報サービス	8,900	5,890.00	52,421,000
A C C E S S	13,800	857.00	11,826,600
デジタルガレージ	25,900	3,350.00	86,765,000
E Mシステムズ	20,700	871.00	18,029,700
ウェザーニューズ	4,900	4,260.00	20,874,000
C I J	10,200	837.00	8,537,400
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,838.00	4,824,600
日本エンタープライズ	15,700	314.00	4,929,800
WOWOW	7,000	2,678.00	18,746,000
スカラ	10,100	773.00	7,807,300
インテリジェント ウェイブ	8,800	818.00	7,198,400
I M A G I C A G R O U P	13,100	372.00	4,873,200
ネットワンシステムズ	54,600	4,240.00	231,504,000
システムソフト	34,600	95.00	3,287,000
アルゴグラフィックス	12,200	3,425.00	41,785,000
マーベラス	22,300	794.00	17,706,200
エイベックス	25,000	913.00	22,825,000
日本ユニシス	44,800	3,060.00	137,088,000
兼松エレクトロニクス	7,900	4,060.00	32,074,000
都築電気	4,700	1,643.00	7,722,100
東京放送ホールディングス	87,200	1,817.00	158,442,400
日本テレビホールディングス	119,700	1,250.00	149,625,000
朝日放送グループホールディングス	14,700	733.00	10,775,100
テレビ朝日ホールディングス	39,500	1,686.00	66,597,000
スカパーJ S A Tホールディングス	95,000	400.00	38,000,000
テレビ東京ホールディングス	11,900	2,308.00	27,465,200
日本BS放送	5,200	1,138.00	5,917,600
ビジョン	18,300	661.00	12,096,300
スマートバリュー	4,000	898.00	3,592,000
ワイヤレスゲート	6,300	751.00	4,731,300
コネクシオ	8,400	1,225.00	10,290,000
クロップス	3,100	787.00	2,439,700
日本電信電話	1,912,500	2,603.50	4,979,193,750
K D D I	1,043,100	3,320.00	3,463,092,000
ソフトバンク	1,300,400	1,473.00	1,915,489,200
光通信	14,800	25,190.00	372,812,000
N T T ドコモ	1,023,100	3,087.00	3,158,309,700
エムティーアイ	14,300	708.00	10,124,400
G M O インターネット	51,400	2,944.00	151,321,600
ファイバーゲート	4,800	1,986.00	9,532,800
アйдママーケティングコミュニケーション	5,200	429.00	2,230,800

KADOKAWA	38,700	2,729.00	105,612,300
学研ホールディングス	19,400	1,514.00	29,371,600
ゼンリン	28,800	1,144.00	32,947,200
昭文社ホールディングス	7,400	451.00	3,337,400
インプレスホールディングス	11,800	154.00	1,817,200
アイネット	7,600	1,488.00	11,308,800
松竹	9,500	13,840.00	131,480,000
東宝	84,500	3,680.00	310,960,000
東映	5,400	15,460.00	83,484,000
エヌ・ティ・ティ・データ	381,200	1,238.00	471,925,600
ピー・シー・エー	2,500	4,825.00	12,062,500
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,324.00	6,884,800
D T S	32,100	2,231.00	71,615,100
スクウェア・エニックス・ホールディングス	61,100	6,940.00	424,034,000
シーイーシー	15,500	1,683.00	26,086,500
カプコン	67,500	5,010.00	338,175,000
アイ・エス・ビー	3,100	2,800.00	8,680,000
ジャステック	9,400	1,271.00	11,947,400
S C S K	33,100	5,680.00	188,008,000
日本システムウエア	4,900	1,942.00	9,515,800
アイネス	14,300	1,387.00	19,834,100
T K C	12,200	6,000.00	73,200,000
富士ソフト	15,300	4,915.00	75,199,500
N S D	46,200	1,929.00	89,119,800
コナミホールディングス	52,100	3,865.00	201,366,500
福井コンピュータホールディングス	5,800	2,697.00	15,642,600
J B C Cホールディングス	9,900	1,650.00	16,335,000
ミロク情報サービス	12,800	2,160.00	27,648,000
ソフトバンクグループ	1,135,200	6,266.00	7,113,163,200
ハウスイ	1,200	882.00	1,058,400
高千穂交易	5,600	905.00	5,068,000
カワニシホールディングス	1,700	1,360.00	2,312,000
伊藤忠食品	3,500	5,140.00	17,990,000
エレマテック	13,400	881.00	11,805,400
J A L U X	4,100	1,621.00	6,646,100
あらた	11,400	4,945.00	56,373,000
トーメンデバイス	2,200	3,770.00	8,294,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	3,175.00	16,510,000
フィールズ	11,000	327.00	3,597,000
双日	793,100	234.00	185,585,400
アルフレッサ ホールディングス	159,600	2,102.00	335,479,200
横浜冷凍	37,600	885.00	33,276,000

ラサ商事	7,600	937.00	7,121,200
アルコニックス	15,300	1,340.00	20,502,000
神戸物産	49,500	6,850.00	339,075,000
ハイパー	2,200	504.00	1,108,800
あい ホールディングス	20,500	1,559.00	31,959,500
ディーブイエックス	5,100	903.00	4,605,300
ダイワボウホールディングス	12,200	6,330.00	77,226,000
マクニカ・富士エレホールディングス	34,300	1,712.00	58,721,600
ラクト・ジャパン	6,200	3,310.00	20,522,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,000	1,033.00	27,891,000
八洲電機	11,100	927.00	10,289,700
メディアスホールディングス	8,200	808.00	6,625,600
レスターホールディングス	15,000	1,906.00	28,590,000
ジューテックホールディングス	3,300	1,000.00	3,300,000
大光	6,100	678.00	4,135,800
OCHIホールディングス	4,200	1,509.00	6,337,800
TOKAIホールディングス	75,900	1,023.00	77,645,700
黒谷	3,900	534.00	2,082,600
Cominix	2,500	692.00	1,730,000
三洋貿易	14,500	961.00	13,934,500
ビューティガレージ	2,300	2,046.00	4,705,800
ウイン・パートナーズ	10,400	927.00	9,640,800
ミタチ産業	4,300	540.00	2,322,000
シップヘルスケアホールディングス	23,000	4,725.00	108,675,000
明治電機工業	4,500	1,390.00	6,255,000
デリカフーズホールディングス	5,100	631.00	3,218,100
スターティアホールディングス	3,300	567.00	1,871,100
コメダホールディングス	31,300	1,754.00	54,900,200
ピーバンドットコム	1,500	923.00	1,384,500
アセンテック	3,100	2,173.00	6,736,300
富士興産	4,400	544.00	2,393,600
協栄産業	1,600	1,290.00	2,064,000
小野建	12,900	1,127.00	14,538,300
南陽	3,200	1,505.00	4,816,000
佐島電機	9,800	828.00	8,114,400
エコートレーディング	3,300	530.00	1,749,000
伯東	8,800	1,053.00	9,266,400
コンドーテック	11,100	1,134.00	12,587,400
中山福	8,300	470.00	3,901,000
ナガイレーベン	19,000	2,720.00	51,680,000
三菱食品	15,800	2,723.00	43,023,400
松田産業	10,500	1,525.00	16,012,500

第一興商	21,400	3,130.00	66,982,000
メディバルホールディングス	155,000	2,015.00	312,325,000
S P K	6,200	1,354.00	8,394,800
萩原電気ホールディングス	5,300	1,904.00	10,091,200
アズワン	9,400	12,450.00	117,030,000
スズデン	5,000	1,136.00	5,680,000
尾家産業	4,200	1,487.00	6,245,400
シモジマ	8,800	1,246.00	10,964,800
ドウシシャ	13,500	1,993.00	26,905,500
小津産業	3,200	1,757.00	5,622,400
高速	8,600	1,406.00	12,091,600
たけびし	5,000	1,472.00	7,360,000
リックス	3,200	1,422.00	4,550,400
丸文	12,800	467.00	5,977,600
ハピネット	12,000	1,300.00	15,600,000
橋本総業ホールディングス	2,900	2,089.00	6,058,100
日本ライフライン	42,600	1,406.00	59,895,600
タカショー	9,400	554.00	5,207,600
マルカ	4,700	1,973.00	9,273,100
I D O M	38,800	514.00	19,943,200
進和	8,500	2,050.00	17,425,000
エスケイジャパン	3,200	292.00	934,400
ダイトロン	6,100	1,417.00	8,643,700
シークス	18,300	865.00	15,829,500
田中商事	4,400	702.00	3,088,800
オーハシテクニカ	7,400	1,442.00	10,670,800
白銅	5,200	1,202.00	6,250,400
ダイコー通産	900	1,224.00	1,101,600
伊藤忠商事	1,004,400	2,610.00	2,621,484,000
丸紅	1,494,700	565.50	845,252,850
高島	2,300	1,760.00	4,048,000
長瀬産業	80,800	1,315.00	106,252,000
蝶理	9,200	1,600.00	14,720,000
豊田通商	160,300	2,996.00	480,258,800
三共生興	21,800	408.00	8,894,400
兼松	53,500	1,303.00	69,710,500
ツカモトコーポレーション	2,600	1,152.00	2,995,200
三井物産	1,243,300	1,750.00	2,175,775,000
日本紙パルプ商事	8,200	3,855.00	31,611,000
カメイ	18,700	991.00	18,531,700
東都水産	1,800	3,120.00	5,616,000
O U G ホールディングス	2,300	2,742.00	6,306,600

スターゼン	5,300	3,995.00	21,173,500
山善	56,100	955.00	53,575,500
椿本興業	2,700	2,987.00	8,064,900
住友商事	906,000	1,247.00	1,129,782,000
内田洋行	5,700	6,500.00	37,050,000
三菱商事	941,500	2,292.00	2,157,918,000
第一実業	7,000	3,595.00	25,165,000
キャノンマーケティングジャパン	35,600	1,940.00	69,064,000
西華産業	8,100	1,233.00	9,987,300
佐藤商事	11,900	846.00	10,067,400
菱洋エレクトロ	14,600	3,025.00	44,165,000
東京産業	13,000	496.00	6,448,000
ユアサ商事	13,600	2,917.00	39,671,200
神鋼商事	3,600	1,750.00	6,300,000
トルク	8,600	296.00	2,545,600
阪和興業	26,800	2,023.00	54,216,400
正栄食品工業	9,300	3,895.00	36,223,500
カナデン	11,700	1,343.00	15,713,100
菱電商事	10,400	1,405.00	14,612,000
フルサト工業	7,900	1,348.00	10,649,200
岩谷産業	31,900	3,750.00	119,625,000
ナイス	6,100	1,167.00	7,118,700
昭光通商	4,600	556.00	2,557,600
ニチモウ	2,200	1,883.00	4,142,600
極東貿易	4,100	1,286.00	5,272,600
イワキ	18,900	471.00	8,901,900
三愛石油	35,400	907.00	32,107,800
稲畑産業	31,600	1,261.00	39,847,600
G S Iクレオス	3,500	1,762.00	6,167,000
明和産業	13,300	466.00	6,197,800
クワザワ	5,200	529.00	2,750,800
ヤマエ久野	10,500	1,208.00	12,684,000
ワキタ	30,600	933.00	28,549,800
東邦ホールディングス	46,100	1,962.00	90,448,200
サンゲツ	38,800	1,572.00	60,993,600
ミツウロコグループホールディングス	21,200	1,108.00	23,489,600
シナネンホールディングス	5,900	2,942.00	17,357,800
伊藤忠エネクス	31,800	933.00	29,669,400
サンリオ	40,300	1,745.00	70,323,500
サンワテクノス	10,200	803.00	8,190,600
リョーサン	15,900	1,955.00	31,084,500
新光商事	22,500	812.00	18,270,000

トーホー	6,500	1,808.00	11,752,000
三信電気	7,700	1,771.00	13,636,700
東陽テクニカ	15,400	964.00	14,845,600
モスフードサービス	18,800	2,822.00	53,053,600
加賀電子	14,300	2,091.00	29,901,300
ソーダニッカ	14,900	508.00	7,569,200
立花エレテック	10,600	1,639.00	17,373,400
フォーバル	6,300	992.00	6,249,600
PALTA C	23,000	5,960.00	137,080,000
三谷産業	19,000	333.00	6,327,000
西本Wismettacホールディングス	3,300	1,967.00	6,491,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,522.00	1,978,600
コア商事ホールディングス	1,400	2,123.00	2,972,200
国際紙パルプ商事	34,100	276.00	9,411,600
ヤマタネ	7,200	1,268.00	9,129,600
丸紅建材リース	1,400	1,700.00	2,380,000
日鉄物産	10,200	3,095.00	31,569,000
泉州電業	4,000	3,045.00	12,180,000
トラスコ中山	32,900	2,558.00	84,158,200
オートバックスセブン	53,300	1,387.00	73,927,100
モリト	10,500	587.00	6,163,500
加藤産業	20,700	3,610.00	74,727,000
北恵	3,700	988.00	3,655,600
イノテック	7,500	1,007.00	7,552,500
イエローハット	27,100	1,670.00	45,257,000
J Kホールディングス	13,000	747.00	9,711,000
日伝	13,000	2,093.00	27,209,000
北沢産業	10,900	262.00	2,855,800
杉本商事	7,800	1,888.00	14,726,400
因幡電機産業	40,900	2,578.00	105,440,200
東テク	4,800	2,228.00	10,694,400
ミスミグループ本社	180,000	2,711.00	487,980,000
アルテック	10,600	245.00	2,597,000
タキヒヨー	4,400	1,781.00	7,836,400
蔵王産業	2,800	1,405.00	3,934,000
スズケン	60,800	3,940.00	239,552,000
ジェコス	9,900	900.00	8,910,000
グローセル	14,400	403.00	5,803,200
ローソン	36,300	5,290.00	192,027,000
サンエー	12,000	4,250.00	51,000,000
カワチ薬品	11,200	3,145.00	35,224,000
エービーシー・マート	22,500	5,630.00	126,675,000

ハードオフコーポレーション	6,000	670.00	4,020,000
アスクル	15,100	3,125.00	47,187,500
ゲオホールディングス	26,000	1,675.00	43,550,000
アダストリア	20,000	1,613.00	32,260,000
ジーフット	8,700	514.00	4,471,800
くら寿司	8,500	4,740.00	40,290,000
キャンドウ	6,900	2,215.00	15,283,500
パルグループホールディングス	14,900	1,111.00	16,553,900
エディオン	66,100	1,154.00	76,279,400
サーラコーポレーション	29,500	581.00	17,139,500
ワッツ	6,500	1,007.00	6,545,500
ハローズ	5,500	3,815.00	20,982,500
フジオフードグループ本社	12,300	1,227.00	15,092,100
あみやき亭	3,200	2,748.00	8,793,600
ひらまつ	26,400	173.00	4,567,200
大黒天物産	3,500	5,800.00	20,300,000
ハニーズホールディングス	12,800	1,048.00	13,414,400
ファーマライズホールディングス	3,800	718.00	2,728,400
アルペン	11,100	1,757.00	19,502,700
ハブ	4,500	591.00	2,659,500
クオールホールディングス	21,300	1,078.00	22,961,400
ジーンズホールディングス	7,600	7,300.00	55,480,000
ビックカメラ	85,400	1,149.00	98,124,600
D C Mホールディングス	81,400	1,323.00	107,692,200
Monotaro	102,200	4,315.00	440,993,000
東京一番フーズ	4,100	506.00	2,074,600
きちりホールディングス	4,200	558.00	2,343,600
アークランドサービスホールディングス	12,100	1,964.00	23,764,400
J.フロント リテイリング	171,800	719.00	123,524,200
ドトール・日レスホールディングス	20,800	1,554.00	32,323,200
マツモトキヨシホールディングス	59,400	3,705.00	220,077,000
ブロンコビリー	7,600	2,140.00	16,264,000
Z O Z O	98,800	2,873.00	283,852,400
トレジャー・ファクトリー	4,500	727.00	3,271,500
物語コーポレーション	3,800	8,470.00	32,186,000
ココカラファイン	15,000	5,850.00	87,750,000
三越伊勢丹ホールディングス	251,500	563.00	141,594,500
Hamee	5,200	2,196.00	11,419,200
ウエルシアホールディングス	42,700	9,520.00	406,504,000
クリエイトSDホールディングス	24,300	3,915.00	95,134,500
丸善CHIホールディングス	16,800	372.00	6,249,600
ティーライフ	2,300	1,261.00	2,900,300

チムニー	4,500	1,305.00	5,872,500
シュッピン	10,100	801.00	8,090,100
オイシックス・ラ・大地	14,300	3,610.00	51,623,000
ネクステージ	24,200	1,042.00	25,216,400
ジョイフル本田	42,200	1,545.00	65,199,000
鳥貴族	4,400	1,387.00	6,102,800
キリン堂ホールディングス	5,700	2,819.00	16,068,300
ホットランド	10,900	1,114.00	12,142,600
すかいらーくホールディングス	161,100	1,573.00	253,410,300
SFPホールディングス	8,300	1,382.00	11,470,600
綿半ホールディングス	5,500	2,365.00	13,007,500
ヨシックス	2,500	1,639.00	4,097,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,900	1,342.00	56,229,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,900	494.00	3,902,600
B E E N O S	6,800	1,468.00	9,982,400
あさひ	10,800	1,937.00	20,919,600
日本調剤	8,800	1,576.00	13,868,800
コスモス薬品	12,700	19,100.00	242,570,000
トーエル	7,200	721.00	5,191,200
オンリー	2,900	524.00	1,519,600
セブン&アイ・ホールディングス	561,800	3,455.00	1,941,019,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	77,200	663.00	51,183,600
ツルハホールディングス	31,300	14,660.00	458,858,000
サンマルクホールディングス	11,500	1,546.00	17,779,000
フェリシモ	3,400	1,073.00	3,648,200
トリドールホールディングス	35,700	1,307.00	46,659,900
T O K Y O B A S E	13,700	326.00	4,466,200
ウイルプラスホールディングス	2,200	626.00	1,377,200
J Mホールディングス	10,900	3,645.00	39,730,500
サツドラホールディングス	2,300	1,955.00	4,496,500
アレンザホールディングス	7,300	1,310.00	9,563,000
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,429.00	5,573,100
パロックジャパンリミテッド	10,300	638.00	6,571,400
クスリのアオキホールディングス	12,900	9,730.00	125,517,000
力の源ホールディングス	6,500	650.00	4,225,000
スシローグローバルホールディングス	78,900	2,488.00	196,303,200
メディカルシステムネットワーク	14,300	475.00	6,792,500
はるやまホールディングス	7,000	701.00	4,907,000
ノジマ	25,600	2,963.00	75,852,800
カップ・クリエイト	20,100	1,398.00	28,099,800
ライトオン	10,700	594.00	6,355,800

良品計画	190,800	1,567.00	298,983,600
三城ホールディングス	16,100	266.00	4,282,600
アドヴァン	22,100	1,226.00	27,094,600
アルビス	5,500	2,537.00	13,953,500
コナカ	17,700	282.00	4,991,400
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,580.00	3,002,000
G - 7ホールディングス	8,500	2,848.00	24,208,000
イオン北海道	19,100	788.00	15,050,800
コジマ	25,100	557.00	13,980,700
ヒマラヤ	5,300	821.00	4,351,300
コーナン商事	20,500	4,215.00	86,407,500
エコス	5,400	2,297.00	12,403,800
ワタミ	17,200	939.00	16,150,800
マルシェ	4,200	536.00	2,251,200
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	315,700	2,538.00	801,246,600
西松屋チェーン	31,700	1,247.00	39,529,900
ゼンショーホールディングス	68,900	2,238.00	154,198,200
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,623.00	14,769,300
ハークスレイ	3,200	963.00	3,081,600
サイゼリヤ	21,400	1,889.00	40,424,600
V Tホールディングス	60,100	333.00	20,013,300
魚力	4,100	1,606.00	6,584,600
フジ・コーポレーション	3,900	2,054.00	8,010,600
ユナイテッドアローズ	15,200	1,607.00	24,426,400
ハイデイ日高	20,900	1,708.00	35,697,200
京都きもの友禅	10,100	229.00	2,312,900
コロナイド	47,700	1,455.00	69,403,500
ピーシーデポコーポレーション	19,400	646.00	12,532,400
壱番屋	10,200	5,220.00	53,244,000
P L A N T	3,900	870.00	3,393,000
スギホールディングス	28,700	7,650.00	219,555,000
薬王堂ホールディングス	6,300	2,532.00	15,951,600
スクロール	22,400	828.00	18,547,200
ヨンドシーホールディングス	14,700	1,803.00	26,504,100
ファミリーマート	114,800	2,290.00	262,892,000
木曽路	18,900	2,279.00	43,073,100
S R Sホールディングス	17,200	895.00	15,394,000
タカキュー	11,100	130.00	1,443,000
リテールパートナーズ	19,100	2,011.00	38,410,100
ケーヨー	29,700	897.00	26,640,900
上新電機	17,000	2,278.00	38,726,000
日本瓦斯	22,700	4,255.00	96,588,500

ロイヤルホールディングス	25,100	1,691.00	42,444,100
いなげや	17,900	1,893.00	33,884,700
鳥忠	27,100	3,135.00	84,958,500
チヨダ	15,300	1,026.00	15,697,800
ライフコーポレーション	10,900	5,200.00	56,680,000
リンガーハット	17,700	2,499.00	44,232,300
MrMaxHD	20,000	771.00	15,420,000
テンアライド	13,200	369.00	4,870,800
AOKIホールディングス	29,100	565.00	16,441,500
オークワ	22,600	1,483.00	33,515,800
コメリ	22,200	3,445.00	76,479,000
青山商事	30,000	639.00	19,170,000
しまむら	16,700	8,120.00	135,604,000
はせがわ	8,300	298.00	2,473,400
高島屋	104,800	824.00	86,355,200
松屋	29,200	650.00	18,980,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,200	725.00	49,445,000
近鉄百貨店	5,600	2,780.00	15,568,000
丸井グループ	131,700	1,854.00	244,171,800
アクシアル リテイリング	12,000	4,860.00	58,320,000
イオン	552,600	2,703.00	1,493,677,800
イズミ	29,200	4,480.00	130,816,000
平和堂	29,200	2,192.00	64,006,400
フジ	17,400	1,874.00	32,607,600
ヤオコー	16,300	8,750.00	142,625,000
ゼビオホールディングス	17,600	748.00	13,164,800
ケーズホールディングス	138,700	1,510.00	209,437,000
Olympicグループ	7,600	983.00	7,470,800
日産東京販売ホールディングス	22,000	250.00	5,500,000
シルバーライフ	2,000	2,135.00	4,270,000
一家ダイニングプロジェクト	1,500	515.00	772,500
Genky DrugStores	6,400	3,535.00	22,624,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	584.00	2,102,400
ブックオフグループホールディングス	8,400	806.00	6,770,400
アインホールディングス	17,700	6,720.00	118,944,000
元気寿司	3,700	2,116.00	7,829,200
ヤマダ電機	437,900	559.00	244,786,100
アークランドサカモト	22,600	2,201.00	49,742,600
ニトリホールディングス	62,200	22,915.00	1,425,313,000
グルメ杵屋	10,500	938.00	9,849,000
愛眼	11,400	220.00	2,508,000
ケーユーホールディングス	7,800	798.00	6,224,400

吉野家ホールディングス	47,300	2,129.00	100,701,700
松屋フーズホールディングス	7,000	3,515.00	24,605,000
サガミホールディングス	19,400	1,247.00	24,191,800
関西スーパーマーケット	12,100	1,276.00	15,439,600
王将フードサービス	10,600	5,890.00	62,434,000
プレナス	16,200	1,752.00	28,382,400
ミニストップ	10,700	1,537.00	16,445,900
アークス	29,400	2,715.00	79,821,000
パローホールディングス	31,900	2,656.00	84,726,400
ベルク	7,100	7,790.00	55,309,000
大庄	7,900	1,207.00	9,535,300
ファーストリテイリング	19,200	60,640.00	1,164,288,000
サンドラッグ	54,100	4,030.00	218,023,000
サクスパー ホールディングス	12,600	549.00	6,917,400
ヤマザワ	3,500	1,730.00	6,055,000
やまや	2,900	2,099.00	6,087,100
ペルーナ	31,100	1,028.00	31,970,800
島根銀行	3,800	571.00	2,169,800
じもとホールディングス	97,200	104.00	10,108,800
めぶきフィナンシャルグループ	747,200	257.00	192,030,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,400	1,109.00	21,514,600
九州フィナンシャルグループ	314,600	482.00	151,637,200
ゆうちょ銀行	407,400	831.00	338,549,400
富山第一銀行	34,300	262.00	8,986,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	821,300	351.00	288,276,300
西日本フィナンシャルホールディングス	95,700	721.00	68,999,700
関西みらいフィナンシャルグループ	84,400	425.00	35,870,000
三十三フィナンシャルグループ	13,300	1,337.00	17,782,100
第四北越フィナンシャルグループ	25,000	2,033.00	50,825,000
新生銀行	105,500	1,192.00	125,756,000
あおぞら銀行	85,700	1,831.00	156,916,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,836,700	426.70	4,197,319,890
りそなホールディングス	1,563,400	378.60	591,903,240
三井住友トラスト・ホールディングス	271,800	2,960.50	804,663,900
三井住友フィナンシャルグループ	994,500	3,016.00	2,999,412,000
千葉銀行	479,900	542.00	260,105,800
群馬銀行	276,200	356.00	98,327,200
武蔵野銀行	21,400	1,547.00	33,105,800
千葉興業銀行	39,400	229.00	9,022,600
筑波銀行	59,800	167.00	9,986,600
七十七銀行	48,600	1,545.00	75,087,000
青森銀行	11,100	2,149.00	23,853,900

秋田銀行	9,200	1,454.00	13,376,800
山形銀行	16,200	1,337.00	21,659,400
岩手銀行	9,400	2,534.00	23,819,600
東邦銀行	128,600	225.00	28,935,000
東北銀行	6,900	991.00	6,837,900
みちのく銀行	9,200	1,061.00	9,761,200
ふくおかフィナンシャルグループ	121,100	1,677.00	203,084,700
静岡銀行	350,200	733.00	256,696,600
十六銀行	18,000	1,953.00	35,154,000
スルガ銀行	147,100	368.00	54,132,800
八十二銀行	347,000	408.00	141,576,000
山梨中央銀行	16,700	842.00	14,061,400
大垣共立銀行	28,400	2,216.00	62,934,400
福井銀行	12,300	1,717.00	21,119,100
北國銀行	14,300	3,005.00	42,971,500
清水銀行	5,900	1,611.00	9,504,900
富山銀行	2,800	2,317.00	6,487,600
滋賀銀行	28,800	2,477.00	71,337,600
南都銀行	23,900	1,982.00	47,369,800
百五銀行	129,400	324.00	41,925,600
京都銀行	51,500	4,360.00	224,540,000
紀陽銀行	50,900	1,546.00	78,691,400
ほくほくフィナンシャルグループ	95,700	981.00	93,881,700
広島銀行	212,300	511.00	108,485,300
山陰合同銀行	85,300	533.00	45,464,900
中国銀行	123,700	984.00	121,720,800
鳥取銀行	4,900	1,115.00	5,463,500
伊予銀行	205,200	667.00	136,868,400
百十四銀行	15,300	1,805.00	27,616,500
四国銀行	21,800	780.00	17,004,000
阿波銀行	23,500	2,402.00	56,447,000
大分銀行	8,300	2,498.00	20,733,400
宮崎銀行	9,600	2,385.00	22,896,000
佐賀銀行	8,700	1,254.00	10,909,800
沖縄銀行	13,200	2,949.00	38,926,800
琉球銀行	33,200	875.00	29,050,000
セブン銀行	480,400	269.00	129,227,600
みずほフィナンシャルグループ	19,539,800	142.00	2,774,651,600
高知銀行	5,200	675.00	3,510,000
山口フィナンシャルグループ	179,500	705.00	126,547,500
長野銀行	4,700	1,064.00	5,000,800
名古屋銀行	10,700	2,444.00	26,150,800

北洋銀行	216,800	222.00	48,129,600
愛知銀行	5,200	2,866.00	14,903,200
中京銀行	5,900	2,027.00	11,959,300
大光銀行	4,900	1,239.00	6,071,100
愛媛銀行	20,100	1,158.00	23,275,800
トマト銀行	5,600	1,029.00	5,762,400
京葉銀行	61,300	492.00	30,159,600
栃木銀行	69,500	163.00	11,328,500
北日本銀行	4,500	1,682.00	7,569,000
東和銀行	25,200	673.00	16,959,600
福島銀行	13,500	154.00	2,079,000
大東銀行	7,500	619.00	4,642,500
トモニホールディングス	111,200	339.00	37,696,800
フィデアホールディングス	139,600	103.00	14,378,800
池田泉州ホールディングス	165,400	164.00	27,125,600
F P G	44,700	515.00	23,020,500
マーキュリアインベストメント	5,900	588.00	3,469,200
S B Iホールディングス	160,700	2,327.00	373,948,900
ジャフコ	22,100	4,075.00	90,057,500
大和証券グループ本社	1,154,200	478.30	552,053,860
野村ホールディングス	2,530,500	534.50	1,352,552,250
岡三証券グループ	123,100	318.00	39,145,800
丸三証券	43,100	418.00	18,015,800
東洋証券	53,100	105.00	5,575,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	165,900	249.00	41,309,100
光世証券	3,800	568.00	2,158,400
水戸証券	42,500	197.00	8,372,500
いちよし証券	27,300	430.00	11,739,000
松井証券	82,400	925.00	76,220,000
マネックスグループ	106,300	263.00	27,956,900
極東証券	19,600	571.00	11,191,600
岩井コスモホールディングス	13,700	1,236.00	16,933,200
藍澤證券	26,100	685.00	17,878,500
マネーパートナーズグループ	16,200	206.00	3,337,200
スパークス・グループ	67,300	206.00	13,863,800
かんぽ生命保険	50,900	1,604.00	81,643,600
S O M P Oホールディングス	270,400	3,909.00	1,056,993,600
アニコムホールディングス	11,900	4,440.00	52,836,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	376,000	2,895.00	1,088,520,000
第一生命ホールディングス	813,700	1,478.00	1,202,648,600
東京海上ホールディングス	508,400	4,816.00	2,448,454,400
T & Dホールディングス	429,800	1,033.00	443,983,400

アドバンスクリエイト	3,000	2,024.00	6,072,000
全国保証	40,500	3,815.00	154,507,500
イントラスト	5,100	905.00	4,615,500
日本モーゲージサービス	2,900	2,645.00	7,670,500
C a s a	5,100	1,080.00	5,508,000
アルヒ	22,900	1,638.00	37,510,200
プレミアグループ	7,800	1,888.00	14,726,400
クレディセゾン	100,800	1,128.00	113,702,400
芙蓉総合リース	15,100	6,260.00	94,526,000
みずほリース	22,200	2,543.00	56,454,600
東京センチュリー	29,000	5,710.00	165,590,000
日本証券金融	63,500	505.00	32,067,500
アイフル	219,600	247.00	54,241,200
リコーリース	11,300	2,768.00	31,278,400
イオンフィナンシャルサービス	88,100	921.00	81,140,100
アコム	289,200	405.00	117,126,000
ジャックス	15,900	1,703.00	27,077,700
オリエントコーポレーション	389,500	113.00	44,013,500
日立キャピタル	33,900	2,610.00	88,479,000
アプラスフィナンシャル	69,800	74.00	5,165,200
オリックス	892,200	1,278.00	1,140,231,600
三菱UFJリース	365,100	495.00	180,724,500
九州リースサービス	7,200	577.00	4,154,400
日本取引所グループ	412,800	2,718.00	1,121,990,400
イー・ギャランティ	15,400	2,253.00	34,696,200
アサックス	7,600	698.00	5,304,800
NECキャピタルソリューション	5,900	1,788.00	10,549,200
いちご	189,600	272.00	51,571,200
日本駐車場開発	155,600	134.00	20,850,400
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	1,262.00	11,231,800
ADワークスグループ	26,700	162.00	4,325,400
ヒューリック	307,000	948.00	291,036,000
三栄建築設計	7,200	1,295.00	9,324,000
野村不動産ホールディングス	88,300	1,978.00	174,657,400
三重交通グループホールディングス	33,100	429.00	14,199,900
サムティ	21,900	1,275.00	27,922,500
ディア・ライフ	23,800	544.00	12,947,200
日本商業開発	10,300	1,596.00	16,438,800
ハウスコム	4,000	1,243.00	4,972,000
日本管理センター	9,300	1,200.00	11,160,000
サンセイランディック	6,900	718.00	4,954,200
フージャースホールディングス	28,700	579.00	16,617,300

オープンハウス	45,800	3,515.00	160,987,000
東急不動産ホールディングス	395,100	444.00	175,424,400
飯田グループホールディングス	120,900	2,037.00	246,273,300
イーランド	5,000	702.00	3,510,000
ムゲンエステート	12,700	470.00	5,969,000
ハウズドゥ	7,100	903.00	6,411,300
シーアールイー	5,000	1,311.00	6,555,000
グッドコムアセット	4,500	1,797.00	8,086,500
ジェイ・エス・ビー	3,300	2,767.00	9,131,100
テンポイノベーション	5,900	711.00	4,194,900
パーク24	78,400	1,697.00	133,044,800
パラカ	4,800	1,680.00	8,064,000
三井不動産	710,200	1,836.50	1,304,282,300
三菱地所	1,008,600	1,650.00	1,664,190,000
平和不動産	27,100	2,707.00	73,359,700
東京建物	143,500	1,244.00	178,514,000
ダイビル	38,700	1,081.00	41,834,700
京阪神ビルディング	24,400	1,438.00	35,087,200
住友不動産	323,800	3,093.00	1,001,513,400
テオーシー	30,800	654.00	20,143,200
東京楽天地	2,800	4,010.00	11,228,000
スターツコーポレーション	20,400	2,178.00	44,431,200
フジ住宅	20,300	501.00	10,170,300
空港施設	18,700	421.00	7,872,700
明和地所	12,200	471.00	5,746,200
ゴールドクレスト	12,600	1,463.00	18,433,800
エスリード	7,100	1,241.00	8,811,100
日神グループホールディングス	26,100	374.00	9,761,400
日本エスコン	26,000	757.00	19,682,000
タカラレーベン	65,700	337.00	22,140,900
A V A N T I A	10,200	871.00	8,884,200
イオンモール	73,400	1,369.00	100,484,600
毎日コムネット	6,100	757.00	4,617,700
ファースト住建	8,000	962.00	7,696,000
カチタス	36,300	2,659.00	96,521,700
トーセイ	21,800	923.00	20,121,400
穴吹興産	4,400	1,473.00	6,481,200
サンフロンティア不動産	22,000	796.00	17,512,000
エフ・ジェー・ネクスト	14,800	814.00	12,047,200
インテリックス	4,000	479.00	1,916,000
ランドビジネス	4,800	359.00	1,723,200
サンネクスタグループ	6,200	969.00	6,007,800

グランディハウス	16,300	341.00	5,558,300
日本空港ビルディング	46,300	4,425.00	204,877,500
日本工営	9,400	2,779.00	26,122,600
LIFULL	49,000	467.00	22,883,000
ミクシィ	26,600	2,436.00	64,797,600
ジェイエイシーリクルートメント	9,500	1,234.00	11,723,000
日本M&Aセンター	105,300	5,350.00	563,355,000
メンバーズ	4,200	1,623.00	6,816,600
中広	2,300	523.00	1,202,900
UTグループ	22,000	2,909.00	63,998,000
アイティメディア	5,700	2,687.00	15,315,900
タケエイ	13,500	1,138.00	15,363,000
E・Jホールディングス	2,500	2,407.00	6,017,500
ビーネックスグループ	17,600	1,137.00	20,011,200
コシダカホールディングス	34,000	418.00	14,212,000
アルトナー	3,600	916.00	3,297,600
パソナグループ	15,200	1,386.00	21,067,200
CDS	3,600	1,269.00	4,568,400
リンクアンドモチベーション	26,200	322.00	8,436,400
GCA	18,200	597.00	10,865,400
エス・エム・エス	43,400	2,945.00	127,813,000
サニーサイドアップグループ	5,100	658.00	3,355,800
パーソルホールディングス	139,400	1,654.00	230,567,600
リニカル	6,900	791.00	5,457,900
クックパッド	44,300	385.00	17,055,500
エスクリ	4,900	335.00	1,641,500
アイ・ケイ・ケイ	7,100	553.00	3,926,300
学情	5,100	1,003.00	5,115,300
スタジオアリス	7,100	1,550.00	11,005,000
シミックホールディングス	7,000	1,293.00	9,051,000
エプコ	3,500	962.00	3,367,000
NJS	3,500	1,729.00	6,051,500
総合警備保障	55,500	5,160.00	286,380,000
カカクコム	103,000	2,588.00	266,564,000
アイロムグループ	5,000	2,138.00	10,690,000
セントケア・ホールディング	9,400	538.00	5,057,200
サイネックス	2,600	651.00	1,692,600
ルネサンス	8,000	868.00	6,944,000
ディップ	19,700	2,152.00	42,394,400
デジタルホールディングス	9,800	1,134.00	11,113,200
ツクイ	33,100	611.00	20,224,100
キャリアデザインセンター	3,400	833.00	2,832,200

ベネフィット・ワン	50,800	2,573.00	130,708,400
エムスリー	307,200	6,130.00	1,883,136,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,100	237.00	2,630,700
アウトソーシング	80,000	765.00	61,200,000
ウェルネット	14,300	619.00	8,851,700
ワールドホールディングス	4,900	1,715.00	8,403,500
ディー・エヌ・エー	59,000	1,697.00	100,123,000
博報堂DYホールディングス	193,900	1,319.00	255,754,100
ぐるなび	24,600	564.00	13,874,400
タカミヤ	15,100	540.00	8,154,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,000	879.00	9,669,000
ファンコミュニケーションズ	38,700	465.00	17,995,500
ライク	4,700	1,827.00	8,586,900
ビジネス・ブレークスルー	6,200	393.00	2,436,600
エスプール	36,000	708.00	25,488,000
WDBホールディングス	6,400	2,824.00	18,073,600
手間いらず	900	4,665.00	4,198,500
ティア	8,500	441.00	3,748,500
C D G	1,600	1,648.00	2,636,800
バリューコマース	9,400	3,395.00	31,913,000
インフォーマート	141,200	704.00	99,404,800
J Pホールディングス	44,400	280.00	12,432,000
エコナックホールディングス	27,200	88.00	2,393,600
E P Sホールディングス	19,000	1,015.00	19,285,000
レグス	3,600	974.00	3,506,400
プレステージ・インターナショナル	52,400	940.00	49,256,000
アミューズ	7,700	2,210.00	17,017,000
ドリームインキュベータ	4,400	1,309.00	5,759,600
クイック	8,800	1,253.00	11,026,400
T A C	9,300	187.00	1,739,100
ケネディクス	120,200	481.00	57,816,200
電通グループ	156,700	2,764.00	433,118,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,700	479.00	2,730,300
ぴあ	4,000	2,747.00	10,988,000
イオンファンタジー	5,500	1,592.00	8,756,000
シーティーエス	15,900	821.00	13,053,900
ネクシィーズグループ	4,500	813.00	3,658,500
H . U . グループホールディングス	39,000	2,385.00	93,015,000
アルプス技研	12,400	1,849.00	22,927,600
ダイオーズ	2,900	929.00	2,694,100
日本空調サービス	14,800	695.00	10,286,000
オリエンタルランド	148,200	13,645.00	2,022,189,000

ダスキン	34,700	2,666.00	92,510,200
明光ネットワークジャパン	17,900	752.00	13,460,800
ファルコホールディングス	7,800	1,400.00	10,920,000
ラウンドワン	39,100	759.00	29,676,900
リゾートトラスト	64,000	1,328.00	84,992,000
ビー・エム・エル	18,000	2,767.00	49,806,000
りらいあコミュニケーションズ	25,300	1,166.00	29,499,800
リソー教育	64,200	313.00	20,094,600
早稲田アカデミー	6,200	917.00	5,685,400
ユー・エス・エス	156,100	1,787.00	278,950,700
東京個別指導学院	5,300	523.00	2,771,900
サイバーエージェント	85,900	5,880.00	505,092,000
楽天	649,500	930.00	604,035,000
クリーク・アンド・リバー社	7,400	1,297.00	9,597,800
テー・オー・ダブリュー	22,800	296.00	6,748,800
山田コンサルティンググループ	9,200	1,095.00	10,074,000
セントラルスポーツ	5,300	2,155.00	11,421,500
フルキャストホールディングス	12,300	1,520.00	18,696,000
エン・ジャパン	24,800	2,905.00	72,044,000
リソルホールディングス	1,600	3,355.00	5,368,000
テクノプロ・ホールディングス	27,800	5,620.00	156,236,000
アトラ	3,200	249.00	796,800
インターワークス	3,200	334.00	1,068,800
アイ・アールジャパンホールディングス	5,700	12,520.00	71,364,000
Keeper 技研	5,200	2,078.00	10,805,600
ファーストロジック	2,900	707.00	2,050,300
三機サービス	2,800	1,025.00	2,870,000
Gunosy	8,900	913.00	8,125,700
デザインワン・ジャパン	4,800	250.00	1,200,000
イー・ガーディアン	6,200	3,300.00	20,460,000
リブセンス	8,300	283.00	2,348,900
ジャパンマテリアル	42,900	1,489.00	63,878,100
ベクトル	17,600	861.00	15,153,600
ウチヤマホールディングス	7,500	287.00	2,152,500
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	932.00	11,184,000
キャリアリンク	4,800	875.00	4,200,000
I B J	11,600	864.00	10,022,400
アサンテ	5,700	1,422.00	8,105,400
N・フィールド	9,900	592.00	5,860,800
バリューHR	5,600	1,409.00	7,890,400
M&Aキャピタルパートナーズ	11,300	4,095.00	46,273,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	3,065.00	16,551,000

ERIホールディングス	4,200	580.00	2,436,000
アシスト	2,200	2,755.00	6,061,000
シグマクシス	9,700	1,384.00	13,424,800
ウィルグループ	9,400	730.00	6,862,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,200	312.00	6,614,400
リクルートホールディングス	998,100	3,831.00	3,823,721,100
エラン	9,700	2,349.00	22,785,300
土木管理総合試験所	7,300	365.00	2,664,500
ネットマーケティング	5,700	577.00	3,288,900
日本郵政	1,142,100	770.60	880,102,260
ベルシステム24ホールディングス	23,400	1,760.00	41,184,000
鎌倉新書	10,700	910.00	9,737,000
S MN	3,200	947.00	3,030,400
L I T A L I C O	4,900	2,406.00	11,789,400
グローバルキッズCOMPANY	2,800	639.00	1,789,200
エアトリ	7,300	1,255.00	9,161,500
アトラエ	4,300	3,120.00	13,416,000
ストライク	5,300	4,860.00	25,758,000
ソラスト	38,600	1,183.00	45,663,800
セラク	4,500	1,240.00	5,580,000
インソース	5,900	2,768.00	16,331,200
ベйкаレント・コンサルティング	8,500	11,520.00	97,920,000
Orchestra Holdings	3,000	1,532.00	4,596,000
アイモバイル	5,200	903.00	4,695,600
キャリアインデックス	6,100	505.00	3,080,500
MS - Japan	4,700	858.00	4,032,600
船場	3,000	870.00	2,610,000
グレイステクノロジー	6,500	4,460.00	28,990,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,700	3,720.00	54,684,000
フルテック	2,100	1,294.00	2,717,400
グリーンズ	3,900	439.00	1,712,100
GameWith	4,400	638.00	2,807,200
ソウルドアウト	3,400	1,612.00	5,480,800
MS&Consulting	2,900	575.00	1,667,500
ミダック	1,900	1,709.00	3,247,100
日総工産	9,600	662.00	6,355,200
キュービーネットホールディングス	5,900	1,839.00	10,850,100
RPAホールディングス	10,800	772.00	8,337,600
スプリックス	4,100	843.00	3,456,300
マネジメントソリューションズ	6,900	1,079.00	7,445,100
プロレド・パートナーズ	1,900	5,230.00	9,937,000
and factory	1,300	931.00	1,210,300

ギークス	1,600	1,247.00	1,995,200
カーブスホールディングス	38,500	638.00	24,563,000
フォーラムエンジニアリング	7,500	762.00	5,715,000
アドバンテッジリスクマネジメント	7,300	689.00	5,029,700
リログループ	76,200	1,984.00	151,180,800
東祥	8,800	1,271.00	11,184,800
エイチ・アイ・エス	21,700	1,678.00	36,412,600
ラックランド	4,000	2,184.00	8,736,000
共立メンテナンス	23,100	3,450.00	79,695,000
イチネンホールディングス	15,800	1,170.00	18,486,000
建設技術研究所	9,100	1,860.00	16,926,000
スペース	9,200	828.00	7,617,600
長大	5,700	1,210.00	6,897,000
燦ホールディングス	6,200	1,136.00	7,043,200
スバル興業	900	7,430.00	6,687,000
東京テアトル	5,600	1,225.00	6,860,000
タナベ経営	2,800	1,330.00	3,724,000
ナガワ	4,500	7,360.00	33,120,000
よみうりランド	3,100	3,740.00	11,594,000
東京都競馬	9,200	5,080.00	46,736,000
カナモト	24,600	2,246.00	55,251,600
東京ドーム	56,700	757.00	42,921,900
西尾レントオール	12,900	2,221.00	28,650,900
トランス・コスモス	13,300	2,929.00	38,955,700
乃村工藝社	59,900	710.00	42,529,000
藤田観光	5,500	1,385.00	7,617,500
KNT-CTホールディングス	8,700	835.00	7,264,500
日本管財	15,000	1,947.00	29,205,000
トーカイ	13,500	2,134.00	28,809,000
セコム	147,900	10,170.00	1,504,143,000
セントラル警備保障	6,800	3,535.00	24,038,000
丹青社	26,600	643.00	17,103,800
メイテック	17,100	5,130.00	87,723,000
応用地質	16,400	1,221.00	20,024,400
船井総研ホールディングス	28,900	2,398.00	69,302,200
進学会ホールディングス	5,900	421.00	2,483,900
オオバ	10,200	720.00	7,344,000
いであ	3,500	1,826.00	6,391,000
学究社	4,200	1,076.00	4,519,200
ベネッセホールディングス	46,500	2,650.00	123,225,000
イオンディライト	17,200	3,110.00	53,492,000
ナック	7,900	925.00	7,307,500

ダイセキ	23,400	2,482.00	58,078,800	
ステップ	5,200	1,479.00	7,690,800	
合 計	170,608,200		326,737,392,360	

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	345,411,757
国債証券	459,921,097,900
地方債証券	29,922,657,638
特殊債証券	37,878,905,561
社債証券	22,738,756,560
未収利息	1,235,346,380
前払費用	22,810,366
流動資産合計	552,064,986,162
資産合計	552,064,986,162
負債の部	
流動負債	
未払解約金	191,243,163
未払利息	586
流動負債合計	191,243,749
負債合計	191,243,749
純資産の部	
元本等	
元本	392,109,031,403
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	159,764,711,010
元本等合計	551,873,742,413
純資産合計	551,873,742,413
負債純資産合計	552,064,986,162

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8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 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	392,109,031,403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 101,295,000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 1.4074円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,074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 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2020年 8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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8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)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	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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	339,472,890,353円
期中追加設定元本額	92,068,995,189円
期中一部解約元本額	39,432,854,139円
期末元本額	392,109,031,403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）	3,672,292,522円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,341,834円
S M T 国内債券インデックス・オープン	19,154,084,142円
世界経済インデックスファンド	2,067,726,109円
D C マイセレクション 2 5	21,895,401,498円
D C マイセレクション 5 0	23,507,750,506円
D C マイセレクション 7 5	6,098,478,618円
D C 日本債券インデックス・オープン	451,919,057円
D C 日本債券インデックス・オープン S	90,980,245,906円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,850,435,045円
D C マイセレクション S 2 5	9,518,725,466円
D C マイセレクション S 5 0	10,004,807,266円
D C マイセレクション S 7 5	1,984,987,527円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,101,228,581円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,485,483,227円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	511,030,574円
D C 世界経済インデックスファンド	2,645,864,635円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	23,644,274円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,248,070円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	41,067,263円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	10,729,027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）	148,418,564円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	204,423,819円

区分	2020年 8月20日現在
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	52,856,778円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	75,829,744円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,813,398,671円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	836,798,456円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,438,247,215円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	774,217,171円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	90,243,030円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,131,620,052円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	26,598,750円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,298,738,719円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,633,585,421円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	149,420,301円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,900,878,639円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,803,221,854円
分散投資コア戦略ファンドA	11,984,605,676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)	93,151,532円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	953,278,147円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	46,633,554円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30,601,117円
SMT インデックスバランス・オープン	55,564,173円
SMT 世界経済インデックス・オープン	15,877,741円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	28,421,144円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	42,372,979円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,925,887円
グローバル経済コア	216,774,021円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,809,543円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,482,648円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	275,480円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	279,251円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	63,702円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	37,244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)	72,809,501,856円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	15,127,970円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 8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	3,138,290,400
地方債証券	41,803,892

特殊債券	100,552,610
社債券	11,160,530
合計	3,291,807,432

(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404回利付国債(2年)	460,000,000	461,090,200	
	第405回利付国債(2年)	470,000,000	471,226,700	
	第406回利付国債(2年)	780,000,000	782,191,800	
	第407回利付国債(2年)	360,000,000	361,083,600	
	第408回利付国債(2年)	690,000,000	692,214,900	
	第409回利付国債(2年)	2,610,000,000	2,618,900,100	
	第410回利付国債(2年)	390,000,000	391,400,100	
	第412回利付国債(2年)	780,000,000	783,369,600	
	第413回利付国債(2年)	1,640,000,000	1,647,002,800	
	第414回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,410,272,000	
	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,348,316,600	
	第130回利付国債(5年)	3,160,000,000	3,169,669,600	
	第131回利付国債(5年)	4,990,000,000	5,008,113,700	
	第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	4,790,081,700	
	第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,400,542,200	
	第134回利付国債(5年)	6,050,000,000	6,081,823,000	
	第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,103,704,800	
	第136回利付国債(5年)	4,140,000,000	4,166,454,600	
	第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	6,946,920,000	
	第138回利付国債(5年)	9,420,000,000	9,489,237,000	
第139回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,413,813,600		

第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	7,360,371,000	
第141回利付国債(5年)	6,020,000,000	6,073,036,200	
第142回利付国債(5年)	6,050,000,000	6,105,236,500	
第143回利付国債(5年)	3,950,000,000	3,986,300,500	
第144回利付国債(5年)	1,910,000,000	1,927,591,100	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	587,040,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,610,340,400	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	788,887,000	
第4回利付国債(40年)	1,000,000,000	1,445,140,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,497,497,100	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,739,556,000	
第7回利付国債(40年)	830,000,000	1,103,667,600	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	996,112,000	
第9回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,052,922,700	
第10回利付国債(40年)	1,990,000,000	2,175,587,400	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,899,762,800	
第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,641,001,500	
第13回利付国債(40年)	280,000,000	268,466,800	
第317回利付国債(10年)	890,000,000	901,854,800	
第318回利付国債(10年)	2,260,000,000	2,287,662,400	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,738,044,000	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,638,869,900	
第321回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,646,436,000	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	762,210,000	
第323回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,966,457,700	
第324回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,786,744,400	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,976,385,200	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,180,184,800	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,258,967,800	
第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,463,750,000	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,308,770,000	
第330回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,738,097,400	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	920,043,000	
第332回利付国債(10年)	3,110,000,000	3,184,888,800	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,389,834,400	
第334回利付国債(10年)	1,790,000,000	1,839,225,000	
第335回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,511,789,000	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	523,535,400	
第337回利付国債(10年)	2,950,000,000	3,002,628,000	
第338回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,130,349,400	
第339回利付国債(10年)	5,050,000,000	5,170,038,500	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,478,063,200	

第341回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,205,122,400	
第342回利付国債(10年)	6,380,000,000	6,447,947,000	
第343回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,286,172,500	
第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	7,020,573,400	
第345回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,317,686,100	
第346回利付国債(10年)	5,200,000,000	5,265,364,000	
第347回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,026,100,000	
第348回利付国債(10年)	4,840,000,000	4,903,791,200	
第349回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,171,535,100	
第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	5,864,980,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,590,000,000	3,635,162,200	
第352回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,239,274,400	
第353回利付国債(10年)	4,470,000,000	4,520,421,600	
第354回利付国債(10年)	4,680,000,000	4,730,263,200	
第355回利付国債(10年)	4,870,000,000	4,919,479,200	
第356回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,837,362,800	
第357回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,693,656,200	
第358回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,699,800,400	
第359回利付国債(10年)	1,950,000,000	1,964,332,500	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	137,910,300	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	196,297,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	146,610,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	142,039,700	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	61,358,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	238,744,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	225,446,400	
第8回利付国債(30年)	140,000,000	167,998,600	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	276,489,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,433,600	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	107,289,900	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	236,776,100	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	358,480,600	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	387,501,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	444,941,000	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	262,464,000	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	742,122,900	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	445,415,700	
第19回利付国債(30年)	380,000,000	491,746,600	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	636,964,800	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	650,385,000	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	533,744,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	575,572,200	

第24回利付国債(30年)	380,000,000	510,214,600
第25回利付国債(30年)	350,000,000	459,693,500
第26回利付国債(30年)	530,000,000	706,325,700
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,368,832,800
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,234,975,600
第29回利付国債(30年)	1,520,000,000	2,055,146,400
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,372,065,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,461,394,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,111,553,600
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,370,113,200
第34回利付国債(30年)	1,735,000,000	2,335,431,450
第35回利付国債(30年)	1,940,000,000	2,543,495,200
第36回利付国債(30年)	1,950,000,000	2,564,640,000
第37回利付国債(30年)	2,000,000,000	2,598,140,000
第38回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,576,786,200
第39回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,566,720,000
第40回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,504,994,400
第41回利付国債(30年)	730,000,000	924,618,000
第42回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,711,530,000
第43回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,598,965,200
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,549,656,200
第45回利付国債(30年)	990,000,000	1,213,967,700
第46回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,036,703,800
第47回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,689,187,500
第48回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,194,829,000
第49回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,495,960,800
第50回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,181,495,100
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,735,948,000
第52回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,585,360,000
第53回利付国債(30年)	690,000,000	699,542,700
第54回利付国債(30年)	2,200,000,000	2,338,380,000
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,104,656,800
第56回利付国債(30年)	1,940,000,000	2,059,154,800
第57回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,644,007,500
第58回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,812,360,600
第59回利付国債(30年)	120,000,000	124,044,000
第60回利付国債(30年)	2,530,000,000	2,745,378,900
第61回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,372,174,300
第62回利付国債(30年)	20,000,000	19,583,600
第63回利付国債(30年)	900,000,000	855,756,000
第64回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,613,810,000
第65回利付国債(30年)	860,000,000	815,065,000
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	974,575,700

第67回利付国債(30年)	530,000,000	529,326,900	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	112,664,200	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	82,373,600	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	206,200,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	144,723,600	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	155,845,500	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	248,913,600	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	312,681,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	208,534,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	362,477,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	246,981,600	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	328,358,400	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	210,904,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	339,942,400	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	234,823,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	351,133,200	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	139,386,000	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	205,766,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	420,958,200	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	438,616,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	217,770,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	687,090,600	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	393,058,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	219,236,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	143,153,400	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	294,834,600	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	318,008,200	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	186,365,900	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	297,302,400	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	243,313,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	431,503,800	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	666,912,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	323,935,800	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	522,480,200	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	325,513,400	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	238,070,700	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	620,433,000	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	478,690,800	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	396,858,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	718,011,000	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	515,614,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,002,399,200	

第93回利付国債(20年)	410,000,000	466,547,200
第94回利付国債(20年)	610,000,000	698,163,300
第95回利付国債(20年)	610,000,000	709,948,500
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,828,659,000
第97回利付国債(20年)	400,000,000	464,956,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	508,318,800
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,334,391,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	562,795,200
第101回利付国債(20年)	715,000,000	849,219,800
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,503,255,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	474,076,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	421,005,600
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,385,308,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	449,198,000
第107回利付国債(20年)	260,000,000	306,381,400
第108回利付国債(20年)	660,000,000	766,708,800
第109回利付国債(20年)	520,000,000	606,049,600
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,123,536,500
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,159,964,800
第112回利付国債(20年)	790,000,000	937,730,000
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,727,327,000
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,785,282,000
第115回利付国債(20年)	700,000,000	843,311,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,801,380,200
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,295,362,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	787,815,600
第119回利付国債(20年)	530,000,000	622,246,500
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,812,470,800
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,781,055,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,106,680,800
第123回利付国債(20年)	1,430,000,000	1,731,301,000
第124回利付国債(20年)	610,000,000	732,256,200
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,004,450,800
第126回利付国債(20年)	730,000,000	878,861,600
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,217,268,000
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,160,168,500
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,054,925,900
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,526,104,550
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,176,660,000
第132回利付国債(20年)	950,000,000	1,120,306,500
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,464,278,100
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,347,547,600
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,433,000

第136回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,719,414,900	
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,325,632,000	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	719,379,800	
第139回利付国債(20年)	580,000,000	679,731,000	
第140回利付国債(20年)	2,010,000,000	2,383,960,500	
第141回利付国債(20年)	1,780,000,000	2,115,316,400	
第142回利付国債(20年)	640,000,000	768,320,000	
第143回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,330,631,500	
第144回利付国債(20年)	1,740,000,000	2,027,482,800	
第145回利付国債(20年)	2,515,000,000	2,998,156,650	
第146回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,699,050,200	
第147回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,484,993,000	
第148回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,670,039,600	
第149回利付国債(20年)	3,010,000,000	3,529,465,800	
第150回利付国債(20年)	3,670,000,000	4,258,594,600	
第151回利付国債(20年)	1,255,000,000	1,422,906,450	
第152回利付国債(20年)	2,470,000,000	2,801,992,700	
第153回利付国債(20年)	2,570,000,000	2,953,752,400	
第154回利付国債(20年)	2,920,000,000	3,315,922,800	
第155回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,268,632,500	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,990,634,800	
第157回利付国債(20年)	2,820,000,000	2,773,188,000	
第158回利付国債(20年)	2,320,000,000	2,387,512,000	
第159回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,879,922,000	
第160回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,562,731,600	
第161回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,823,867,500	
第162回利付国債(20年)	580,000,000	603,855,400	
第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,714,400,000	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,819,676,200	
第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,674,259,600	
第166回利付国債(20年)	900,000,000	949,527,000	
第167回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,791,539,400	
第168回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,391,195,400	
第169回利付国債(20年)	760,000,000	746,031,200	
第170回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,363,077,300	
第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,263,438,900	
第172回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,355,076,800	
第173回利付国債(20年)	840,000,000	836,152,800	
国債証券合計	426,720,000,000	459,921,097,900	
地方債証券			
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,991,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,056,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	133,850,000	

第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,049,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,224,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,123,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,499,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,613,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,906,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,508,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	101,070,000	
第702回東京都公募公債	100,000,000	101,353,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	101,738,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	101,560,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	102,392,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	102,082,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,620,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,949,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,781,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	301,866,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	198,984,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,905,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,741,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,999,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,004,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	136,628,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,062,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,458,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,732,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,690,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,851,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,781,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	198,892,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	235,498,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,631,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,446,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,400,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,061,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,826,720	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,453,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,193,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,131,040	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,124,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	500,000,000	503,225,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	118,666,000	

平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	117,372,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	102,385,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,572,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	98,823,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	103,244,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	104,074,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	116,154,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,439,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	439,484,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,356,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	202,822,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,332,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,918,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	101,865,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	300,558,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	119,756,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,893,000	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,180,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,687,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,849,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,985,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,055,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	118,924,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,254,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,597,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,361,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,707,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,029,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,168,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	308,220,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,840,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	102,520,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	199,342,000	
	100,000,000	118,116,000	

平成20年度第1回広島県公募公債(20年)			
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,784,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,928,706	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,740,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	116,010,000	
第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	117,218,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,946,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	107,018,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	236,070,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	197,560,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,723,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,004,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,264,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,153,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,121,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,193,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,851,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,159,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,168,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	108,404,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	119,288,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	108,907,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	131,296,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,572,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,126,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	102,520,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,147,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	300,582,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	234,946,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	118,455,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,326,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	102,453,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,846,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,513,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,121,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,883,200	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	298,728,000	

平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,002,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,650,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,405,000	
第107回共同発行市場公募地方債	800,000,000	811,952,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,570,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,721,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,523,000	
第112回共同発行市場公募地方債	220,000,000	223,456,200	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,998,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,250,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,896,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,393,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,080,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,070,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,042,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,840,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,300,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,166,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,061,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,608,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,064,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,676,702	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,260,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,195,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,084,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,058,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,822,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,876,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,906,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,736,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,168,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,638,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,397,795	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,072,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,403,000	
平成23年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,158,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	203,382,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	99,970,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	101,290,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,290,000	

平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,120,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	238,032,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	297,405,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	103,658,000	
平成29年度第1回大阪市公募公債(5年)	100,000,000	99,973,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	130,804,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	135,923,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	116,334,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	125,112,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,677,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,051,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	300,582,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,395,000	
平成24年度第2回京都市公募公債	122,500,000	124,542,075	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,682,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,029,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,474,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	137,252,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	235,586,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	119,787,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	110,380,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,008,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,420,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,703,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,212,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,913,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,140,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	300,579,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	109,219,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,808,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,775,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	116,915,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,598,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,782,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,116,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,971,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	118,204,000	
平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	101,158,000	

	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	204,318,000
	平成28年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	99,991,000
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,577,000
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,394,500
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,894,000
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,663,600
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,033,200
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	549,477,500
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	202,618,000
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	199,152,000
	平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	100,000,000	102,004,000
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,754,000
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,515,000
	地方債証券合計	28,559,430,000	29,922,657,638
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,610,180
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,276,000
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	310,000,000	315,434,300
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,271,000
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,441,000
	第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,736,000
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	98,211,000
	第14回道路債券	100,000,000	104,373,000
	第17回道路債券	100,000,000	103,510,000
	第21回道路債券	100,000,000	130,348,000
	第28回道路債券	200,000,000	264,016,000
	第33回道路債券	200,000,000	267,734,000
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,035,000
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	153,392,000
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,847,000
	第42回道路債券	100,000,000	109,974,000
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,487,000
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,354,000
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,662,000

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	145,583,000	
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	236,542,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,582,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	508,765,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,586,000	
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	132,647,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	511,530,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,133,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,125,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,363,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,886,000	
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	303,699,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,918,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	305,078,550	
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	202,854,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,898,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,330,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,730,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,656,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,295,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,326,000	
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	102,080,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,291,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,514,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	614,604,000	
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	202,988,000	
	528,000,000	537,097,440	

第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,132,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	151,636,360	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,291,000	
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	102,289,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,474,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,481,660	
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	102,443,000	
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	102,330,000	
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	102,229,000	
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	102,006,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,203,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,894,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,488,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,320,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,717,000	
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	94,773,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,932,590	
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	317,403,040	
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	206,318,150	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,858,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,670,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,940,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,485,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,628,000	
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	309,813,000	
	214,000,000	216,775,580	

第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	110,000,000	110,735,900	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	100,000,000	100,722,000	
第2回公営企業債券(30年)	300,000,000	380,121,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	100,000,000	100,751,000	
第3回公営企業債券(20年)	210,000,000	215,453,700	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	108,774,000	
第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	396,591,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,794,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	132,528,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	43,189,200	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	130,344,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	236,536,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	197,440,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	235,480,000	
第21回地方公共団体金融機構債券(5年)	400,000,000	399,964,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,929,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,202,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,020,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,940,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,763,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,732,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,071,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,514,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,484,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,697,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,536,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,540,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,570,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,300,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,798,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,932,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,027,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,939,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,441,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,641,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	253,085,810	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,009,000	

第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,997,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,356,300	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,934,400	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,290,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,208,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,218,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,942,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,196,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,616,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	109,640,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,993,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,844,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,534,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	204,176,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,034,020	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,013,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,041,600	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,316,930	
第81回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,982,000	
第85回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,916,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	212,454,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	173,334,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	94,860,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,333,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	103,973,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,590,600	
第59回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	507,455,000	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,920,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,609,000	13,016,396	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,054,000	13,508,018	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,393,000	13,918,407	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	205,761,000	205,629,312	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	145,352,000	145,359,267	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,327,000	13,816,767	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,224,000	14,799,787	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	262,245,000	261,529,071	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,554,000	11,745,218	

第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,958,000	24,595,043
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,966,000	14,487,211
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	279,051,000	277,940,377
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	98,650,000	98,560,228
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,613,000	13,016,868
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,761,000	15,420,669
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,598,000	13,003,277
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,734,000	15,411,764
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,818,000
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,345,000	11,437,575
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,649,000	11,744,754
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,448,000	20,702,784
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,926,000	21,320,022
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,373,000	24,101,537
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,881,000	25,526,162
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,519,000	28,492,278
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,508,000	29,489,401
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,698,000	62,881,406
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,877,000	13,264,082
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,329,000	28,952,889
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,900,000	13,288,806
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,711,000	13,194,399
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,400,000	32,348,640
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,879,000	12,200,920
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,895,000	32,951,989
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,892,000	30,760,734
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,889,000	14,565,949
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,046,000	62,489,562
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,039,000	33,938,592
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,479,000	13,996,863
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,194,000	44,639,564
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,989,000	42,237,981
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,151,000	42,442,819
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,756,000	90,396,257
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,363,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,766,000	96,914,495
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,382,000	49,445,959
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,309,000	49,772,379

第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,036,000	50,600,642
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,788,000	43,847,312
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,806,000	43,551,818
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,148,000	49,700,592
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,530,500
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,791,000	133,109,661
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,720,000	178,853,248
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,373,000	50,317,594
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,057,000	52,105,833
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,694,000	52,622,399
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,879,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,715,000	167,814,889
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,272,000	57,157,880
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,010,000	118,161,274
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,394,000
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,505,000	66,489,818
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,872,000	69,751,375
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,378,000	69,583,955
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	208,485,000	216,165,587
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,488,000	144,474,696
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,467,000	70,788,715
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,523,000	76,083,070
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,999,000	79,288,926
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,494,000	83,951,547
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,724,000	84,001,126
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,844,000	84,482,891
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,365,000	85,439,810
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,763,000	85,714,888
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,921,000	87,783,256
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,530,000	88,502,458
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,307,000	88,035,140
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,587,000	88,314,847
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,142,000	88,924,700
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,660,000	178,852,098

第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,398,000	89,120,211	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,094,000	181,015,678	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,620,000	90,364,742	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,866,000	181,067,504	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,400,000	91,130,432	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,134,000	184,174,201	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,294,000	184,320,446	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,464,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,576,000	93,653,584	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,057,000	94,342,117	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,102,000	93,594,509	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,938,000	189,053,252	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,442,000	94,406,112	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,722,000	94,824,299	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,678,000	190,546,432	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,154,000	95,338,614	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,782,000	285,811,986	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,848,000	191,155,451	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,346,000	98,487,618	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,702,000	98,516,440	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,121,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,983,000	
第57回日本学生支援債券	100,000,000	99,982,000	
第58回日本学生支援債券	100,000,000	99,978,000	
第59回日本学生支援債券	200,000,000	199,948,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	109,647,000	
い第800号商工債	200,000,000	200,056,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,015,000	
い第804号商工債	300,000,000	300,051,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,634,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,778,000	

	い第796号農林債	200,000,000	200,020,000	
	第337回信金中金債(5年)	100,000,000	100,176,000	
	第338回信金中金債(5年)	100,000,000	100,182,000	
	第339回信金中金債(5年)	200,000,000	200,378,000	
	第342回信金中金債(5年)	100,000,000	100,179,000	
	第350回信金中金債(5年)	100,000,000	100,102,000	
	第360回信金中金債(5年)	200,000,000	199,562,000	
	第236号商工債(3年)	300,000,000	299,715,000	
	第2回信金中金債(10年)	100,000,000	102,282,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,748,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,005,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,012,000	
	第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,768,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,410,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,184,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,030,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,139,000	
	第42回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,444,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,378,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,013,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,329,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,970,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,820,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	197,660,000	
	特殊債券合計	36,369,697,000	37,878,905,561	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,461,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,593,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	294,744,000	
	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	100,308,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,293,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,482,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,227,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,521,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,504,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,714,000	

第13回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	99,521,000	
第1回H S B C・ホールディングス・ピーエ ルシー円貨社債	100,000,000	100,082,000	
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	203,976,000	
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	400,852,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,613,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,265,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,576,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,648,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	99,778,000	
第11回アサヒグループホールディングス株 式会社無担保社債	100,000,000	99,735,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	101,443,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,579,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,432,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,323,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,717,000	
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	102,125,000	
第11回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	99,948,000	
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	99,669,000	
第25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	100,504,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,904,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	100,119,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,556,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,540,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,612,000	
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	100,036,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	200,000,000	198,532,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	200,000,000	199,952,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,778,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,496,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,951,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	99,564,000	
第42回D I C 株式会社無担保社債	100,000,000	99,763,000	

第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,716,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,270,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,513,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,948,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,706,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,944,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,722,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,350,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,781,000	
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	100,386,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,582,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,987,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,902,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,348,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,142,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,306,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,830,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,832,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,521,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,383,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,275,000	
第11回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
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	100,147,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,670,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,220,000	
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	100,122,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,097,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	95,188,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,770,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,153,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,299,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,393,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,033,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,469,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	97,214,000	
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	119,023,000	

第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	113,891,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,706,000	
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	101,248,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,509,000	
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	303,945,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,830,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,000,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,110,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,887,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,629,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,433,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,834,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
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	199,804,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,857,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,268,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,613,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,584,000	
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	98,919,000	
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	199,398,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,344,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,466,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,795,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,199,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,977,000	
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	102,221,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,024,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,640,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,523,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,624,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,109,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,593,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,042,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,234,000	

第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,527,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,747,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	235,012,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,353,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,454,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,308,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,678,110	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,525,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,122,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,316,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,741,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,758,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,433,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,550,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,038,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	95,227,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	95,394,000	
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	194,098,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,185,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,575,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,141,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,064,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,160,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	101,469,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,084,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,933,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,174,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,941,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,121,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	96,740,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,253,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,750,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,848,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,378,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,540,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,996,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,382,000	

第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,340,000	
第416回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,206,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,639,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,605,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,993,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,294,080	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,856,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,106,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,416,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,753,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,506,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,175,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,766,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,332,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,712,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,004,000	
第317回北海道電力株式会社社債	200,000,000	206,288,000	
第320回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,280,370	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,709,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,012,000	
第344回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,228,000	
第351回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,144,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,704,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,747,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,751,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,744,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	300,642,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,855,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,000,000	
第6回S C S K株式会社無担保社債	100,000,000	99,744,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,662,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	199,696,000	
社債券合計	22,466,000,000	22,738,756,560	
合計		550,461,417,659	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,308,076,354
コール・ローン	317,675,674
株式	407,150,795,041
投資信託受益証券	268,999,007
投資証券	9,502,820,200
派生商品評価勘定	217,425,276
未収入金	357,183
未収配当金	552,222,492
差入委託証拠金	2,193,291,721
流動資産合計	424,511,662,948
資産合計	424,511,662,948
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,616,310
前受金	212,512,016
未払解約金	334,516,929
未払利息	539
流動負債合計	552,645,794
負債合計	552,645,794
純資産の部	
元本等	
元本	148,003,539,860
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	275,955,477,294
元本等合計	423,959,017,154
純資産合計	423,959,017,154
負債純資産合計	424,511,662,948

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2020年 8月20日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2020年 8月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	148,003,539,860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 2.8645円 (1万口当たり純資産額) (28,645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 8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 8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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2020年 8月20日現在
期首	2019年 8月21日
期首元本額	136,510,691,604円
期中追加設定元本額	41,807,267,926円
期中一部解約元本額	30,314,419,670円
期末元本額	148,003,539,860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)	2,345,008,118円
S B I 資産設計オープン(分配型)	7,796,494円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,871,968,443円
世界経済インデックスファンド	8,235,058,740円
外国株式インデックス・オープン	760,609,075円
D C マイセレクション 2 5	997,241,361円
D C マイセレクション 5 0	4,764,990,453円
D C マイセレクション 7 5	4,990,740,983円
D C 外国株式インデックス・オープン	9,750,769,456円
D C マイセレクション S 2 5	420,388,283円
D C マイセレクション S 5 0	2,023,275,239円
D C マイセレクション S 7 5	1,473,819,809円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	93,074,468円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	205,531,114円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	137,471,834円
D C 世界経済インデックスファンド	10,239,050,774円
外国株式インデックス・オープン(S M A 専用)	2,195,137,535円
マイセレクション 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	8,240,554円
マイセレクション 7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	8,261,727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)	37,727,205円
バランス 3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	38,113,821円
バランス 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	132,631,393円
バランス 2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	28,244,806円
バランス 5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	138,825,726円
バランス A (2 5) V A 1(適格機関投資家専用)	550,457,199円
バランス B (3 7 . 5) V A 1(適格機関投資家専用)	307,827,458円
バランス C (5 0) V A 1(適格機関投資家専用)	2,063,760,544円
世界バランス V A 1(適格機関投資家専用)	1,640,634,576円
世界バランス V A 2(適格機関投資家専用)	62,577,881円
バランス D (3 5) V A 1(適格機関投資家専用)	296,397,226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)	7,214,536円
バランス E (2 5) V A 1(適格機関投資家専用)	99,456,957円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,657,830,069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)	1,774,028,602円
外国株式ファンド・シリーズ 1	978,432,089円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,236,946,543円

区分	2020年 8月20日現在
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	6,011,426,415円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,164,012,489円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,178,204,139円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,389,835,358円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	730,916,313円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	38,364,400円
SMT インデックスバランス・オープン	218,385,811円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,130,596,173円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	34,320,912,735円
SMT 世界経済インデックス・オープン	127,839,532円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	425,229,071円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	75,795,618円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,400,994円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	74,343,988円
グローバル経済コア	926,663,484円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,846,997円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,453,355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)	75,791,022円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	772,585円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	1,040,994円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	358,540円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	438,162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)	1,075,028,560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)	1,486,771,551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)	982,644,192円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	345,947,853円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	63,640,036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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	37,649,057,005
投資信託受益証券	9,823,331
投資証券	109,791,711

合計	37,749,025,385
----	----------------

(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 8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	7,432,435,064	-	7,644,947,080	212,512,016
合計		7,432,435,064	-	7,644,947,080	212,512,016

(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 8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	732,040,950	-	732,039,900	1,050
	アメリカドル	562,224,000	-	562,224,000	-
	ユーロ	81,680,950	-	81,685,500	4,550
	イギリスポンド	22,246,400	-	22,246,400	-
	スイスフラン	23,189,600	-	23,192,000	2,400
	スウェーデンク ローナ	12,204,000	-	12,200,000	4,000
	オーストラリアド ル	30,496,000	-	30,492,000	4,000
	売建	82,040,400	-	82,742,400	702,000
	アメリカドル	82,040,400	-	82,742,400	702,000
合計		814,081,350	-	814,782,300	703,050

(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	BAKER HUGHES CO	57,980	16.33	946,813.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	20.10	721,167.90	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	51.68	1,135,719.68	
	CHEVRON CORP	177,002	86.39	15,291,202.78	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	50.02	962,634.90	
	CONOCOPHILLIPS	100,048	39.65	3,966,903.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	16,913	43.30	732,332.90	
	EOG RESOURCES INC	55,564	45.61	2,534,274.04	
	EXXON MOBIL	398,806	41.96	16,733,899.76	
	HALLIBURTON CO	77,539	16.49	1,278,618.11	
	HESS CORP	24,844	48.49	1,204,685.56	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	25.90	365,449.00	
	KINDER MORGAN INC	194,644	14.12	2,748,373.28	
	MARATHON PETROLEUM CORP	62,097	37.18	2,308,766.46	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	12.49	464,153.38	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,482	13.82	1,112,261.24	
	ONEOK INC	41,832	27.86	1,165,439.52	
	PHILLIPS 66	42,441	61.42	2,606,726.22	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	104.77	1,659,975.88	
	SCHLUMBERGER	132,260	19.72	2,608,167.20	
	VALERO ENERGY CORP	39,247	54.26	2,129,542.22	
	WILLIAMS COS	114,214	21.65	2,472,733.10	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	21,038	286.95	6,036,854.10	
	ALBEMARLE CORP	10,180	92.25	939,105.00	
	AMCOR PLC	153,458	11.29	1,732,540.82	
	AVERY DENNISON CORP	7,457	114.25	851,962.25	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	23.74	417,966.44	
	BALL CORP	29,987	75.88	2,275,413.56	
	CELANESE CORP-SERIES A	11,053	100.26	1,108,173.78	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	33.58	640,404.18	
CORTEVA INC	70,180	28.56	2,004,340.80		
CROWN HOLDINGS INC	12,992	74.48	967,644.16		

DOW INC	70,834	44.64	3,162,029.76
DUPONT DE NEMOURS INC	70,752	56.27	3,981,215.04
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	14,194	71.88	1,020,264.72
ECOLAB INC	23,561	194.06	4,572,247.66
FMC CORP	12,118	108.53	1,315,166.54
FREEMONT-MCMORAN INC	138,927	14.94	2,075,569.38
INT'L PAPER CO	33,803	36.20	1,223,668.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,795	121.98	1,072,814.10
LINDE PLC	50,427	247.24	12,467,571.48
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	67.63	1,725,444.19
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	212.19	1,269,108.39
MOSAIC CO/THE	31,911	17.93	572,164.23
NEWMONT CORPORATION	74,251	65.98	4,899,080.98
NUCOR CORP	29,015	45.79	1,328,596.85
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	98.11	872,197.90
PPG INDUSTRIES INC	22,118	118.64	2,624,079.52
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	84.94	1,055,804.20
SEALED AIR CORP	14,689	41.58	610,768.62
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,930	665.09	5,274,163.70
STEEL DYNAMICS INC	18,273	30.17	551,296.41
VULCAN MATERIALS CO	12,657	127.03	1,607,818.71
WESTROCK CO	24,734	29.25	723,469.50
3 M COMPANY	54,004	163.97	8,855,035.88
AERCAP HOLDINGS NV	10,498	30.58	321,028.84
ALLEGION PLC	8,963	100.71	902,663.73
AMETEK INC	22,247	101.01	2,247,169.47
BOEING CO	50,222	169.27	8,501,077.94
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	29.25	2,209,866.75
CATERPILLAR	51,485	138.02	7,105,959.70
CUMMINS INC	13,804	211.17	2,914,990.68
DEERE&CO	27,735	191.99	5,324,842.65
DOVER CORP	13,872	110.72	1,535,907.84
EATON CORP	37,990	100.48	3,817,235.20
EMERSON ELECTRIC CO	56,559	68.32	3,864,110.88
FASTENAL CO	55,807	48.02	2,679,852.14
FORTIVE CORP	28,503	71.41	2,035,399.23
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	83.68	1,071,940.80
GENERAL DYNAMICS CORP	22,742	152.49	3,467,927.58
GENERAL ELECTRIC CO	816,436	6.38	5,208,861.68
GRAINGER (WW) INC	4,461	350.83	1,565,052.63
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	40.58	617,871.08
HEICO CORP	3,640	106.64	388,169.60

HEICO CORP-CLASS A	6,449	86.84	560,031.16
HONEYWELL INTL INC	65,906	156.85	10,337,356.10
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	17.12	625,736.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	162.77	573,275.94
IDEX CORP	6,916	175.79	1,215,763.64
ILLINOIS TOOL WORKS	29,759	195.77	5,825,919.43
INGERSOLL-RAND INC	31,562	34.43	1,086,679.66
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	89.78	1,079,694.28
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	40.72	818,472.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	20.08	411,640.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	69,045	40.23	2,777,680.35
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	20,428	181.18	3,701,145.04
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	279.80	856,747.60
LOCKHEED MARTIN CORP	23,810	390.05	9,287,090.50
MASCO CORP	27,698	58.50	1,620,333.00
NORDSON CORP	4,880	204.14	996,203.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,837	337.91	5,013,570.67
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	62.92	2,360,695.48
OWENS CORNING	10,458	67.07	701,418.06
PACCAR INC	32,395	88.11	2,854,323.45
PARKER HANNIFIN CORP	12,505	206.11	2,577,405.55
PENTAIR PLC	14,533	45.50	661,251.50
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	142,229	61.64	8,766,995.56
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,244	228.68	2,571,277.92
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,116	434.43	4,394,693.88
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	40.63	561,831.64
SMITH (A.O.) CORP	12,146	49.46	600,741.16
SNAP-ON INC	4,900	150.30	736,470.00
STANLEY BLACK&DECKER	14,798	158.97	2,352,438.06
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	316.88	1,109,396.88
TEXTRON	21,534	37.71	812,047.14
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,896	117.40	2,570,590.40
TRANSDIGM GROUP INC	4,664	482.81	2,251,825.84
UNITED RENTALS INC	6,643	175.43	1,165,381.49
WABTEC CORP	17,764	66.04	1,173,134.56
XYLEM INC	17,545	79.38	1,392,722.10
CINTAS CORP	8,272	318.50	2,634,632.00
COPART INC	19,784	100.51	1,988,489.84
COSTAR GROUP INC	3,584	827.23	2,964,792.32
EQUIFAX INC	11,791	161.82	1,908,019.62
IHS MARKIT LTD	35,672	82.99	2,960,419.28
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	15.95	555,841.55

REPUBLIC SERVICES INC	21,742	89.15	1,938,299.30
ROBERT HALF INTL INC	9,566	56.71	542,487.86
ROLLINS INC	14,566	54.36	791,807.76
TRANSUNION	17,091	84.63	1,446,411.33
VERISK ANALYTICS INC	14,560	187.24	2,726,214.40
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	99.58	2,452,555.82
WASTE MANAGEMENT INC	39,501	110.56	4,367,230.56
AMERCO	1,179	349.66	412,249.14
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	95.43	1,258,339.98
CSX CORP	72,174	74.05	5,344,484.70
DELTA AIR LINES INC	12,549	27.67	347,230.83
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	87.17	1,383,213.56
FEDEX CORP	22,100	207.88	4,594,148.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	138.27	1,150,268.13
KANSAS CITY SOUTHERN	8,711	180.75	1,574,513.25
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	44.67	477,969.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,985	205.40	4,926,519.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,106	195.99	1,784,684.94
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	34.27	392,905.55
UBER TECHNOLOGIES INC	87,546	29.42	2,575,603.32
UNION PACIFIC CORP	64,130	190.95	12,245,623.50
UNITED PARCEL SERVICE B	65,801	160.34	10,550,532.34
XPO LOGISTICS INC	8,001	83.64	669,203.64
APTIV PLC	24,462	85.42	2,089,544.04
AUTOLIV INC	6,776	71.07	481,570.32
BORGWARNER INC	19,890	41.01	815,688.90
FORD MOTOR COMPANY	375,147	6.87	2,577,259.89
GENERAL MOTORS CO	119,364	29.22	3,487,816.08
LEAR CORP	5,287	113.61	600,656.07
TESLA INC	13,758	1,878.53	25,844,815.74
DR HORTON INC	32,171	74.03	2,381,619.13
GARMIN LTD	12,854	103.99	1,336,687.46
HASBRO INC	12,468	78.59	979,860.12
LENNAR CORP-CL A	24,928	76.81	1,914,719.68
LULULEMON ATHLETICA INC	11,527	360.84	4,159,402.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	90.17	456,440.54
NEWELL BRANDS INC	37,563	16.75	629,180.25
NIKE B	117,323	108.39	12,716,639.97
NVR INC	337	4,151.03	1,398,897.11
PULTE GROUP INC	23,283	46.17	1,074,976.11
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	67.55	309,243.90
VF CORP	32,491	61.40	1,994,947.40

WHIRLPOOL CORP	6,079	184.37	1,120,785.23
ARAMARK	24,034	23.49	564,558.66
CARNIVAL CORPORATION	40,341	14.60	588,978.60
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,444	1,219.37	2,980,140.28
DARDEN RESTAURANTS INC	13,394	79.87	1,069,778.78
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	414.23	1,541,349.83
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,491	84.49	2,153,734.59
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	47.47	1,571,257.00
MARRIOTT INTL A	26,598	94.00	2,500,212.00
MCDONALD'S CORP	70,444	209.51	14,758,722.44
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	19.02	335,931.24
MGM RESORTS INTERNATIONAL	49,467	20.90	1,033,860.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,686	61.09	1,141,527.74
STARBUCKS CORP	110,556	77.63	8,582,462.28
VAIL RESORTS INC	3,574	211.00	754,114.00
WYNN RESORTS LTD	9,302	81.26	755,880.52
YUM BRANDS INC	29,166	93.93	2,739,562.38
ACTIVISION BLIZZARD INC	71,494	81.98	5,861,078.12
ALPHABET INC-CL A	28,027	1,544.61	43,290,784.47
ALPHABET INC-CL C	28,718	1,547.53	44,441,966.54
ALTICE USA INC- A	29,505	27.00	796,635.00
CABLE ONE INC	401	1,873.65	751,333.65
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,769	611.66	8,421,946.54
COMCAST CORP-CL A	428,069	43.32	18,543,949.08
DISCOVERY INC - A	12,804	22.21	284,440.86
DISCOVERY INC-C	28,190	20.39	574,794.10
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	34.05	820,707.15
ELECTRONIC ARTS INC	26,822	141.86	3,804,968.92
FACEBOOK INC-A	225,016	262.59	59,086,951.44
FOX CORP - CLASS A	33,968	25.85	878,072.80
FOX CORP- CLASS B	15,092	25.92	391,184.64
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	127.27	995,378.67
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	18.34	620,515.56
LIBERTY BROADBAND-A	3,021	137.14	414,299.94
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	139.81	1,426,201.81
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	37.41	699,305.13
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	35.05	605,103.20
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	35.05	223,759.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT	16,947	51.56	873,787.32
MATCH GROUP INC	21,635	114.15	2,469,635.25
NETFLIX INC	41,368	484.53	20,044,037.04
NEWS CORP-CLASS A	33,479	15.22	509,550.38

OMNICOM GROUP	20,835	53.73	1,119,464.55
PINTEREST INC- CLASS A	32,190	34.53	1,111,520.70
ROKU INC	8,355	147.37	1,231,276.35
SIRIUS XM HOLDINGS INC	89,917	5.87	527,812.79
SNAP INC - A	79,559	21.92	1,743,933.28
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,751	172.63	1,855,945.13
THE WALT DISNEY CO	170,184	127.77	21,744,409.68
TWITTER INC	71,690	38.89	2,788,024.10
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	27.32	1,474,624.32
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	83.83	1,036,809.44
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	160.81	994,770.66
AMAZON.COM	39,784	3,260.48	129,714,936.32
AUTOZONE INC	2,285	1,210.00	2,764,850.00
BEST BUY COMPANY INC	22,720	111.96	2,543,731.20
BOOKING HOLDINGS INC	3,859	1,767.47	6,820,666.73
BURLINGTON STORES INC	6,766	195.48	1,322,617.68
CARMAX INC	15,777	106.78	1,684,668.06
DOLLAR GENERAL CORP	23,753	200.13	4,753,687.89
DOLLAR TREE INC	22,651	99.75	2,259,437.25
EBAY	74,325	57.71	4,289,295.75
EXPEDIA GROUP INC	13,383	87.68	1,173,421.44
GENUINE PARTS CO	13,937	93.04	1,296,698.48
HOME DEPOT	102,166	282.86	28,898,674.76
LKQ CORP	29,351	31.34	919,860.34
LOWES COMPANIES	72,304	158.28	11,444,277.12
MERCADOLIBRE INC	4,280	1,212.45	5,189,286.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,237	466.06	3,372,876.22
ROSS STORES INC	34,327	90.26	3,098,355.02
TARGET (DAYTON HUDSON)	46,428	154.22	7,160,126.16
TIFFANY & CO	10,426	127.25	1,326,708.50
TJX COMPANIES INC	112,543	54.36	6,117,837.48
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	153.92	1,725,751.04
ULTA BEAUTY INC	5,362	213.36	1,144,036.32
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	333.01	1,998,060.00
COSTCO WHOLESALE CORP	41,563	340.90	14,168,826.70
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	4.23	143,397.00
KROGER CO	76,549	36.22	2,772,604.78
SYSCO CORP	45,437	58.08	2,638,980.96
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,429	40.25	2,915,267.25
WALMART INC	133,620	132.41	17,692,624.20
ALTRIA GROUP INC	172,226	43.65	7,517,664.90
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	44.06	2,299,447.34

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	72.73	2,109,897.30
BUNGE LIMITED	13,606	46.69	635,264.14
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	52.38	831,218.22
COCA-COLA CO	384,034	47.37	18,191,690.58
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16,995	40.74	692,376.30
CONAGRA BRANDS INC	45,992	37.94	1,744,936.48
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,999	180.00	2,879,820.00
GENERAL MILLS INC	57,694	64.46	3,718,955.24
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	147.76	2,053,272.96
HORMEL FOODS CORP	27,157	52.43	1,423,841.51
INGREDION INC	5,835	77.92	454,663.20
JM SMUCKER CO	10,802	111.36	1,202,910.72
KELLOGG CO	24,092	68.85	1,658,734.20
KEURIG DR PEPPER INC	31,200	29.34	915,408.00
KRAFT HEINZ CO/THE	64,187	35.43	2,274,145.41
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	64.06	827,911.44
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,808	202.52	2,391,356.16
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	37.85	688,983.55
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	131,861	56.76	7,484,430.36
MONSTER BEVERAGE CORP	37,118	82.67	3,068,545.06
PEPSICO INC	130,934	136.45	17,865,944.30
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146,196	78.70	11,505,625.20
TYSON FOODS INC	28,214	63.48	1,791,024.72
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	96.29	2,258,385.66
CLOROX COMPANY	11,988	227.94	2,732,544.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	75,547	77.95	5,888,888.65
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,244	212.50	4,514,350.00
KIMBERLY-CLARK CORP	31,739	157.35	4,994,131.65
PROCTER & GAMBLE CO	230,557	135.77	31,302,723.89
ABBOTT LABORATORIES	166,071	100.48	16,686,814.08
ABIOMED INC	4,421	314.35	1,389,741.35
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	301.51	2,144,640.63
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	101.71	1,485,372.84
ANTHEM INC	23,196	283.40	6,573,746.40
BAXTER INTERNATIONAL	47,484	82.89	3,935,948.76
BECTON DICKINSON & CO	25,005	262.00	6,551,310.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	133,021	39.35	5,234,376.35
CARDINAL HEALTH	27,968	51.64	1,444,267.52
CENTENE CORP	55,738	63.47	3,537,690.86
CERNER CORP	30,009	72.44	2,173,851.96
CIGNA CORP	34,360	181.25	6,227,750.00
CVS HEALTH CORP	122,285	65.28	7,982,764.80

DANAHER CORP	58,889	205.93	12,127,011.77
DAVITA INC	9,056	86.21	780,717.76
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	42.52	858,393.76
DEXCOM INC	8,490	432.88	3,675,151.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	59,721	78.77	4,704,223.17
HCA HEALTHCARE INC	25,918	133.04	3,448,130.72
HENRY SCHEIN INC	14,096	65.14	918,213.44
HOLOGIC INC	24,459	67.04	1,639,731.36
HUMANA INC	12,640	418.00	5,283,520.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,195	381.50	3,126,392.50
INSULET CORP	5,923	209.76	1,242,408.48
INTUITIVE SURGICAL INC	10,851	691.41	7,502,489.91
LABORATORY CRP OF AMER	8,614	182.71	1,573,863.94
MASIMO CORP	5,273	218.16	1,150,357.68
MCKESSON CORP	15,443	153.34	2,368,029.62
MEDTRONIC PLC	126,090	100.82	12,712,393.80
MOLINA HEALTHCARE INC	5,020	193.51	971,420.20
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	117.66	1,517,108.04
RESMED INC	13,491	183.43	2,474,654.13
STERIS PLC	8,111	156.96	1,273,102.56
STRYKER CORP	30,954	186.10	5,760,539.40
TELADOC HEALTH INC	6,315	216.51	1,367,260.65
TELEFLEX INC	4,427	371.80	1,645,958.60
THE COOPER COS INC	4,688	305.50	1,432,184.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	88,310	315.40	27,852,974.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	111.88	810,906.24
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	172.97	1,424,753.89
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	266.87	3,289,172.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,079	274.92	1,946,158.68
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,652	137.25	2,697,237.00
ABBVIE INC	166,385	96.10	15,989,598.50
AGILENT TECHNOLOGIES	29,560	97.96	2,895,697.60
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	101.70	2,107,834.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	137.22	1,463,451.30
AMGEN	55,528	240.49	13,353,928.72
AVANTOR INC	37,516	20.85	782,208.60
BEIGENE LTD-ADR	3,859	234.83	906,208.97
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	520.89	1,115,225.49
BIOGEN INC	16,218	279.98	4,540,715.64
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	76.71	1,317,273.26
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	209,587	63.09	13,222,843.83
CATALENT INC	13,739	87.13	1,197,079.07

ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	25.80	930,373.80
EXACT SCIENCES CORP	13,278	81.61	1,083,617.58
GILEAD SCIENCES INC	118,620	65.70	7,793,334.00
ILLUMINA INC	14,031	353.35	4,957,853.85
INCYTE CORP	17,504	96.27	1,685,110.08
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	52.28	670,072.76
IQVIA HOLDINGS INC	17,736	160.16	2,840,597.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	124.26	617,696.46
JOHNSON & JOHNSON	246,279	150.39	37,037,898.81
LILLY (ELI) & CO	81,003	152.29	12,335,946.87
MERCK & CO	236,561	85.03	20,114,781.83
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	970.71	2,194,775.31
MODERNA INC	25,034	68.00	1,702,312.00
MYLAN NV	49,481	16.51	816,931.31
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	113.13	958,663.62
PERKINELMER INC	10,645	117.69	1,252,810.05
PERRIGO CO PLC	14,477	53.73	777,849.21
PFIZER	521,538	38.26	19,954,043.88
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,527	629.63	5,998,485.01
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	148.66	1,062,473.02
SEATTLE GENETICS INC	11,471	157.72	1,809,206.12
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	10.14	1,100,027.76
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,540	420.62	15,790,074.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,285	270.07	6,558,649.95
WATERS CORP	5,276	216.95	1,144,628.20
ZOETIS INC	43,948	158.58	6,969,273.84
BANK OF AMERICA CORP	740,193	25.50	18,874,921.50
CITIGROUP	197,888	50.29	9,951,787.52
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	24.80	992,248.00
COMERICA INC	14,360	39.68	569,804.80
EAST WEST BANCORP INC	13,827	37.21	514,502.67
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	20.16	1,369,690.56
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	114.63	1,819,407.36
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	9.52	942,594.24
JPMORGAN CHASE & CO	287,074	98.55	28,291,142.70
KEY CORP	94,322	12.17	1,147,898.74
M & T BANK CORP	11,721	104.43	1,224,024.03
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	10.80	396,576.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,023	106.39	4,258,046.97
REGIONS FINL CORP	92,434	11.42	1,055,596.28
SIGNATURE BANK	5,223	102.03	532,902.69
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	243.05	1,201,396.15

TRUIST FINANCIAL CORP	128,020	37.95	4,858,359.00
US BANCORP	127,646	36.16	4,615,679.36
WELLS FARGO & CO	365,686	24.07	8,802,062.02
ZIONS BANCORPORATION	15,186	32.91	499,771.26
ALLY FINANCIAL INC	36,028	22.27	802,343.56
AMERICAN EXPRESS	64,225	96.89	6,222,760.25
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	156.85	1,858,672.50
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	47.69	722,646.57
BANK NEW YORK CO	73,913	36.99	2,734,041.87
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	129,847	207.21	26,905,596.87
BLACKROCK INC	14,048	589.75	8,284,808.00
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,438	53.99	3,371,027.62
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,052	65.70	2,762,816.40
CARLYLE GROUP INC/THE	16,087	27.18	437,244.66
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	89.02	944,680.24
CME GROUP INC	34,191	172.20	5,887,690.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	50.81	1,407,640.24
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	53.29	1,124,845.32
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	20.98	843,710.70
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	360.92	1,311,222.36
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	21.67	564,936.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,708	203.02	6,234,338.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	51,389	103.53	5,320,303.17
INVESCO LTD	44,943	10.33	464,261.19
KKR & CO INC	47,403	35.77	1,695,605.31
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	491.88	1,767,324.84
MOODY'S CORP	15,637	281.69	4,404,786.53
MORGAN STANLEY	111,986	51.37	5,752,720.82
MSCI INC	7,815	371.40	2,902,491.00
NASDAQ INC	10,979	129.87	1,425,842.73
NORTHERN TRUST CORP	19,520	83.00	1,620,160.00
PRICE T ROWE GROUP INC	21,748	137.14	2,982,520.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	74.85	895,804.80
S&P GLOBAL INC	22,731	358.11	8,140,198.41
SCHWAB (CHARLES) CORP	110,150	35.71	3,933,456.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	52.27	640,882.47
STATE STREET CORP	34,742	70.45	2,447,573.90
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	24.11	1,280,120.45
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	38.64	999,887.28
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	55.21	500,257.81
VOYA FINANCIAL INC	12,505	50.76	634,753.80
AFLAC	62,907	37.03	2,329,446.21

ALLEGHANY CORP	1,276	531.25	677,875.00
ALLSTATE CORP	29,185	94.28	2,751,561.80
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	66.14	417,938.66
AMERICAN INT'L GROUP	83,130	29.86	2,482,261.80
AON PLC	21,468	197.57	4,241,432.76
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	31.40	1,218,194.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	106.62	1,901,354.46
ASSURANT INC	5,819	123.54	718,879.26
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	15,847	36.52	578,732.44
BROWN & BROWN INC	22,945	45.96	1,054,552.20
CHUBB LTD	41,989	123.93	5,203,696.77
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	78.21	1,161,496.71
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	222.70	482,368.20
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	217.31	853,159.06
FNF GROUP	24,961	32.25	804,992.25
GLOBE LIFE INC	9,867	82.61	815,112.87
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	40.79	1,406,479.99
LINCOLN NATIONAL CORP	20,790	36.41	756,963.90
LOEWS CORP	25,707	36.21	930,850.47
MARKEL CORP	1,312	1,074.43	1,409,652.16
MARSH & MCLENNAN COS	46,842	116.10	5,438,356.20
METLIFE INC	74,667	38.20	2,852,279.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	43.69	1,162,809.35
PROGRESSIVE CORP	55,794	90.41	5,044,335.54
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,690	69.07	2,603,248.30
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	93.17	506,006.27
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,122	174.81	895,376.82
TRAVELERS COS INC/THE	24,049	113.20	2,722,346.80
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	203.30	2,442,852.80
WR BERKLEY CORP	14,085	60.63	853,973.55
CBRE GROUP INC-A	30,111	44.31	1,334,218.41
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.85	379,995.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	96.73	433,737.32
WEYERHAEUSER CO	69,607	28.97	2,016,514.79
ACCENTURE PLC-CL A	59,753	234.63	14,019,846.39
ADOBE INC	45,456	462.01	21,001,126.56
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	15,447	109.21	1,686,966.87
ANSYS INC	8,044	319.53	2,570,299.32
AUTODESK INC	20,964	241.42	5,061,128.88
AUTOMATIC DATA PROCESS	40,135	138.90	5,574,751.50
AVALARA INC	6,485	121.39	787,214.15
BLACK KNIGHT INC	14,413	80.62	1,161,976.06

BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	86.20	1,158,355.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	137.30	1,506,318.30
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,369	108.53	2,861,827.57
CDK GLOBAL INC	10,687	46.29	494,701.23
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	128.08	1,343,046.88
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	140.49	1,467,277.56
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	52,296	66.89	3,498,079.44
COUPA SOFTWARE INC	6,059	298.52	1,808,732.68
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,119	108.15	986,219.85
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	107.86	334,366.00
DATADOG INC - CLASS A	9,168	82.47	756,084.96
DOCUSIGN INC	15,817	208.21	3,293,257.57
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	20.14	487,730.38
DYNATRACE INC	14,169	39.29	556,700.01
EPAM SYSTEMS INC	5,266	303.76	1,599,600.16
FAIR ISAAC CORP	2,615	426.50	1,115,297.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	57,789	142.61	8,241,289.29
FISERV INC	55,147	100.44	5,538,964.68
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,052	244.87	1,971,693.24
FORTINET INC	13,898	129.51	1,799,929.98
GARTNER INC	8,569	127.62	1,093,575.78
GLOBAL PAYMENTS INC	27,817	169.45	4,713,590.65
GODADDY INC - CLASS A	16,351	81.68	1,335,549.68
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	110.09	872,243.07
INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,458	123.84	10,335,438.72
INTUIT INC	24,280	310.55	7,540,154.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	172.22	1,267,539.20
LEIDOS HOLDINGS	12,829	92.60	1,187,965.40
MASTERCARD INC-CLASS A	83,731	332.40	27,832,184.40
MICROSOFT CORP	676,327	209.70	141,825,771.90
MONGODB INC	4,623	212.69	983,265.87
NORTONLIFELOCK INC	50,376	22.69	1,143,031.44
OKTA INC	10,381	205.29	2,131,115.49
ORACLE CORP	208,169	56.20	11,699,097.80
PALO ALTO NETWORKS INC	9,363	269.48	2,523,141.24
PAYCHEX INC	30,214	74.14	2,240,065.96
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	293.00	1,393,215.00
PAYPAL HOLDINGS INC	105,027	192.44	20,211,395.88
PTC INC	9,984	88.54	883,983.36
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,050	288.48	2,033,784.00
SALESFORCE.COM INC	79,356	205.11	16,276,709.16
SERVICENOW INC	17,785	437.13	7,774,357.05

SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	31,963	28.57	913,182.91
SPLUNK INC	14,752	195.46	2,883,425.92
SQUARE INC - A	33,186	150.37	4,990,178.82
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	62.36	1,357,889.00
SYNOPSYS INC	14,359	198.22	2,846,240.98
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,705	464.01	1,719,157.05
TWILIO INC - A	11,282	251.00	2,831,782.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	338.18	1,255,662.34
VERISIGN INC	10,096	206.15	2,081,290.40
VISA INC-CLASS A SHARES	159,051	200.99	31,967,660.49
VMWARE INC-CLASS A	7,867	139.26	1,095,558.42
WESTERN UNION CO	38,757	23.70	918,540.90
WIX.COM LTD	5,010	285.61	1,430,906.10
WORKDAY INC-CLASS A	15,669	191.20	2,995,912.80
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,002	273.51	2,735,647.02
AMPHENOL CORPORATION	27,456	109.14	2,996,547.84
APPLE INC	409,896	462.83	189,712,165.68
ARISTA NETWORKS INC	5,179	220.65	1,142,746.35
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	76.13	596,783.07
CDW CORP/DE	13,742	111.99	1,538,966.58
CISCO SYSTEMS	399,683	41.87	16,734,727.21
COGNEX CORP	16,230	67.95	1,102,828.50
CORNING	72,399	32.23	2,333,419.77
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	59.85	1,288,570.50
F5 NETWORKS INC	5,350	134.68	720,538.00
FLIR SYSTEMS INC	11,686	37.23	435,069.78
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	9.42	1,165,998.18
HP INC	126,556	18.14	2,295,725.84
IPG PHOTONICS CORP	3,207	154.24	494,647.68
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	23.82	745,661.28
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	104.00	1,832,896.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,366	150.46	2,462,428.36
NETAPP INC	20,586	41.49	854,113.14
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	45.40	1,036,754.40
TE CONNECTIVITY LTD	31,955	94.17	3,009,202.35
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	50.66	1,209,963.44
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	34.45	980,240.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	283.13	1,461,517.06
AT&T INC	676,285	29.73	20,105,953.05
CENTURYLINK INC	93,962	11.29	1,060,830.98
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	22.15	343,756.98
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,106	21.50	905,279.00

T-MOBILE US INC	51,428	115.14	5,921,419.92
VERIZON COMMUNICATIONS	387,339	59.05	22,872,367.95
AES CORP	61,761	17.62	1,088,228.82
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	53.82	1,300,075.92
AMEREN CORPORATION	23,120	81.15	1,876,188.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,150	80.92	3,815,378.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	143.92	2,435,414.24
ATMOS ENERGY CORP	11,419	102.64	1,172,046.16
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	20.25	975,280.50
CMS ENERGY CORP	26,742	60.68	1,622,704.56
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	73.44	2,331,352.80
DOMINION ENERGY INC	78,420	77.94	6,112,054.80
DTE ENERGY COMPANY	18,360	117.02	2,148,487.20
DUKE ENERGY CORP	66,920	81.66	5,464,687.20
EDISON INTL	33,630	52.25	1,757,167.50
ENERGY CORP	18,696	98.99	1,850,717.04
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	43.97	916,070.98
EVERGY INC	21,330	51.51	1,098,708.30
EVERSOURCE ENERGY	30,920	86.21	2,665,613.20
EXELON CORP	92,804	37.02	3,435,604.08
FIRSTENERGY CORP	50,559	28.64	1,448,009.76
NEXTERA ENERGY INC	45,973	282.34	12,980,016.82
NISOURCE INC	35,781	23.44	838,706.64
NRG ENERGY INC	23,078	35.41	817,191.98
OGE ENERGY CORP	19,225	32.08	616,738.00
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	76.02	818,887.44
PPL CORPORATION	69,904	28.34	1,981,079.36
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	54.34	2,569,738.60
SEMPRA ENERGY	27,061	128.22	3,469,761.42
SOUTHERN CO	98,387	53.19	5,233,204.53
UGI CORP	18,019	34.43	620,394.17
VISTRA CORP	46,057	19.73	908,704.61
WEC ENERGY GROUP INC	30,120	91.72	2,762,606.40
XCEL ENERGY INC	50,065	69.58	3,483,522.70
ADVANCED MICRO DEVICES	109,297	81.09	8,862,893.73
ANALOG DEVICES	35,161	118.15	4,154,272.15
APPLIED MATERIALS	84,668	65.87	5,577,081.16
BROADCOM INC	37,568	329.21	12,367,761.28
INTEL CORP	403,460	48.33	19,499,221.80
KLA CORP	15,075	210.54	3,173,890.50
LAM RESEARCH CORP	13,850	372.19	5,154,831.50
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	61,408	33.11	2,033,218.88

	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,878	68.95	1,784,288.10	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	108.12	2,469,893.28	
	MICRON TECHNOLOGY	105,648	44.05	4,653,794.40	
	NVIDIA CORP	57,334	485.54	27,837,950.36	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,742	123.75	3,185,572.50	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	21.66	779,673.36	
	QORVO INC	10,609	132.46	1,405,268.14	
	QUALCOMM	107,369	111.04	11,922,253.76	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,107	142.05	2,287,999.35	
	TERADYNE INC	16,048	90.24	1,448,171.52	
	TEXAS INSTRUMENTS	87,799	138.48	12,158,405.52	
	XILINX INC	23,543	102.39	2,410,567.77	
	アメリカドル 小計	27,736,546		2,741,472,059.51	(290,842,770,793)
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	14.00	574,868.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,748	26.30	2,807,472.40	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	6.58	636,062.28	
	ENBRIDGE	188,432	43.32	8,162,874.24	
	IMPERIAL OIL	24,763	22.06	546,271.78	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	14.21	503,815.55	
	KEYERA CORP	18,607	24.81	461,639.67	
	PARKLAND CORP	17,004	39.76	676,079.04	
	PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	35.41	1,905,624.56	
	SUNCOR ENERGY	147,329	21.87	3,222,085.23	
	TC ENERGY CORP	86,686	65.22	5,653,660.92	
	AGNICO EAGLE MINES	23,423	106.39	2,491,972.97	
	B2GOLD CORP	90,243	8.18	738,187.74	
	BARRICK GOLD CORP	170,934	38.26	6,539,934.84	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	50.87	668,380.93	
	FRANCO-NEVADA CORP	17,244	195.59	3,372,753.96	
	KINROSS GOLD CORP	125,340	11.67	1,462,717.80	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,848	69.60	1,868,620.80	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	8.14	506,658.02	
	NUTRIEN LTD	55,504	51.37	2,851,240.48	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	44.66	822,235.26	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	16.72	763,719.44	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,391	68.12	2,751,434.92	
	YAMANA GOLD INC	81,672	7.97	650,925.84	
	CAE INC	25,999	19.94	518,420.06	
	WSP GLOBAL INC	9,471	87.52	828,901.92	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	12,370	83.50	1,032,895.00	
	THOMSON REUTERS CORP	15,191	100.42	1,525,480.22	

AIR CANADA	19,591	16.39	321,096.49
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,459	137.95	9,168,019.05
CP RAILWAY LIMITED	13,160	394.65	5,193,594.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	68.77	1,924,047.06
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,923	25.96	335,481.08
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	28,808	71.92	2,071,871.36
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.14	503,728.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	25.14	1,133,487.18
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	131.30	710,201.70
DOLLARAMA INC	26,700	51.35	1,371,045.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	84,121	45.41	3,819,934.61
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	35.59	542,854.27
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	70.90	1,269,606.30
METRO INC	24,937	59.95	1,494,973.15
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	100.26	690,089.58
SAPUTO INC	24,489	35.14	860,543.46
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	22.28	619,384.00
CANOPY GROWTH CORP	25,606	21.97	562,563.82
CRONOS GROUP INC	15,900	7.19	114,321.00
BANK MONTREAL	61,534	77.01	4,738,733.34
BANK NOVA SCOTIA	112,518	56.58	6,366,268.44
CANADIAN IMPERIAL BANK	42,951	97.87	4,203,614.37
NATIONAL BANK OF CANADA	33,228	66.64	2,214,313.92
ROYAL BANK OF CANADA	133,379	97.69	13,029,794.51
TORONTO-DOMINION BANK	168,842	62.43	10,540,806.06
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	126,501	44.64	5,647,004.64
CI FINANCIAL CORP	18,671	19.13	357,176.23
IGM FINANCIAL INC	7,685	32.64	250,838.40
ONEX CORP	6,603	65.05	429,525.15
TMX GROUP LTD	6,205	135.65	841,708.25
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	411.40	1,095,558.20
GREAT-WEST LIFE CO INC	23,788	26.45	629,192.60
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	48.18	396,521.40
INTACT FINANCIAL CORP	13,043	141.90	1,850,801.70
MANULIFE FINANCIAL CORP	178,574	19.76	3,528,622.24
POWER CORP OF CANADA	51,551	25.75	1,327,438.25
SUN LIFE FINANCIAL INC	56,979	56.04	3,193,103.16
BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.33	249,402.00
CGI INC - CL A	23,396	90.85	2,125,526.60
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,845	1,505.99	2,778,551.55
OPEN TEXT CORP	24,643	58.00	1,429,294.00
SHOPIFY INC - CLASS A	9,799	1,335.12	13,082,840.88

	BCE INC	15,355	57.06	876,156.30
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	55.84	1,955,405.12
	TELUS CORP	32,908	24.18	795,715.44
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.36	951,378.48
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	18.01	439,353.95
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	40.89	214,304.49
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.23	343,066.52
	EMERA INC	23,704	54.11	1,282,623.44
	FORTIS INC	42,633	53.07	2,262,533.31
	HYDRO ONE LTD	32,299	27.75	896,297.25
	カナダドル 小計	3,580,602		177,575,245.17 (14,252,189,177)
ユーロ	ENI	248,488	8.12	2,019,710.46
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	9.32	458,783.24
	NESTE OIL OYJ	40,117	42.97	1,723,827.49
	OMV AG	14,984	28.20	422,548.80
	REPSOL SA	140,401	6.82	957,534.82
	TENARIS SA	40,648	5.06	205,841.47
	TOTAL SE	231,499	33.08	7,657,986.92
	VOPAK	6,360	47.29	300,764.40
	AIR LIQUIDE	44,090	140.70	6,203,463.00
	AKZO NOBEL	19,521	84.00	1,639,764.00
	ARCELORMITTAL	66,229	10.15	672,356.80
	ARKEMA	5,949	93.18	554,327.82
	BASF SE	85,260	50.74	4,326,092.40
	COVESTRO AG	15,098	39.64	598,484.72
	CRH PLC	72,257	33.41	2,414,106.37
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	24.65	486,936.10
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	38.14	219,762.68
	HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	52.10	772,799.30
	KONINKLIJKE DSM NV	15,650	132.00	2,065,800.00
	LANXESS	7,293	49.31	359,617.83
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	30.62	599,080.30
	SOLVAY SA	6,906	73.58	508,143.48
	STORA ENSO OYJ R	54,792	11.72	642,162.24
	SYMRISE AG	12,476	113.90	1,421,016.40
	THYSSEN KRUPP	33,044	6.35	209,961.57
	UMICORE	17,605	39.85	701,559.25
	UPM KYMMENE OYJ	50,623	23.50	1,189,640.50
	VOESTALPINE AG	12,422	21.32	264,837.04
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,394	21.71	507,883.74
	AIRBUS SE	56,107	70.25	3,941,516.75

ALSTOM	18,760	48.31	906,295.60
ANDRITZ AG	5,242	29.04	152,227.68
BOUYGUES ORD	19,381	32.93	638,216.33
BRENTAG AG	15,254	52.62	802,665.48
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	6.59	613,227.39
DASSAULT AVIATION SA	213	771.00	164,223.00
EIFFAGE	7,209	78.88	568,645.92
FERROVIAL SA	46,711	23.13	1,080,425.43
GEA GROUP AG	13,382	30.58	409,221.56
HOCHTIEF AG	2,222	77.65	172,538.30
KINGSPAN GROUP PLC	15,306	65.35	1,000,247.10
KION GROUP AG	5,887	70.12	412,796.44
KNORR-BREMSE AG	4,123	100.88	415,928.24
KONE OYJ-B	32,286	70.82	2,286,494.52
LEGRAND SA	24,584	70.14	1,724,321.76
LEONARDO SPA	35,425	6.00	212,550.00
MTU AERO ENGINES AG	4,753	149.70	711,524.10
PRYSMIAN SPA	21,155	23.00	486,565.00
SAFRAN SA	29,413	99.38	2,923,063.94
SAINT-GOBAIN	46,472	34.44	1,600,495.68
SCHNEIDER ELECTRIC SE	51,442	104.30	5,365,400.60
SIEMENS	71,400	118.02	8,426,628.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	23.11	580,107.22
THALES SA	9,665	68.04	657,606.60
VINCI S.A.	49,409	81.14	4,009,046.26
WARTSILA OYJ	34,386	7.18	247,166.56
BUREAU VERITAS SA	25,073	19.05	477,640.65
RANDSTAD NV	12,365	44.58	551,231.70
TELEPERFORMANCE	5,732	256.00	1,467,392.00
WOLTERS KLUWER	25,709	70.58	1,814,541.22
ADP	2,382	85.85	204,494.70
AENA SME SA	6,542	118.00	771,956.00
ATLANTIA SPA	51,427	14.38	739,777.39
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.70	202,466.40
DEUTSCHE POST AG-REG	91,113	38.18	3,478,694.34
FRAPORT AG	3,561	36.00	128,196.00
GETLINK	44,101	13.07	576,400.07
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,973	58.25	1,862,427.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	47.74	238,270.34
CONTINENTAL AG	9,928	90.78	901,263.84
DAIMLER AG	78,738	42.92	3,379,434.96
FAURECIA	5,945	36.14	214,852.30

FERRARI NV	11,392	163.80	1,866,009.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	111,379	9.62	1,072,357.01
MICHELIN	16,459	95.56	1,572,822.04
PEUGEOT SA	52,883	15.12	799,590.96
PIRELLI & C SPA	39,097	3.73	145,949.10
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	52.74	739,836.72
RENAULT SA	17,362	24.38	423,285.56
VALEO SA	19,350	25.44	492,264.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,999	139.44	2,509,780.56
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	151.50	492,526.50
ADIDAS AG	17,675	261.60	4,623,780.00
ESSILORLUXOTTICA	27,287	111.40	3,039,771.80
HERMES INTERNATIONAL	3,057	693.60	2,120,335.20
KERING	7,275	499.80	3,636,045.00
LVMH	26,074	387.20	10,095,852.80
MONCLER SPA	20,700	32.23	667,161.00
PUMA SE	7,720	69.50	536,540.00
SEB SA	2,075	147.90	306,892.50
ACCOR	17,931	23.16	415,281.96
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,877	134.70	1,599,831.90
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,540	31.30	329,902.00
SODEXO	8,135	61.28	498,512.80
BOLLORE	61,805	3.15	194,932.97
JC DECAUX SA	9,522	15.88	151,209.36
PUBLICIS GROUPE	21,469	28.71	616,374.99
SCOUT24 AG	9,470	75.55	715,458.50
SES	31,369	6.10	191,476.37
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	33.92	169,532.16
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	69.76	649,535.36
VIVENDI	77,307	24.10	1,863,098.70
DELIVERY HERO SE	11,471	100.10	1,148,247.10
INDITEX	101,980	23.27	2,373,074.60
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	99.98	1,136,972.56
PROSUS	45,138	77.90	3,516,250.20
ZALANDO SE	13,985	68.66	960,210.10
CARREFOUR	59,235	13.47	798,191.62
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,810	23.78	138,161.80
COLRUYT SA	5,424	52.70	285,844.80
JERONIMO MARTINS	24,901	13.93	346,870.93
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	26.26	2,711,712.64
METRO AG	13,712	8.56	117,402.14
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,855	48.88	3,561,152.40

DANONE (GROUPE)	59,282	56.70	3,361,289.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	8.64	424,025.28
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	69.60	744,789.60
HEINEKEN NV	24,387	78.58	1,916,330.46
KERRY GROUP PLC-A	14,641	109.00	1,595,869.00
PERNOD-RICARD	19,514	147.20	2,872,460.80
REMY COINTREAU	2,382	138.30	329,430.60
BEIERSDORF AG	9,190	94.22	865,881.80
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	75.80	772,402.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,238	87.56	1,509,359.28
LOREAL	23,414	283.00	6,626,162.00
UNILEVER NV	136,472	49.58	6,766,281.76
BIOMERIEUX	4,175	140.50	586,587.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	91.65	314,359.50
DIASORIN SPA	2,070	162.20	335,754.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	73.48	1,468,497.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,407	39.12	1,580,721.84
KONINKLIJKE PHILIPS	84,867	43.74	3,712,082.58
ORPEA	5,633	106.40	599,351.20
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	349.80	1,135,450.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,846	39.62	588,198.52
BAYER	91,418	57.97	5,299,501.46
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	694.20	803,883.60
GALAPAGOS NV	4,368	118.55	517,826.40
GRIFOLS SA	27,685	23.70	656,134.50
IPSEN	2,722	87.65	238,583.30
MERCK KGAA	12,078	114.60	1,384,138.80
ORION OYJ-CLASS B	9,854	40.02	394,357.08
QIAGEN N.V.	21,801	44.10	961,424.10
RECORDATI SPA	11,472	45.62	523,352.64
SANOFI	105,868	87.64	9,278,271.52
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	296.00	716,024.00
UCB (GROUPE)	12,416	102.25	1,269,536.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	29,696	8.11	240,893.95
BANCO BILBAO VIZCAYA	647,435	2.55	1,652,901.55
BANCO SANTANDER SA	1,599,817	1.93	3,094,366.04
BANKINTER SA	58,881	4.62	272,324.62
BNP PARIBAS	104,161	36.83	3,836,770.43
CAIXABANK	328,697	1.98	652,299.19
COMMERZBANK AG	75,494	4.78	361,314.28
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	8.69	934,713.17
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	20.39	561,948.40

FINECOBANK SPA	53,120	12.96	688,435.20
ING GROEP NV-CVA	377,830	6.82	2,577,556.26
INTESA SANPAOLO	1,460,677	1.84	2,694,949.06
KBC GROEP NV	24,002	49.28	1,182,818.56
MEDIOBANCA	53,990	7.19	388,404.06
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	15.31	191,221.90
SOCIETE GENERALE	79,076	13.91	1,100,263.46
UNICREDIT SPA	190,988	8.32	1,590,548.06
AMUNDI SA	6,226	64.90	404,067.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	190,535	8.12	1,548,477.94
DEUTSCHE BOERSE	18,261	157.40	2,874,281.40
EURAZEO SA	3,357	43.88	147,305.16
EXOR NV	10,345	51.66	534,422.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,222	78.74	647,400.28
NATIXIS	114,996	2.44	280,705.23
SOFINA	1,781	243.00	432,783.00
WENDEL	2,023	87.35	176,709.05
AEGON	166,267	2.35	390,727.45
AGEAS	16,065	37.29	599,063.85
ALLIANZ SE-REG	38,899	184.38	7,172,197.62
ASSICURAZIONI GENERALI	109,307	13.14	1,436,293.98
AXA SA	185,927	17.60	3,273,802.61
CNP ASSURANCES	21,830	11.38	248,425.40
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	144.10	834,194.90
MAPFRE SA	90,939	1.57	143,501.74
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,866	239.30	3,318,133.80
NN GROUP NV	27,631	31.61	873,415.91
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.94	365,517.90
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	32.85	1,415,013.75
SCOR SE	13,354	22.14	295,657.56
AROUNDTOWN SA	111,346	4.92	548,601.74
DEUTSCHE WOHNEN SE	33,768	43.70	1,475,661.60
LEG IMMOBILIEN AG	5,781	124.12	717,537.72
VONOVIA SE	49,525	58.22	2,883,345.50
ADYEN NV	1,648	1,460.00	2,406,080.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	44.21	1,851,691.64
ATOS SE	9,750	71.00	692,250.00
CAPGEMINI SA	15,470	113.65	1,758,165.50
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	151.70	1,898,525.50
EDENRED	22,756	42.37	964,171.72
NEMETSCHKE SE	6,575	63.25	415,868.75
NEXI SPA	36,670	15.08	552,983.60

SAP SE	98,157	136.84	13,431,803.88
TEAMVIEWER AG	14,027	43.45	609,473.15
WORLDLINE SA	12,702	72.96	926,737.92
INGENICO GROUP	6,281	137.10	861,125.10
NOKIA OYJ	545,632	4.24	2,314,298.12
ALTICE NV -A	50,000	4.07	203,600.00
CELLNEX TELECOM SA	24,602	53.88	1,325,555.76
DEUTSCHE TELEKOM	309,728	15.17	4,698,573.76
ELISA A	11,943	50.54	603,599.22
ILIAD SA	1,253	169.10	211,882.30
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	8.53	259,098.75
KPN (KON.)	354,332	2.23	793,349.34
ORANGE	188,105	10.00	1,881,990.52
PROXIMUS	13,141	17.30	227,405.00
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.37	319,280.72
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.36	173,484.24
TELEFONICA	456,457	3.61	1,647,809.77
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	125,107	2.39	299,756.37
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	41.51	394,884.63
E.ON SE	216,142	10.05	2,172,227.10
ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	8.73	535,682.78
ELIA GROUP SA/NV	3,630	91.60	332,508.00
ENAGAS	25,299	21.58	545,952.42
ENDESA	31,750	23.70	752,475.00
ENEL	759,109	7.86	5,970,392.28
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	4.30	1,014,425.90
ENGIE	171,054	11.45	1,958,568.30
FORTUM OYJ	41,901	17.02	713,155.02
IBERDROLA SA	554,209	10.82	5,999,312.42
NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	16.30	492,015.50
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	16.31	646,596.08
RWE STAMM	56,470	32.67	1,844,874.90
SNAM SPA	203,694	4.47	911,123.26
SUEZ	28,043	11.47	321,793.42
TERNA SPA	130,230	6.35	827,481.42
UNIPER SE	20,192	28.20	569,414.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	19.25	1,013,839.75
VERBUND AG	7,463	44.42	331,506.46
ASML HOLDING NV	40,029	317.45	12,707,206.05
INFINEON TECHNOLOGIES	115,347	22.48	2,593,577.29
STMICROELECTRONICS	56,957	24.75	1,409,685.75
	17,720,815		357,847,567.33

ユーロ 小計				(44,970,703,786)
イギリスポンド	BP PLC	1,887,419	2.83	5,354,607.70
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	383,729	11.54	4,429,767.57
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	345,955	11.08	3,833,181.40
	ANGLO AMERICAN PLC	112,174	19.45	2,182,232.99
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.48	411,806.16
	BHP GROUP PLC	195,828	17.89	3,503,362.92
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,371	59.82	680,213.22
	EVRAZ PLC	43,000	3.45	148,694.00
	GLENCORE PLC	901,837	1.76	1,588,315.32
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	23.92	403,004.16
	MONDI PLC	47,780	15.33	732,467.40
	RIO TINTO PLC REG	104,428	47.90	5,002,623.34
	ASHTED GROUP PLC	42,021	27.45	1,153,476.45
	BAE SYSTEMS PLC	308,746	5.38	1,661,053.48
	BUNZL PLC	33,283	24.14	803,451.62
	DCC PLC	9,127	69.08	630,493.16
	FERGUSON PLC	20,559	74.30	1,527,533.70
	MELROSE INDUSTRIES PLC	508,486	1.04	530,859.38
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,244	2.62	538,355.01
	SMITHS GROUP PLC	37,146	14.35	533,045.10
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	106.65	773,745.75
	EXPERIAN PLC	87,481	27.88	2,438,970.28
	INTERTEK GROUP PLC	15,404	58.52	901,442.08
	RELX PLC	185,932	17.40	3,235,216.80
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	5.29	957,839.14
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.22	504,146.99
	BURBERRY GROUP PLC	40,410	14.21	574,428.15
	PERSIMMON PLC	31,506	27.52	867,045.12
	TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.22	435,841.18
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	46.42	492,005.58
	COMPASS GROUP PLC	162,339	11.49	1,866,086.80
	GVC HOLDINGS PLC	59,240	7.69	455,555.60
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	39.96	640,998.36	
WHITBREAD PLC	17,434	23.72	413,534.48	
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.50	535,265.50	
INFORMA PLC	158,400	4.07	645,955.20	
ITV PLC	295,435	0.61	182,578.83	
PEARSON	66,305	5.93	393,719.09	
WPP PLC	113,065	6.13	693,540.71	
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	6.79	217,408.00	
KINGFISHER PLC	170,994	2.77	474,508.35	

NEXT PLC	13,238	60.88	805,929.44
OCADO GROUP PLC	44,612	23.88	1,065,334.56
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.98	415,593.49
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.87	277,905.62
TESCO	919,600	2.27	2,093,929.20
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	36,715	20.09	737,604.35
BRITISH AMERICAN TOBACCO	213,713	25.65	5,482,807.01
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.99	376,980.40
DIAGEO	217,858	26.42	5,755,808.36
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	12.98	1,186,579.68
RECKITT BENCKISER PLC	66,097	76.36	5,047,166.92
UNILEVER PLC	108,846	45.61	4,964,466.06
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	15.34	1,274,417.59
ASTRAZENECA	123,279	86.08	10,611,856.32
GLAXOSMITHKLINE	470,077	15.50	7,289,954.11
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	23.88	392,921.52
BARCLAYS	1,669,454	1.10	1,839,738.30
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,902,680	3.35	6,385,394.08
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.28	1,902,195.15
NATWEST GROUP PLC	479,086	1.15	551,667.52
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	4.13	1,052,923.08
3I GROUP PLC	88,121	9.27	817,410.39
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	17.38	575,078.41
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	30,265	88.48	2,677,847.20
M&G PLC	229,107	1.80	412,392.60
SCHRODERS PLC	11,794	30.12	355,235.28
ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	10.04	449,290.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.63	614,349.99
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	26.80	435,634.00
AVIVA PIC	381,270	2.87	1,094,626.17
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.09	351,493.06
LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.27	1,248,904.06
PRUDENTIAL	246,816	12.50	3,086,434.08
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	4.49	388,642.15
AVEVA GROUP PLC	6,717	42.90	288,159.30
SAGE GROUP PLC	111,321	7.39	823,107.47
HALMA PLC	37,159	22.49	835,705.91
BT GROUP PLC	817,227	1.05	862,174.48
VODAFONE GROUP PLC	2,475,816	1.18	2,930,870.98
NATIONAL GRID PLC	334,044	8.73	2,916,204.12
SEVERN TRENT PLC	25,000	24.25	606,250.00
SSE PLC	100,354	12.95	1,299,584.30

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.58	576,164.16
	イギリス債券 小計	27,215,178		136,505,106.94 (18,981,035,120)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.92	329,257.15
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	807.50	656,497.50
	GIVAUDAN-REG	849	3,804.00	3,229,596.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,484	43.75	2,077,425.00
	SIKA AG-BR	12,290	211.90	2,604,251.00
	ABB LTD	176,891	24.09	4,261,304.19
	GEBERIT AG-REG	3,423	524.80	1,796,390.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	236.20	498,854.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	237.60	895,276.80
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	47.95	634,090.80
	SGS SA	586	2,356.00	1,380,616.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	168.50	853,789.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	47,970	60.06	2,881,078.20
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	199.60	495,606.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	37.94	149,407.72
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,978.00	553,840.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	81,700.00	817,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,785.00	809,640.00
	NESTLE SA - REGISTERED	278,934	110.86	30,922,623.24
	ALCON INC	44,953	55.24	2,483,203.72
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	216.00	1,109,808.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	905.00	917,670.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,876	563.80	3,876,688.80
	NOVARTIS	202,202	78.41	15,854,658.82
	ROCHE HOLDING GENUSS	66,209	322.60	21,359,023.40
	VIFOR PHARMA AG	4,486	137.05	614,806.30
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,550	100.60	357,130.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	220,884	10.31	2,277,314.04
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	42.84	907,222.68
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,811	913.80	1,654,891.80
	UBS GROUP AG	338,963	11.14	3,777,742.63
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	144.40	693,842.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	359.10	1,023,075.90
	SWISS RE LTD	28,362	73.46	2,083,472.52
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,901	340.10	4,727,730.10
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	84.05	626,844.90
	TEMENOS AG - REG	6,511	137.55	895,588.05
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	68.24	1,002,172.64
	SWISSCOM	2,441	523.00	1,276,643.00

	スイスフラン 小計	1,615,900		123,366,074.00 (14,305,529,941)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	219.10	3,773,340.20	
	BOLIDEN AB	23,903	254.40	6,080,923.20	
	SCA SV CELLULOSA B	64,571	113.25	7,312,665.75	
	ALFA LAVAL AB	27,268	224.00	6,108,032.00	
	ASSA ABLOY AB-B	90,383	199.40	18,022,370.20	
	ATLAS COPCO A	63,684	398.50	25,378,074.00	
	ATLAS COPCO B	36,538	346.80	12,671,378.40	
	EPIROC AB-A	58,039	130.25	7,559,579.75	
	EPIROC AB-B	29,972	125.65	3,765,981.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	18,468	193.90	3,580,945.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	33,536	254.50	8,534,912.00	
	SANDVIK AB	101,932	172.30	17,562,883.60	
	SKANSKA B	28,530	179.05	5,108,296.50	
	SKF AB-B	35,405	172.50	6,107,362.50	
	VOLVO B	134,889	165.00	22,256,685.00	
	SECURITAS B	35,993	126.50	4,553,114.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	183.00	3,325,110.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	92.72	3,589,376.64	
	EVOLUTION GAMING GROUP	11,183	617.60	6,906,620.80	
	HENNES & MAURITZ B	77,319	141.60	10,948,370.40	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	430.20	3,423,961.80	
	SWEDISH MATCH AB	16,014	704.20	11,277,058.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	296.90	16,948,536.50	
	NORDEA BANK ABP	309,938	69.71	21,605,777.98	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	85.10	13,250,921.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	86.96	13,077,566.56	
SWEDBANK AB-A	86,716	144.94	12,568,617.04		
EQT AB	20,102	200.60	4,032,461.20		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	232.20	3,899,102.40		
INVESTOR AB-B SHS	43,938	550.00	24,165,900.00		
KINNEVIK AB - B	23,604	329.50	7,777,518.00		
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	434.40	3,162,432.00		
ERICSSON (LM) B	263,755	101.40	26,744,757.00		
HEXAGON AB-B SHS	26,504	603.20	15,987,212.80		
TELE2 AB-B SHS	50,012	125.15	6,259,001.80		
TELIA CO AB	257,822	34.05	8,778,839.10		
	スウェーデンクローナ 小計	2,439,334		376,105,686.42 (4,588,489,374)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	92,158	143.10	13,187,809.80	
	NORSK HYDRO	106,150	27.34	2,902,141.00	

	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	385.00	7,110,950.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	330.60	2,304,612.60
	MOWI ASA	40,968	184.60	7,562,692.80
	ORKLA	69,804	90.06	6,286,548.24
	DNB ASA	85,517	144.40	12,348,654.80
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	187.70	3,486,339.80
	TELENOR ASA	71,821	146.50	10,521,776.50
	ノルウェークローネ 小計	510,433		65,711,525.54 (782,624,269)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	718.20	7,431,215.40
	NOVOZYMES A/S	19,125	364.80	6,976,800.00
	VESTAS WIND SYSEMS	17,951	926.80	16,636,986.80
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	9,030.00	2,699,970.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	9,768.00	6,339,432.00
	DSV PANALPINA A S	20,416	935.00	19,088,960.00
	PANDORA A/S	8,431	399.30	3,366,498.30
	CARLSBERG AS-B	10,388	891.40	9,259,863.20
	AMBU A/S-B	18,085	220.60	3,989,551.00
	COLOPLAST-B	11,223	1,010.00	11,335,230.00
	DEMANT A/S	11,604	189.80	2,202,439.20
	GN STORE NORD A/S	11,117	435.60	4,842,565.20
	GENMAB A/S	6,320	2,313.00	14,618,160.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	217.50	1,059,442.50
	NOVO NORDISK A/S-B	166,015	418.40	69,460,676.00
	DANSKE BANK A/S	57,713	102.25	5,901,154.25
TRYG A/S	9,828	193.20	1,898,769.60	
ORSTED A/S	17,372	877.20	15,238,718.40	
	デンマーククローネ 小計	401,754		202,346,431.85 (3,415,607,769)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	28.63	590,608.27
	OIL SEARCH LTD	222,327	3.09	686,990.43
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.90	977,010.50
	SANTOS	156,437	5.88	919,849.56
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.82	266,766.66
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	20.54	1,865,627.66
	BHP GROUP LTD	274,547	39.06	10,723,805.82
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.56	619,559.68
	EVOLUTION MINING LTD	174,295	6.00	1,045,770.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	18.16	2,810,732.16
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	31.18	1,347,849.04
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	33.86	2,508,958.28
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	64,628	14.45	933,874.60

ORICA LTD	44,211	18.19	804,198.09
RIO TINTO LTD	35,522	101.67	3,611,521.74
SOUTH32 LTD	481,840	2.15	1,035,956.00
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	22.88	210,953.60
BRAMBLES LTD	137,883	11.26	1,552,562.58
AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.61	882,773.51
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	3.76	319,600.00
TRANSURBAN GROUP	262,342	13.59	3,565,227.78
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	28.25	1,490,244.00
CROWN RESORTS LTD	30,328	9.80	297,214.40
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	3.67	612,324.82
REA GROUP LTD	5,276	118.68	626,155.68
SEEK LTD	26,358	19.71	519,516.18
WESFARMERS LTD	109,322	48.88	5,343,659.36
COLES GROUP LTD	128,408	18.95	2,433,331.60
WOOLWORTHS GROUP LTD	120,802	40.58	4,902,145.16
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.87	409,173.10
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	9.68	682,807.84
COCHLEAR LIMITED	6,220	210.30	1,308,066.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	67.93	1,103,726.64
SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	34.58	1,385,828.08
CSL LIMITED	42,501	312.05	13,262,437.05
AUST AND NZ BANKING GROUP	271,505	18.68	5,071,713.40
COMMONWEALTH BANK OF AUST	165,125	71.04	11,730,480.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	295,326	17.89	5,283,382.14
WESTPAC BANKING	334,568	17.40	5,821,483.20
AMP LTD	343,649	1.44	496,572.80
ASX LTD	16,798	87.52	1,470,160.96
MACQUARIE GROUP LIMITED	30,997	128.08	3,970,095.76
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	63.32	690,947.84
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	5.09	1,065,616.95
MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.86	771,799.60
QBE INSURANCE GROUP	127,160	10.82	1,375,871.20
SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	8.80	1,050,315.20
AFTERPAY LTD	18,973	74.90	1,421,077.70
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	13.54	600,851.04
WISETECH GLOBAL LTD	18,000	27.87	501,660.00
TELSTRA CORP	403,126	3.07	1,237,596.82
TPG TELECOM LTD	31,475	7.39	232,600.25
AGL ENERGY LTD	64,235	15.48	994,357.80
AUSNET SERVICES	187,145	1.84	345,282.52
	6,574,783		115,788,691.05

オーストラリアドル 小計				(8,827,729,805)
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	136,010	6.39	869,103.90
	A2 MILK CO LTD	66,854	20.35	1,360,478.90
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	35.70	1,946,364.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.25	481,200.25
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.97	989,686.70
	MERCURY NZ LTD	85,000	5.17	439,450.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.70	520,109.52
ニュージーランドドル 小計		688,177		6,606,393.27 (460,267,419)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	51.75	13,273,668.00
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	6.77	1,103,510.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	92.50	12,441,250.00
	MTR CORP	151,000	40.20	6,070,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	211,000	59.15	12,480,650.00
	SANDS CHINA LTD	242,800	32.15	7,806,020.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	9.82	1,296,240.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	14.40	2,027,520.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	28.00	4,085,200.00
	WH GROUP LTD	936,500	6.90	6,461,850.00
	BANK EAST ASIA	109,160	18.18	1,984,528.80
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	22.40	8,075,200.00
	HANG SENG BANK	74,200	122.80	9,111,760.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,400	373.60	41,619,040.00
	AIA GROUP LTD	1,134,400	74.60	84,626,240.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	257,996	42.70	11,016,429.20
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.75	3,589,750.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	30.25	3,788,147.00
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	19.62	1,265,490.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	155,375	40.90	6,354,837.50
	SINO LAND CO	315,400	9.13	2,879,602.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	99.00	11,731,500.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	41.85	1,694,925.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.85	2,005,770.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	143,000	32.30	4,618,900.00
	PCCW LTD	357,000	4.90	1,749,300.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	41.20	2,781,000.00
CLP HOLDINGS	157,000	76.60	12,026,200.00	
HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	11.08	11,418,815.32	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	44.35	6,098,125.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	87.20	2,066,640.00	
		7,566,634		297,548,307.82

香港ドル 小計				(4,073,436,334)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	116,500	4.75	553,375.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,500	3.50	383,250.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.93	186,906.50
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	3.62	392,161.84
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.70	433,575.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	19.00	188,100.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.86	867,996.00
	DBS GROUP	174,800	20.88	3,649,824.00
	OCBC BANK	315,600	8.90	2,808,840.00
	UNITED OVERSEAS BANK	105,200	20.06	2,110,312.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	8.65	677,295.00
	CAPITALAND LTD	223,500	2.78	621,330.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.02	343,256.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.56	311,600.00
	VENTURE CORP LTD	25,700	20.33	522,481.00
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.33	1,752,726.19	
シンガポールドル 小計		3,103,375		15,803,028.53 (1,223,944,559)
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	12.85	870,664.60
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	466.60	1,001,323.60
	BANK HAPOLIM BM	98,310	20.48	2,013,388.80
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	16.83	2,367,223.65
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	10.70	1,064,650.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	73.21	915,344.63
	AZRIELI GROUP	4,323	183.20	791,973.60
	NICE LTD	6,172	754.60	4,657,391.20
イスラエルシェケル 小計		431,365		13,681,960.08 (426,466,695)
合 計		99,584,896		407,150,795,041 (407,150,795,041)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,304,308.20	
		LENDLEASE GROUP	55,692	629,876.52	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	482,548.20	
		SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	17,448	13,173.24	
	オーストラリアドル 小計		277,413	2,429,906.16 (185,256,045)	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,759,590.00		

		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,357,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,117,090.00 (83,742,962)	
		投資信託受益証券合計	872,913	268,999,007 (268,999,007)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	644,864.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,175	1,915,618.50	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	41,635	10,210,151.05	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	928,673.07	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,030,441.75	
		BOSTON PROPERTIES	14,788	1,244,705.96	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	763,325.68	
		CROWN CASTLE INTL CORP	38,704	6,294,818.56	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,813,330.18	
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,327,665.60	
		EQUINIX INC	8,137	6,336,363.27	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,074,175.40	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	1,921,079.55	
		ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,331,624.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,259,819.40	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	567,061.98	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,101	1,271,255.99	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	730,580.11	
		INVITATION HOMES INC	51,458	1,476,844.60	
		IRON MOUNTAIN INC	27,546	826,380.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	932,671.04	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,236,451.20	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	572,393.40	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	625,832.34	
		PROLOGIS INC	68,838	7,003,578.12	
		PUBLIC STORAGE	15,009	2,963,226.87	
		REALTY INCOME CORP	30,398	1,825,399.90	
		REGENCY CENTERS CORP	17,800	715,560.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,751	3,206,163.22	
		SIMON PROPERTY GROUP	27,990	1,788,001.20	
SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,305,269.35			
UDR INC	28,059	959,056.62			
VENTAS INC	33,353	1,346,460.61			
VEREIT INC	105,798	690,860.94			
VICI PROPERTIES INC	44,224	1,022,016.64			
VORNADO REALTY TRUST	15,390	526,491.90			
WELLTOWER INC	38,031	2,051,772.45			

	WP CAREY INC	16,500	1,144,770.00	
	アメリカドル 小計	1,199,698	75,884,754.85 (8,050,613,642)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	410,757.14	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	185,105.25	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	237,306.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	114,647.16	
	カナダドル 小計	42,473	947,816.35 (76,071,740)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	306,899.70	
	GECINA SA	4,459	493,611.30	
	ICADE	2,845	154,910.25	
	KLEPIERRE	17,225	231,504.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	527,120.55	
	ユーロ 小計	43,186	1,714,045.80 (215,404,135)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	277,949.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	320,854.00	
	SEGRE PLC	106,999	1,010,712.55	
	イギリスポンド 小計	244,963	1,609,515.55 (223,803,137)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	797,883.20	
	GOODMAN GROUP	162,271	2,966,313.88	
	GPT GROUP	167,884	632,922.68	
	MIRVAC GROUP	392,919	805,483.95	
	SCENTRE GROUP	486,663	968,459.37	
	STOCKLAND	207,412	709,349.04	
	VICINITY CENTERS	291,115	371,171.62	
	オーストラリアドル 小計	1,802,354	7,251,583.74 (552,860,744)	
香港ドル	LINK REIT	199,000	12,258,400.00	
	香港ドル 小計	199,000	12,258,400.00 (167,817,496)	
シンガポー ルドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	934,340.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	386,370.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	370,555.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	415,800.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	215,000	451,500.00	
	SUNTEC REIT	173,000	233,550.00	
	シンガポールドル 小計	1,325,300	2,792,115.00 (216,249,306)	
	投資証券合計	4,856,974	9,502,820,200 (9,502,820,200)	

合計		9,771,819,207 (9,771,819,207)	
----	--	----------------------------------	--

(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 590銘柄	97.3%			69.8%
	投資証券 38銘柄			2.7%	1.9%
カナダドル	株式 80銘柄	99.5%			3.4%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.5%			10.8%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 84銘柄	98.8%			4.6%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 36銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	92.3%			2.1%
	投資信託受益証券 4銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 31銘柄	94.2%			1.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	85.0%			0.3%
	投資証券 6銘柄			15.0%	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。

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 8月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	475,718,985
コール・ローン	2,653,268,706
国債証券	284,855,502,550
派生商品評価勘定	6,777,725
未収入金	6,712,774
未収利息	1,586,921,298
前払金	4,464,363
前払費用	88,842,720
差入委託証拠金	521,040,954
流動資産合計	290,199,250,075
資産合計	290,199,250,075
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,534,824
未払金	322,122
未払解約金	98,760,707
未払利息	4,507
流動負債合計	111,622,160
負債合計	111,622,160
純資産の部	
元本等	
元本	96,830,254,121
剰余金	
剰余金又は欠損金()	193,257,373,794
元本等合計	290,087,627,915
純資産合計	290,087,627,915
負債純資産合計	290,199,250,075

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 8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>

2020年 8月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<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 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,830,254,121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 2.9958円 (1万口当たり純資産額) (29,958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 8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 8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 8月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	138,036,622,052円
期中追加設定元本額	19,637,752,124円
期中一部解約元本額	60,844,120,055円
期末元本額	96,830,254,121円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,600,285,042円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	624,744,946円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,046,125,872円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,985,257円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,606,423,634円
世界経済インデックスファンド	6,861,511,150円
D C マイセレクション 2 5	1,777,090,745円
D C マイセレクション 5 0	1,430,612,556円
D C マイセレクション 7 5	872,693,259円

区分	2020年 8月20日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	2,030,752,641円
D C マイセレクション S 2 5	758,266,637円
D C マイセレクション S 5 0	609,320,147円
D C マイセレクション S 7 5	277,781,755円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	44,574,262円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	70,137,332円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	34,118,621円
D C 世界経済インデックスファンド	9,023,671,532円
外国債券インデックス・オープン (SMA 専用)	560,152,326円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA 専用)	30,059,707円
マイセレクション 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,486,344円
マイセレクション 7 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	1,500,041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)	38,839,504円
バランス 3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	80,099,161円
バランス 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	118,169,571円
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	125,596,859円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	205,822,811円
バランス A (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,774,830,211円
バランス B (3 7 . 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	508,131,653円
バランス C (5 0) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,946,092,537円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	766,455,099円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	68,226,844円
バランス D (3 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	534,024,820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)	31,118,124円
バランス E (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	206,520,875円
バランス F (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	260,057,126円
F O F s 用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	860,039,342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)	764,426,264円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	763,704,356円
外国債券ファンド・シリーズ 1	591,858,266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
分散投資コア戦略ファンド S	6,316,052,062円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	323,746,401円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	3,069,092,261円
コア投資戦略ファンド (切替型)	831,561,472円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	198,152,784円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	94,777,266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)	1,085,932,592円
S M T インデックスバランス・オープン	187,351,642円
外国債券 S M T B セレクション (SMA 専用)	20,769,147,158円
S M T 世界経済インデックス・オープン	113,616,277円

区分	2020年 8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）	112,451,857円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	197,075,680円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,055,657円
グローバル経済コア	802,847,987円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	9,448,292円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	263,613円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	222,038,578円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,837,078円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	197,778円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	324,626円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	118,768円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	164,661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）	628,559,644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）	10,316,913,025円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	343,771,264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）	361,338,875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）	67,397,534円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8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		1,489,830,212
合計		1,489,830,212

(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 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益	
			(円)		
市場取引	債券先物取引 買建	2,744,343,648	うち1年超	4,464,363	
			-		
合計		2,744,343,648	-	2,739,879,285	4,464,363

(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 8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	2,446,517,536	-	2,445,224,800	1,292,736
	アメリカドル	1,072,415,029	-	1,068,984,000	3,431,029
	カナダドル	123,391,287	-	123,569,600	178,313
	ユーロ	1,058,661,242	-	1,060,823,600	2,162,358
	イギリスポンド	192,049,978	-	191,847,600	202,378
	合計	2,446,517,536	-	2,445,224,800	1,292,736

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,174,185.52	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,018,125.04	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	998,476.56	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	8,038,750.00	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,297,276.59	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,946,660.95	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,506,289.08	
		T 0.625% 05/15/30	3,100,000.00	3,087,648.45	
		T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,989,475.00	

T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	5,047,070.30	
T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,830,679.68	
T 1.25% 05/15/50	4,550,000.00	4,357,335.93	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,694,320.31	
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,132,617.20	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,172,460.95	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,590,820.32	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,149,062.52	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,131,835.95	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,587,890.62	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,980,523.43	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,064,468.75	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,140,000.00	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,269,140.60	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,948,296.89	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,939,277.36	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,663,203.12	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,637,675.79	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,858,914.47	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,040,546.88	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,573,388.67	
T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	15,947,898.43	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,150,000.00	
T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,230,273.45	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,839,515.62	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,550,570.31	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,433,012.50	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,844,037.09	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,561,230.47	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,796,583.96	
T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,649,209.00	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,905,316.39	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,850,284.37	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,821,951.14	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,208,222.63	
T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,046,796.85	
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,573,337.51	
T 1.75% 07/31/21	6,700,000.00	6,802,462.89	
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,324,214.86	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,303,750.00	
T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,173,954.09	
T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,174,589.87	

T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,565,966.80
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,652,968.75
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,580,197.25
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,301,640.67
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,643,111.34
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,140,312.52
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,396,093.78
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,756,944.52
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,732,285.19
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,519,496.11
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,444,648.46
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,910,195.29
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,919,763.08
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,608,687.51
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,461,679.66
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,220,429.68
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,158,125.02
T 2.125% 08/15/21	5,370,000.00	5,475,512.12
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,527,324.19
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,618,750.00
T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,039,881.27
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,594,267.56
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,567,089.04
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,282,187.52
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,984,144.57
T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,138,671.88
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,525,273.42
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,060,117.18
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,589,359.37
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	8,636,941.44
T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	12,235,218.75
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,828,363.29
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	11,008,785.20
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,841,375.00
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,601,468.75
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,810,605.48
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,127,781.29
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,270,898.45
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,199,875.01
T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,462,718.78
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,113,906.25
T 2.375% 05/15/29	15,010,000.00	17,275,571.87
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,565,918.00

T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	9,236,718.75	
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,714,296.87	
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,798,339.82	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,496,093.75	
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,072,085.91	
T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,438,425.80	
T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,518,085.98	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,297,271.49	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,573,660.17	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	6,256,871.11	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,865,656.25	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,268,921.87	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,675,812.50	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,487,171.88	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,033,623.06	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,243,957.01	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,785,468.75	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,530,221.87	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,266,132.82	
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,655,625.00	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,850,453.11	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,158,117.19	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,155,058.58	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,075,781.25	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,283,808.58	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,852,656.25	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,457,429.68	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,744,980.48	
T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,335,390.64	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,626,573.45	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,388,468.75	
T 2.75% 11/15/47	6,050,000.00	7,904,703.12	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,486,093.76	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,546,948.47	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,734,832.05	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,513,407.81	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,291,382.04	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,153,164.08	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,536,750.00	
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,660,546.87	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,147,812.50	
T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,478,403.34	

T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	5,971,582.04
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,631,975.57
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,373,163.27
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,568,798.82
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,228,710.95
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,117,302.32
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,707,421.90
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,640,790.62
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,535,937.52
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,876,835.96
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,108,046.89
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,471,882.06
T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,811,805.08
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,775,580.06
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,405,859.40
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,455,125.00
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,213,256.25
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,084,062.50
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,255,515.63
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,191,777.35
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,749,062.50
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,573,023.46
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,395,153.91
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,126,593.79
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,371,933.60
T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,378,478.92
T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	10,692,218.75
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,086,421.87
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,513,937.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,920,625.00
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,946,406.26
T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	8,181,679.71
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,155,515.62
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,804,500.00
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	6,080,507.81
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,635,390.66
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,159,282.82
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,696,289.08
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,764,707.81
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,475,015.62
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,774,546.89
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,692,968.75
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	8,097,074.24

	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,386,843.75	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,663,796.87	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,548,671.88	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,993,687.50	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,096,082.04	
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,975,739.06	
	T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,421,644.53	
	T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,514,500.00	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,699,148.44	
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,847,604.69	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,241,953.12	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,794,460.94	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,736,035.16	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,793,796.87	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,883,105.47	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,666,781.25	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,222,152.34	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,035,550.78	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,608,058.59	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,949,835.93	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,865,484.37	
	アメリカドル 小計	1,061,750,000.00	1,183,687,079.68	(125,577,362,283)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,045,596.10	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	4,012,164.45	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,714,971.50	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,040,000.00	3,232,675.20	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,902,983.00	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,231,907.05	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,106,979.20	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,447,196.40	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	628,128.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,755,062.20	
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	518,950.00	
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,536,775.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,457,389.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,964,772.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,514,065.25	
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,938,024.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,834,489.40	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,786,968.80	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	891,503.20	

	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,461,390.15
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,218,179.70
	CAN 2% 12/01/51	1,940,000.00	2,403,999.50
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,301,731.10
	CAN 4.0% 06/01/41	1,550,000.00	2,430,035.75
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,691,574.30
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,585,040.00
	CAN 5% 06/01/37	1,330,000.00	2,187,770.20
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,782,150.25
	カナダドル 小計	58,560,000.00	67,582,470.70 (5,424,169,098)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,665,149.75
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	35,448,890.50
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,313,423.95
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,124,311.85
	MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,076,575.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,240,676.10
	MBONO 7.5% 06/03/27	41,630,000.00	46,421,404.85
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	19,216,036.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,923,590.95
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	17,876,492.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,875,705.95
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,722,362.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,411,127.45
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	24,447,999.00
	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,630,711.50
	メキシコペソ 小計	396,370,000.00	443,394,457.35 (2,119,425,506)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,412,161.75
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,550,143.35
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	703,630.95
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,694,025.90
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,324,806.50
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,831,596.65
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,703,559.00
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,714,338.75
	BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,374,460.55
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	991,852.25
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	643,178.85
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,910,458.00
	BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,336,375.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,660,896.00
	BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,588,821.20

BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,675,698.70
BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,532,919.10
BGB 2.25% 06/22/23	1,470,000.00	1,591,267.65
BGB 2.25% 06/22/57	680,000.00	1,066,277.40
BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,743,255.40
BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,328,683.50
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,455,997.70
BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	4,125,556.05
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,476,171.50
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,318,274.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,463,714.40
BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,311,756.20
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,597,465.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,040,771.70
BGB 5% 03/28/35	2,920,000.00	5,028,532.00
BKO 0% 03/11/22	6,040,000.00	6,102,725.40
BKO 0% 09/10/21	1,470,000.00	1,480,444.35
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,036,435.10
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	581,409.40
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,598,085.80
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,213,421.70
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,289,082.50
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,245,158.20
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,051,400.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,646,886.50
BTPS 0.95% 08/01/30	1,510,000.00	1,515,738.00
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,054,441.10
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,036,365.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	1,043,300.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,972,500.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,250,000.00	1,272,218.75
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,418,197.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,054,515.80
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,522,784.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,541,899.30
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,383,806.20
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,208,840.60
BTPS 1.65% 12/01/30	1,820,000.00	1,940,374.80
BTPS 1.75% 07/01/24	1,600,000.00	1,695,256.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,125,810.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,889,877.50
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,207,736.00
BTPS 2.05% 08/01/27	1,740,000.00	1,906,100.40

BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,494,928.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,578,775.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,520,505.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,569,330.85	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,779,204.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,880,537.50	
BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	986,088.45	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,182,858.40	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,267,936.25	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,228,966.75	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,985,506.95	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,600,176.60	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,198,892.15	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,750,000.00	3,374,112.50	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,806,164.25	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,263,835.75	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,776,611.70	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,537,232.75	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,310,000.00	2,932,776.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,864,554.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,902,598.80	
BTPS 3.75% 08/01/21	1,660,000.00	1,722,573.70	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,451,505.25	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,746,706.95	
BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,890,248.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,172,881.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,536,310.40	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,019,337.60	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,600,397.35	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,153,464.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,759,075.20	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,489,706.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,773,636.10	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,166,661.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,945,213.80	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,393,056.25	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,872,883.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,710,475.00	
BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,510,325.00	
BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,326,376.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	5,040,242.10	
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,028,604.35	

BTPS 6.5% 11/01/27	5,240,000.00	7,361,990.40
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,922,667.10
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,972,236.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,028,468.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,390,532.10
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,168,290.60
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,331,433.70
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,166,515.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,200,085.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,596,006.05
DBR 0.5% 08/15/27	3,160,000.00	3,418,108.80
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,745,840.35
DBR 0% 05/15/35	810,000.00	844,032.15
DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,656,019.05
DBR 0% 08/15/29	4,640,000.00	4,871,675.20
DBR 0% 08/15/50	1,980,000.00	2,003,888.70
DBR 1.25% 08/15/48	3,050,000.00	4,178,896.50
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,126,189.20
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,314,168.10
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,482,921.05
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,927,638.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,795,101.00
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,186,652.05
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,139,490.00
DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,476,503.60
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,009,874.75
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,818,060.80
DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,770,061.90
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,423,997.50
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,095,921.40
DBR 3.25% 07/04/42	2,940,000.00	5,207,754.30
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,051,686.25
DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,640,935.65
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,653,244.75
DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,451,875.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,715,170.85
DBR 5.5% 01/04/31	3,580,000.00	5,871,522.20
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,423,697.00
DBR 6.25% 01/04/24	5,440,000.00	6,740,323.20
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,070,468.75
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,473,390.80
FRTR 0.25% 11/25/26	4,530,000.00	4,739,036.85
FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,285,727.50

FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,390,386.35	
FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,285,320.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	1,210,000.00	1,272,091.15	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,476,483.60	
FRTR 0.75% 05/25/52	1,820,000.00	1,955,016.70	
FRTR 0.75% 11/25/28	7,590,000.00	8,282,815.20	
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,018,980.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,082,123.50	
FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,195,385.05	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,376,200.55	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,077,627.50	
FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,220,227.65	
FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,094,388.00	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,387,607.60	
FRTR 0% 11/25/30	2,160,000.00	2,201,364.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,998,526.80	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,240,158.40	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,405,166.30	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,330,000.00	4,298,330.70	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,894,707.15	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,625,268.60	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,477,551.40	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,395,183.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,107,304.25	
FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,928,373.60	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,544,563.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,103,801.20	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,160,000.00	6,556,192.80	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,790,353.00	
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,905,155.50	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,656,944.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,909,561.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,823,993.75	
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	9,009,885.15	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,807,939.20	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	9,000,439.35	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,259,827.20	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	5,067,924.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,960,000.00	4,380,502.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,720,507.60	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,829,990.85	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,477,234.10	

FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,557,333.50
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,247,655.00
IRISH 0.2% 05/15/27	1,270,000.00	1,319,218.85
IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	859,767.95
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	502,653.60
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	838,249.10
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,173,222.90
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,969.50
IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	1,029,769.80
IRISH 1.3% 05/15/33	630,000.00	737,197.65
IRISH 1.35% 03/18/31	630,000.00	729,536.85
IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	812,233.80
IRISH 1.7% 05/15/37	890,000.00	1,118,738.90
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,540,827.80
IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,757,315.00
IRISH 2% 02/18/45	1,170,000.00	1,634,261.85
IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,326,280.20
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,129,018.40
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,922,275.30
NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,504,736.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,697,000.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,250,000.00	1,393,418.75
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,471,182.80
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,298,254.20
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,781,125.20
NETHER 0% 01/15/22	1,490,000.00	1,502,799.10
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,890,515.00
NETHER 0% 01/15/27	800,000.00	827,932.00
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,666,913.50
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,275,745.30
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	696,428.70
NETHER 2.5% 01/15/33	1,930,000.00	2,606,030.75
NETHER 2.75% 01/15/47	2,220,000.00	3,857,649.60
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,199,248.50
NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,254,036.10
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,770,479.80
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,573,443.25
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,513,179.65
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	239,671.00
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,977,111.00
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,679,242.75
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,873,393.75
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,262,757.20

OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,223,065.60	
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,619,786.00	
OBL 0% 10/10/25	2,240,000.00	2,319,374.40	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,544,797.95	
OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,420,265.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,257,995.70	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	950,520.00	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,766,869.20	
RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	644,120.40	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,313,350.70	
RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,162,634.40	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,527,472.50	
RAGB 0% 07/15/24	1,430,000.00	1,464,398.65	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,361.60	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,816,654.20	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,247,897.25	
RAGB 1.5% 11/02/86	450,000.00	712,944.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,085,807.25	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,431,612.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,568,191.60	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,388,244.30	
RAGB 3.15% 06/20/44	890,000.00	1,527,369.05	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,990,000.00	3,266,305.90	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,806,466.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,243,572.20	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,106,058.05	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,085,755.40	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,714,934.10	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,736,960.00	
RFGB 0.125% 04/15/36	510,000.00	524,086.20	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	415,490.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	657,367.40	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,400,665.10	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	719,563.25	
RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	699,250.50	
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	554,590.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	742,164.00	
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	394,104.75	
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	550,611.00	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	430,806.60	
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	749,875.20	
RFGB 1.375% 04/15/47	540,000.00	719,018.10	

RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	687,076.00
RFGB 1.625% 09/15/22	1,250,000.00	1,308,975.00
RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	891,351.75
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	526,560.30
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	801,397.65
RFGB 4% 07/04/25	1,050,000.00	1,291,311.00
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,941,994.95
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,344,376.05
SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,465,325.80
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,425,109.10
SPGB 0.45% 10/31/22	2,360,000.00	2,407,530.40
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,976,908.00
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,887,391.40
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,113,950.00
SPGB 0% 01/31/25	870,000.00	880,627.05
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,405,585.00
SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,813,857.50
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,344,187.75
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,758,861.25
SPGB 1.4% 04/30/28	3,970,000.00	4,385,440.65
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,651,664.50
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,183,680.50
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,870,569.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,375,069.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,319,528.50
SPGB 1.85% 07/30/35	1,820,000.00	2,148,036.80
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,153,297.70
SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,930,123.80
SPGB 1% 10/31/50	1,600,000.00	1,570,112.00
SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,653,584.00
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	3,017,401.60
SPGB 2.7% 10/31/48	2,070,000.00	2,913,007.50
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,067,658.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	3,127,436.55
SPGB 3.45% 07/30/66	1,800,000.00	3,131,028.00
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,910,020.40
SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	4,241,146.40
SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,028,402.30
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,534,152.80
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,612,660.80
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,830,956.00
SPGB 4.9% 07/30/40	2,590,000.00	4,572,334.20
SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,544,342.95

	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,545,950.50
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,316,295.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,248,278.00
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,673,289.20
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,739,290.20
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,569,172.50
	ユーロ 小計	777,390,000.00	939,108,728.05 (118,017,793,854)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/31/23	1,090,000.00	1,093,820.45
	UKT 0.125% 01/31/28	1,250,000.00	1,249,318.75
	UKT 0.375% 10/22/30	1,410,000.00	1,423,500.75
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,576,249.60
	UKT 0.5% 10/22/61	340,000.00	310,471.00
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,507,134.00
	UKT 0.625% 10/22/50	800,000.00	757,216.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,979,898.20
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,933,134.80
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,235,792.95
	UKT 1.25% 10/22/41	950,000.00	1,037,561.50
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,179,750.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,473,905.20
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,471,788.00
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,369,247.00
	UKT 1.625% 10/22/71	1,400,000.00	1,989,757.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,840,000.00	2,277,055.20
	UKT 1.75% 07/22/57	2,030,000.00	2,666,303.50
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,234,862.80
	UKT 1.75% 09/07/37	3,530,000.00	4,147,679.40
	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,222,171.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,676,112.50
	UKT 2.5% 07/22/65	2,130,000.00	3,551,551.35
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,804,914.90
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,964,692.80
	UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,429,587.45
	UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	4,837,561.65
	UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,538,800.90
	UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	3,833,028.65
	UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,932,503.90
	UKT 4.25% 03/07/36	2,490,000.00	3,849,689.40
	UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	4,778,944.50
UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,076,422.60	
UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	873,927.90	

	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,775,929.35	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,960,907.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,587,456.25	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	4,775,809.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,730,614.40	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,344,852.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,232,738.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,246,530.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	4,042,060.80	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,071,241.25	
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,434,687.20	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,850,500.00	
	イギリスポンド 小計	98,880,000.00	133,337,682.25 (18,540,604,716)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,574,842.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,197,441.50	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,238,062.50	
	SGB 1% 11/12/26	9,920,000.00	10,673,820.80	
	SGB 2.5% 05/12/25	8,370,000.00	9,479,652.75	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,235,801.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,731,767.00	
	スウェーデンクローナ 小計	62,390,000.00	70,131,387.55 (855,602,928)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,130,000.00	4,388,909.70	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,179,902.70	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,120,000.00	4,435,571.40	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,503,424.10	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,200,275.00	
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,408,424.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,797,833.90	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	8,055,814.40	
	ノルウェークローネ 小計	49,370,000.00	52,970,155.20 (630,874,548)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,200,335.10	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,479,490.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,466,331.90	
	DGB 1.5% 11/15/23	8,130,000.00	8,691,091.95	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	10,023,746.40	
	DGB 3% 11/15/21	10,860,000.00	11,342,509.80	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,940,000.00	32,100,537.70	
	デンマーククローネ 小計	71,190,000.00	90,304,043.35 (1,524,332,251)	
	POLGB 0.75% 04/25/25	2,100,000.00	2,109,376.50	

ポーランド ズロチ	POLGB 1.25% 10/25/30	210,000.00	207,922.05	
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,666,099.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,204,038.90	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,187,984.20	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,040,853.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,603,006.30	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,498,704.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,710,575.95	
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,060,000.00	4,575,132.80	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,480,000.00	3,897,356.40	
	POLGB 4% 10/25/23	3,730,000.00	4,161,169.35	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	828,495.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,516,597.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,629,636.00	
	ポーランドズロチ 小計		55,040,000.00	59,836,947.15
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,349,941.70	
	ACGB 0.25% 11/21/25	3,590,000.00	3,549,558.65	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,994,387.90	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,060,000.00	2,176,369.40	
	ACGB 1% 12/21/30	3,720,000.00	3,751,117.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	4,160,000.00	4,640,854.40	
	ACGB 2.25% 11/21/22	4,050,000.00	4,229,901.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,364,355.55	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,576,005.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	968,096.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,488,988.80	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,821,358.15	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,587,085.80	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,436,803.25	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,975,316.40	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,938,959.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,937,527.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,708,073.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,208,335.40	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,148,997.20	
ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,475,168.50		
ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,697,426.15		
ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,276,496.75		
ACGB 5.5% 04/21/23	3,720,000.00	4,237,675.20		
ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,697,797.00		
オーストラリアドル 小計		76,810,000.00	87,236,596.70	(6,650,918,132)

シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,456,243.20
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	828,768.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	297,135.45
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	805,527.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	845,259.70
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	534,298.45
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	310,707.80
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,196,464.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,661,476.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	786,887.80
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,143,824.65
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	988,911.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	416,972.50
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	432,896.45
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	677,395.20
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,410,893.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,038,747.60
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,347,178.90
	シンガポールドル 小計		14,160,000.00
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,546,545.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	737,471.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,840,000.00	2,957,249.40
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,631,932.50
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,269,276.40
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,109,075.05
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,143,835.10
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,560,705.00
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,751,374.70
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,569,372.50
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	774,671.25
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,110,504.80
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	811,679.70
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,240,321.90
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,181,361.30
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,577,916.00
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	656,190.00
	MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,778,982.00
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,101,588.25
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,051,135.50
MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	828,422.80	
MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	485,502.25	

	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,383,596.80	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,287,400.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	911,525.40	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,726,919.60	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,775,115.70	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,980,000.00	2,343,211.20	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,742,485.40	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,714,955.60	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	971,332.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,273,744.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	2,550,000.00	3,070,518.75	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,773,609.80	
	マレーシアリングット 小計	51,270,000.00	56,849,527.15 (1,445,114,980)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 04/30/25	250,000.00	252,266.45	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,837,675.75	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	930,000.00	999,500.29	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,770,000.00	1,826,656.98	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,160,000.00	2,449,988.85	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,596,572.88	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,420,000.00	3,545,810.62	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,276,714.47	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,587,527.92	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,169,486.15	
	イスラエルシェケル 小計	29,070,000.00	35,542,200.36 (1,107,850,385)	
	合計		284,855,502,550 (284,855,502,550)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 200銘柄	100.0%	44.1%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 319銘柄	100.0%	41.4%
イギリスポンド	国債証券 46銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%

ノルウェークローネ	国債証券	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	25銘柄	100.0%	2.3%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	34銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	10銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,058,675,670
コール・ローン	56,780,595
株式	70,939,242,437
投資信託受益証券	169,434,779
投資証券	50,082,922
派生商品評価勘定	357,933,277
未収配当金	164,527,210
差入委託証拠金	1,077,202,602
流動資産合計	75,873,879,492
資産合計	75,873,879,492
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,346,435
前受金	356,279,925
未払金	3,073,498
未払解約金	11,041,272
未払利息	96
流動負債合計	371,741,226
負債合計	371,741,226
純資産の部	
元本等	
元本	25,720,936,520
剰余金	
剰余金又は欠損金()	49,781,201,746
元本等合計	75,502,138,266
純資産合計	75,502,138,266

	2020年 8月20日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	75,873,879,492

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8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> <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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引 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> <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>

2020年 8月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,720,936,520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 2.9354円 (1万口当たり純資産額) (29,354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 8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 8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、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>
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 8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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	20,402,768,336円
期中追加設定元本額	6,748,213,426円
期中一部解約元本額	1,430,045,242円
期末元本額	25,720,936,520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	7,672,246,157円
世界経済インデックスファンド	3,907,243,621円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,525,351,848円
DC 世界経済インデックスファンド	4,965,103,660円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	152,871,441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
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	546,256,846円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	620,643,503円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	341,759,684円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	19,704,565円
SMT インデックスバランス・オープン	111,614,804円
SMT 世界経済インデックス・オープン	97,000,062円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	300,254,409円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	61,375,095円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,322,133円
グローバル経済コア	435,751,395円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	22,189,185円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	377,935円

区分	2020年 8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)2040	510,382円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	176,264円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	214,291円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	248,992,093円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	47,230,122円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,292,853,072
投資信託受益証券	4,151,882
投資証券	33,485,127
合計	5,255,216,063

(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 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,983,504,982	-	4,339,784,907	356,279,925
	合計	3,983,504,982	-	4,339,784,907	356,279,925

(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 8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)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	46,024,651	-	46,317,785	293,134
	アメリカドル	46,024,651	-	46,317,785	293,134
	売建	1,768,051	-	1,754,268	13,783
	ブラジルリアル	1,768,051	-	1,754,268	13,783
合計		47,792,702	-	48,072,053	306,917

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

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	617,282	5.14	3,176,533.17	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.72	75,296.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	43,246	71.88	3,108,522.48	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,190	157.30	1,602,887.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	146,513	5.28	773,881.66	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	5.18	638,823.11	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	26,967	48.84	1,317,068.28	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	5.47	84,845.17	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	13.29	224,999.70	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	70,402	27.94	1,967,031.88	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	22.00	431,156.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	12.86	344,879.48	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	121.90	868,415.60	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	13.12	508,701.76	
	SOUTHERN COPPER CORP	11,367	46.73	531,179.91	
	51JOB INC-ADR	2,701	64.50	174,214.50	
	BEST INC - ADR	14,126	4.36	61,589.36	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	35,934	32.42	1,164,980.28	
	NIO INC - ADR	77,076	14.06	1,083,688.56	
	GSX TECHEDU INC- ADR	7,846	87.50	686,525.00	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	38.96	542,362.16		
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,167	137.83	2,090,467.61		
TAL EDUCATION GROUP- ADR	40,978	74.09	3,036,060.02		

	YUM CHINA HOLDINGS INC	38,070	54.60	2,078,622.00	
	58.COM INC-ADR	9,450	55.67	526,081.50	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	88.72	582,979.12	
	BAIDU INC - SPON ADR	29,357	122.71	3,602,397.47	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	9,184	45.27	415,759.68	
	HUYA INC-ADR	8,211	24.84	203,961.24	
	IQIYI INC-ADR	21,239	18.83	399,930.37	
	JOYY INC	6,185	87.62	541,929.70	
	MOMO INC-SPON ADR	15,529	20.62	320,207.98	
	NETEASE INC-ADR	8,567	475.72	4,075,493.24	
	SINA CORP	5,725	39.58	226,595.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	34,090	14.15	482,373.50	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	33.26	174,581.74	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	196,529	260.59	51,213,492.11	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	43.96	154,211.68	
	JD.COM INC-ADR	89,155	72.56	6,469,086.80	
	PINDUODUO INC-ADR	26,536	95.94	2,545,863.84	
	TRIP.COM GROUP LTD	52,406	27.81	1,457,410.86	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	19.26	914,618.88	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47,223	15.46	730,067.58	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	7,243	32.91	238,367.13	
	ZAI LAB LTD-ADR	5,149	80.25	413,207.25	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	173,806	4.08	709,128.48	
	CREDICORP LTD	7,332	129.43	948,980.76	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	289,100	13.10	3,787,210.00	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	0.98	371,232.33	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	30.50	61,640.50	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.84	46,212.76	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	7,645	78.15	597,456.75	
	GLOBANT SA	3,122	172.03	537,077.66	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	9.45	376,620.30	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	7.61	111,988.76	
	アメリカドル 小計	3,128,405		109,808,896.16 (11,649,625,793)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	7.48	11,557,804.28	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	350,392	61.20	21,443,990.40	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	364.59	5,286,555.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	38.63	3,741,392.76	
	ALFA S.A.B. -A	359,900	14.53	5,229,347.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	46.51	1,744,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	249.35	5,811,101.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	172.47	5,360,367.60	

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	172.19	2,923,786.20	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	28.91	6,458,204.90	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	68.81	2,160,634.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	579,880	57.42	33,296,709.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	107.05	5,403,348.75	
	BECLE SAB DE CV	48,100	43.03	2,069,743.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	198,940	129.53	25,768,698.20	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	281.21	7,300,211.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	44.86	8,155,548.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	37.28	6,777,504.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	262,800	83.96	22,064,688.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	17.73	4,476,825.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,625,440	14.22	51,553,756.80	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	66.51	3,824,325.00	
	メキシコペソ 小計	8,195,655		242,408,666.84 (1,158,713,427)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	82.96	1,526,464.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	423,000	23.51	9,944,730.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	446,840	22.89	10,228,167.60	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	19.69	1,488,564.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	23.68	350,464.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	14.89	938,070.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	20.02	2,102,100.00	
	SUZANO SA	62,679	50.63	3,173,437.77	
	VALE SA	372,878	62.39	23,263,858.42	
	WEG SA	84,872	65.88	5,591,367.36	
	CCR SA	125,600	13.62	1,710,672.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	49.01	3,036,267.52	
	RUMO SA	114,200	22.37	2,554,654.00	
	COGNA EDUCACAO	181,284	6.58	1,192,848.72	
	B2W CIA DIGITAL	20,960	112.39	2,355,694.40	
	B2W CIA DIGITAL-RTS	1,389	0.30	416.70	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	77,416	32.75	2,535,374.00	
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	39.76	3,296,382.32	
	MAGAZINE LUIZA SA	83,400	89.70	7,480,980.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	21.25	1,615,000.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	19.65	815,475.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	19,700	63.90	1,258,830.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,500	107.14	2,624,930.00	
	AMBEV SA	517,700	12.85	6,652,445.00	
	BRF SA	52,500	20.83	1,093,575.00	
	JBS SA	106,400	24.61	2,618,504.00	

	NATURA & CO HOLDING SA	66,208	50.84	3,366,014.72	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	61.98	1,245,798.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	65.34	3,554,496.00	
	HYPERA SA	35,300	31.75	1,120,775.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	146,698	19.35	2,838,606.30	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	483,948	20.75	10,041,921.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	32.62	2,880,346.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	529,381	24.12	12,768,669.72	
	ITAUSA SA	505,867	9.73	4,922,085.91	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	222,703	59.57	13,266,417.71	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	26.52	1,829,880.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	69,100	7.19	496,829.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA-RCT	24,833	7.11	176,562.63	
	PORTO SEGURO SA	7,300	56.20	410,260.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,963	9.56	821,806.28	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	21.56	978,824.00	
	CIELO SA	99,269	4.90	486,418.10	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	49.32	2,579,436.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	96,100	14.71	1,413,631.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	33.16	586,932.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	31.67	1,064,112.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	102,126	10.52	1,074,365.52	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	7,900	61.06	482,374.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	52.75	1,830,425.00	
	CPFL ENERGIA SA	15,400	29.35	451,990.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	43.03	1,258,627.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	110,400	23.32	2,574,528.00	
	ブラジルリアル 小計	6,307,723		173,971,403.20 (3,321,114,087)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,220.00	278,220,600.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,703.00	231,548,395.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,556	25,196.00	265,968,976.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,734.00	193,668,358.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,292.10	178,294,294.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,564	5,425.00	122,409,700.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,782.20	27,110,826.40	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	69.70	338,926,008.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	25,761.00	140,552,016.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	32.00	200,954,272.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,378.00	57,324,800.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,216.90	96,783,928.80	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	265.00	75,851,745.00	

	COLBUN SA	1,215,680	133.50	162,293,280.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,990,008	115.00	458,850,920.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	60.49	154,931,706.22	
	チリペソ 小計	19,699,120		2,983,689,826.22 (403,991,602)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,180.00	1,065,974,220.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	25,100.00	737,337,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	25,100.00	960,777,800.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	21,000.00	437,220,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	20,340.00	1,027,393,740.00	
	コロンビアペソ 小計	627,964		4,228,703,360.00 (119,249,434)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,794	11.90	68,948.60	
	OPAP SA	17,668	7.81	137,987.08	
	JUMBO SA	14,899	15.54	231,530.46	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.68	358,511.76	
	ユーロ 小計	64,568		796,977.90 (100,156,212)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	19.89	531,063.00	
	イギリスポンド 小計	26,700		531,063.00 (73,844,310)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	85.95	997,277.85	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	8.84	1,032,114.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	17.89	1,781,235.74	
	KOC HOLDING AS	89,884	15.72	1,412,976.48	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	28,973	16.86	488,484.78	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	11.26	700,270.66	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	91.65	595,816.65	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	70.05	2,999,821.20	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	21,501	19.68	423,139.68	
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.16	1,425,816.36	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	7.28	1,747,141.76	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.10	882,361.20	
	YAPI VE KREDI BANKASI	246,063	2.18	536,417.34	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.24	942,474.72	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	15.25	2,182,137.75	
	トルコリラ 小計	1,672,655		18,147,486.37 (264,408,876)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	536.00	4,000,168.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	54.80	3,767,390.40	
	CEZ AS	18,145	461.00	8,364,845.00	
		94,356		16,132,403.40	

	チェココルナ 小計			(77,758,184)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	1,719.00	72,808,245.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,230.00	109,736,940.00
	OTP BANK NYRT	24,834	10,800.00	268,207,200.00
	ハンガリーフォリント 小計	82,367		450,752,385.00 (162,180,708)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	43.22	477,883.54
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	52.58	1,614,889.54
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	259,894	5.31	1,380,037.14
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	138.25	1,815,499.00
	LPP SA	124	7,135.00	884,740.00
	CD PROJEKT SA	6,704	415.00	2,782,160.00
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.30	665,106.60
	DINO POLSKA SA	4,430	238.00	1,054,340.00
	BANK PEKAO SA	22,583	53.72	1,213,158.76
	M BANK SA	1,663	199.70	332,101.10
	PKO BANK POLSKI SA	104,297	22.33	2,328,952.01
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	156.60	566,109.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	28.19	1,749,020.36
	ORANGE POLSKA SA	55,658	7.48	416,321.84
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	6.60	419,200.59
	ポーランドズロチ 小計	662,912		17,699,519.48 (505,321,281)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.35	1,219,200.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,739,400	3.53	9,670,082.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	392,500	12.84	5,039,700.00
	CNOOC LTD-R	1,883,000	8.99	16,928,170.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	3.71	319,060.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,382,000	2.72	6,479,040.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.24	886,080.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.08	707,200.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	124,000	59.05	7,322,200.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	4.78	485,170.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	642,000	3.24	2,080,080.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	11.76	4,845,120.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	10.86	3,127,680.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.53	790,990.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	4.63	768,580.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	8.27	1,066,830.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	557,000	1.77	985,890.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	9.09	822,645.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	5.09	3,710,610.00	

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	5.11	633,640.00
BOC AVIATION LTD	32,500	48.80	1,586,000.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	519,000	4.71	2,444,490.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	5.16	1,011,360.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	33.45	5,335,275.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	79,000	15.98	1,262,420.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	6.43	1,231,345.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.13	1,957,620.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	5.28	897,600.00
CITIC LTD	677,000	7.66	5,185,820.00
CRRG CORP LTD-H	511,050	3.63	1,855,111.50
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	9.05	2,606,400.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	20.40	1,591,200.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.45	411,600.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	12.14	461,320.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.53	252,395.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	97,500	23.55	2,296,125.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	211,800	16.58	3,511,644.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	7.36	231,221.76
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	28.55	1,778,665.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	8.15	947,030.00
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	41,500	43.00	1,784,500.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	4.92	1,894,564.08
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	51.05	6,942,800.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	9.86	1,774,800.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.21	1,114,940.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	5.42	585,360.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	308,000	2.95	908,600.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.10	1,506,477.70
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	3.80	668,800.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	474,000	4.00	1,896,000.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	241,878	4.43	1,071,519.54
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.37	1,305,720.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	64,000	7.68	491,520.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	13.16	1,683,453.52
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	5.58	491,040.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	3.92	458,640.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.48	2,752,640.00
BYD CO LTD-H	82,500	72.00	5,940,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.50	1,463,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	24.20	658,240.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	518,000	16.00	8,288,000.00

GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	8.14	2,871,385.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.31	1,844,634.64
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	82.85	9,196,350.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	2.32	450,080.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	29.45	3,416,200.00
LI NING CO LTD	217,000	31.75	6,889,750.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	76,900	108.90	8,374,410.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	17.66	794,700.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	15.52	1,086,400.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	7.77	745,920.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	68,000	43.85	2,981,800.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	22,500	33.75	759,375.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.10	1,595,000.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	48.35	1,556,870.00
TENCENT HOLDINGS LTD	603,900	506.00	305,573,400.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	1.19	706,810.02
MEITUAN DIANPING-CLASS B	369,800	231.00	85,423,800.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	14.70	1,005,480.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	9.97	1,136,580.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	47.50	3,230,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	10.56	2,735,040.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	200	88.10	17,620.00
CHINA FEIHE LTD	64,000	16.26	1,040,640.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	35.55	9,989,550.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	53.85	7,646,700.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.85	1,193,100.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.60	3,100,800.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	68.60	3,155,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.89	631,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.71	3,197,600.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	102.60	4,924,800.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	78,500	67.15	5,271,275.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	29.75	743,750.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	30,000	19.84	595,200.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	358,000	19.48	6,973,840.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	33,500	116.00	3,886,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	18.72	4,567,680.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.34	1,841,256.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	19.76	2,473,952.00
3SBIO INC	119,000	9.51	1,131,690.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	5,800	202.80	1,176,240.00

CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	9.68	968,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	597,600	15.90	9,501,840.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.48	705,600.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.70	614,200.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	15.60	1,279,200.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	64,000	33.95	2,172,800.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	94,000	54.35	5,108,900.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	4.88	397,720.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	32.55	1,806,525.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	9.40	10,462,200.00
SSY GROUP LTD	114,000	4.40	501,600.00
WUXI APPTec CO LTD-H	26,740	112.90	3,018,946.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	91,500	182.00	16,653,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,152,000	2.82	8,888,640.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,635,200	2.62	22,624,224.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.32	4,745,412.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.44	3,272,128.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,118,620	5.94	60,104,602.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	3.10	2,123,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	436,923	40.55	17,717,227.65
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	4.95	3,338,280.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.37	508,870.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,464,515	4.76	30,771,091.40
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	882,000	4.30	3,792,600.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.61	1,339,520.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	12.64	1,693,760.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.86	1,596,510.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	0.93	862,110.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	19.00	2,508,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	18.76	4,661,860.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.42	1,540,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	9.54	845,244.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	109,400	13.26	1,450,644.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	7.42	2,650,424.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	209,200	14.44	3,020,848.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	831,000	19.20	15,955,200.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	24.50	7,266,700.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	0.88	210,320.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	14.52	2,672,028.48
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	34.80	3,354,720.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.64	2,478,960.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	6.36	4,383,871.68

PING AN INSURANCE GROUP CO-H	605,500	84.60	51,225,300.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	43.45	1,985,665.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	10.08	1,431,360.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	9.91	1,248,660.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	19.62	3,649,320.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	5.20	3,005,600.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	409,040	23.45	9,591,988.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	7.91	632,800.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	347,111	34.85	12,096,818.35
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	25.95	4,629,480.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.82	1,882,320.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	897,964	10.20	9,159,232.80
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	9.46	1,278,992.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	4.00	624,000.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	15.56	2,372,900.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	14.48	2,172,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	39.10	7,702,700.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	78.70	629,600.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	7.60	1,550,400.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.59	870,240.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	33.00	4,372,500.00
SHUI ON LAND LTD	651,000	1.20	781,200.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	1.98	1,046,610.18
SOHO CHINA LTD	291,500	2.58	752,070.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	35.80	8,985,800.00
WHARF HOLDINGS	100,000	14.62	1,462,000.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.47	849,660.00
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	356,619	3.84	1,369,416.96
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	5.07	664,170.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	18.84	4,559,280.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	42.30	3,891,600.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	15.34	1,211,860.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	54.25	3,878,875.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	29.50	2,507,500.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	3.37	795,320.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.40	1,500,800.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	8.35	576,150.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	10.46	220,706.00
LENOVO GROUP LTD	732,000	5.04	3,689,280.00
SUNNY OPTICAL TECH	75,500	125.00	9,437,500.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,109,600	17.82	19,773,072.00
ZTE CORP-H	82,908	22.75	1,886,157.00

	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	654,500	58.85	38,517,325.00
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	2.74	3,715,440.00
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.44	6,575,040.00
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	618,000	6.03	3,726,540.00
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.55	1,579,725.00
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.25	1,982,500.00
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.70	2,281,400.00
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	253,600	23.30	5,908,880.00
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	431,000	5.14	2,215,340.00
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.57	1,045,620.00
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	37.60	3,233,600.00
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	9.72	1,704,888.00
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	84,700	92.50	7,834,750.00
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	13.12	4,198,400.00
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.80	1,406,000.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	6.38	2,296,800.00
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	30.65	1,379,250.00
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	310,500	26.05	8,088,525.00
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	382,445	8.83	3,376,989.35
	香港ドル 小計	95,886,402		1,216,942,244.41 (16,659,939,325)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.74	1,547,118.32
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	20.50	514,550.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	6.20	1,673,380.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	5.09	734,487.00
	GAMUDA BHD	141,520	3.30	467,016.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	8.20	313,240.00
	IJM CORP BHD	198,100	1.32	261,492.00
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.16	726,507.36
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.40	575,607.60
	MISC BHD	125,040	7.85	981,564.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.70	259,000.00
	GENTING BHD	307,200	3.80	1,167,360.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.30	850,310.00
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	13,200	23.10	304,920.00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	21,300	32.30	687,990.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.78	136,920.00
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.53	813,769.20
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	55,646	22.60	1,257,599.60
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	139.80	964,620.00
	PPB GROUP BERHAD	52,680	19.42	1,023,045.60

	QL RESOURCES BHD	83,200	9.64	802,048.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	5.07	1,252,523.22	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	17.20	2,727,920.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.37	1,231,341.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	168,300	27.14	4,567,662.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	265,600	3.01	799,456.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	517,519	3.46	1,790,615.74	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	14.54	891,185.68	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	46,033	12.60	580,015.80	
	MALAYAN BANKING BHD	404,004	7.64	3,086,590.56	
	PUBLIC BANK BERHAD	324,420	17.48	5,670,861.60	
	RHB BANK BHD	206,419	4.88	1,007,324.72	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.08	878,690.12	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.19	1,306,023.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.98	1,334,142.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	3.74	263,864.48	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.38	1,236,690.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	275,175	11.00	3,026,925.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.69	174,131.85	
	マレーシアリングット 小計	7,139,248		47,888,507.45 (1,217,325,859)	
タイバーツ	IRPC PCL - NVDR	829,500	2.48	2,057,160.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	92.00	12,364,800.00	
	PTT PCL-NVDR	1,253,200	37.25	46,681,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	42.00	5,044,200.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	24.50	5,056,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	49.00	11,021,766.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	364.00	29,484,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	53.25	22,796,325.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	9.10	7,434,700.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	10.30	8,337,850.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	19.60	7,109,664.80	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	743,535	15.30	11,376,085.50	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	37.50	6,660,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	657,100	64.00	42,054,400.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	458,200	33.25	15,235,150.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	39.00	2,574,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	449,700	13.80	6,205,860.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,083,700	19.90	21,565,630.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	112.50	3,690,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	105.50	5,475,450.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	87.75	11,091,600.00	

	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	87.75	6,870,825.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	9.75	4,276,837.50	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127,400	72.50	9,236,500.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,147,300	0.96	3,021,408.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	23.60	3,896,360.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	49.00	4,400,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	44.50	3,395,350.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	45.50	10,296,650.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.65	6,670,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	187.00	22,383,900.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	57.25	13,951,825.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	35.25	2,326,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.40	3,268,790.60	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	47.75	2,549,850.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	36,000	236.00	8,496,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	44.50	8,254,750.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	69.00	4,705,800.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	262,000	31.50	8,253,000.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	56.50	3,067,950.00	
	タイパーツ 小計	16,385,166		412,640,437.40 (1,394,724,678)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	49.60	11,801,824.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	735.00	20,785,800.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	407.00	2,791,206.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	289,060	63.50	18,355,310.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	900.00	20,524,500.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	108.10	15,620,450.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	140.20	8,553,602.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	87,300	51.90	4,530,870.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	139.00	13,282,840.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	62.50	3,740,312.50	
	BDO UNIBANK INC	219,911	91.80	20,187,829.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	36.00	5,806,332.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.26	7,679,582.00	
	AYALA LAND INC	742,900	31.85	23,661,365.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	3.08	1,965,040.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	14.96	1,391,280.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,156,150	31.00	35,840,650.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,130.00	9,989,700.00	
	PLDT INC	10,460	1,380.00	14,434,800.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	25.10	2,246,450.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	271.00	7,888,810.00	

	フィリピンペソ 小計	6,533,866		251,078,553.30 (547,351,246)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,115.00	1,604,819,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,475.00	4,716,127,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	925.00	2,666,312,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	9,500.00	2,319,900,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	11,800.00	2,242,000,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	9,550.00	3,300,480,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	5,300.00	11,409,310,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,615.00	1,462,705,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	6,225.00	4,932,067,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	54,175.00	3,228,830,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	1,750.00	1,606,325,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	10,100.00	1,626,100,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,200.00	3,089,520,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	8,200.00	6,120,480,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,605.00	4,423,219,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,051,000	31,650.00	33,264,150,000.00	
	BANK MANDIRI	1,813,696	6,100.00	11,063,545,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	5,050.00	4,091,510,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,498,800	3,560.00	19,575,728,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	5,349,700	3,000.00	16,049,100,000.00	
XL AXIATA TBK PT	387,000	2,520.00	975,240,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	1,305.00	1,032,907,500.00		
	インドネシアルピア 小計	29,924,996		140,800,378,100.00 (1,013,762,722)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	34,850.00	229,766,050.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	60,500.00	269,043,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	164,000.00	916,104,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	32,150.00	344,197,900.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	27,050.00	195,896,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	418,000.00	327,294,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,512	104,000.00	261,248,000.00	
	LG CHEM LTD	4,819	683,000.00	3,291,377,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,129	350,500.00	395,714,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	179,500.00	346,435,000.00	
	POSCO	7,998	201,000.00	1,607,598,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	90,500.00	307,609,500.00	
	CJ CORP	1,230	86,100.00	105,903,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,217	82,300.00	264,759,100.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	33,865	3,370.00	114,125,050.00	
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	27,850.00	119,977,800.00		

GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	26,200.00	177,112,000.00
HANWHA CORPORATION	2,825	25,950.00	73,308,750.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	33,900.00	313,202,100.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,348	250,500.00	337,674,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10,619	23,950.00	254,325,050.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	91,400.00	397,955,600.00
LG CORP	9,902	82,700.00	818,895,400.00
LOTTE CORP	2,370	31,250.00	74,062,500.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	14,750.00	88,323,000.00
SAMSUNG C&T CORP	8,727	120,500.00	1,051,603,500.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	11,950.00	221,266,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	5,430.00	201,729,930.00
SK HOLDINGS CO LTD	3,449	222,500.00	767,402,500.00
S-1 CORPORATION	2,394	100,000.00	239,400,000.00
CJ LOGISTICS	862	152,000.00	131,024,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,307	127,000.00	292,989,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	9,145	18,400.00	168,268,000.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	3,655.00	108,685,080.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	30,600.00	216,219,600.00
HANON SYSTEMS	19,000	13,050.00	247,950,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,916	217,000.00	1,500,772,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	15,682	164,500.00	2,579,689,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,286	83,600.00	358,309,600.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	82,300.00	247,146,900.00
KIA MOTORS CORPORATION	26,639	42,300.00	1,126,829,700.00
COWAY CO LTD	5,058	88,400.00	447,127,200.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	31,550.00	128,724,000.00
HLB INC	3,701	90,600.00	335,310,600.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	85,000.00	936,615,000.00
KANGWON LAND INC	13,208	21,950.00	289,915,600.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	17,800.00	90,246,000.00
KAKAO CORP	5,728	376,500.00	2,156,592,000.00
NAVER CORP	13,049	315,000.00	4,110,435,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	841,000.00	1,387,650,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	154,000.00	379,610,000.00
PEARL ABYSS CORP	921	192,100.00	176,924,100.00
CJ ENM CO LTD	830	126,400.00	104,912,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	73,300.00	223,638,300.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	60,300.00	73,686,600.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	78,000.00	80,652,000.00
SHINSEGAE CO LTD	881	211,500.00	186,331,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	126,500.00	69,448,500.00

EMART	1,864	125,500.00	233,932,000.00
GS RETAIL CO LTD	4,060	34,000.00	138,040,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	402,500.00	311,937,500.00
KT&G CORP	11,869	85,800.00	1,018,360,200.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,968	152,500.00	452,620,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	595,000.00	40,460,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	182,000.00	522,886,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	2,100	63,800.00	133,980,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,519,000.00	1,452,164,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	278	750,000.00	208,500,000.00
PACIFIC CORP	3,393	56,500.00	191,704,500.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,381	99,900.00	637,461,900.00
CELLTRION INC	10,296	304,000.00	3,129,984,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,242	109,700.00	136,247,400.00
HANMI PHARM CO LTD	490	296,500.00	145,285,000.00
HELIXMITH CO LTD	2,051	54,600.00	111,984,600.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,803	809,000.00	1,458,627,000.00
YUHAN CORPORATION	3,802	65,700.00	249,791,400.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,153	5,360.00	258,100,080.00
HANA FINANCIAL GROUP	32,598	29,050.00	946,971,900.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	8,390.00	237,688,700.00
KB FINANCIAL GROUP INC	40,986	38,000.00	1,557,468,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	48,174	31,400.00	1,512,663,600.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	8,760.00	520,396,560.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	60,700.00	279,341,400.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,485.00	166,945,440.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,015	9,270.00	287,509,050.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,400.00	113,805,800.00
SAMSUNG CARD CO	1,899	29,900.00	56,780,100.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	30,400.00	175,590,400.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	48,050.00	202,242,450.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	23,900.00	217,513,900.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	187,500.00	582,750,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	63,000.00	467,271,000.00
DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	101,000.00	146,551,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	166,000.00	618,350,000.00
KMW CO LTD	1,901	71,300.00	135,541,300.00
LG DISPLAY CO LTD	24,071	12,900.00	310,515,900.00
LG INNOTEK CO LTD	1,415	154,500.00	218,617,500.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	134,000.00	750,802,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	501,244	57,800.00	28,971,903,200.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	85,728	50,100.00	4,294,972,800.00

	SAMSUNG SDI CO LTD	5,738	434,500.00	2,493,161,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	11,850.00	262,181,250.00	
	SK TELECOM	2,172	231,000.00	501,732,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	30,309	20,800.00	630,427,200.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	24,800.00	112,542,400.00	
	SK HYNIX INC	57,001	75,000.00	4,275,075,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,610,639		94,148,386,740.00 (8,445,110,290)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	83.80	9,405,712.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	43.15	10,104,694.40	
	CHINA STEEL	1,266,261	20.25	25,641,785.25	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	396,061	71.20	28,199,543.20	
	FORMOSA PLASTICS CORP	413,824	80.50	33,312,832.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	548,752	62.70	34,406,750.40	
	TAIWAN CEMENT	567,511	44.35	25,169,112.85	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	662.00	7,944,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	26.30	9,153,136.40	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,874	331.50	7,251,231.00	
	CHINA AIRLINES LTD	437,203	8.02	3,506,368.06	
	EVA AIRWAYS CORP	164,159	11.10	1,822,164.90	
	EVERGREEN MARINE	359,039	15.40	5,529,200.60	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	33.20	5,876,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	38.40	6,799,142.40	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	386.00	7,695,682.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	178.00	7,733,744.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	121,000	31.05	3,757,050.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	306.00	7,791,984.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	362.50	5,800,000.00	
	POU CHEN	273,780	27.30	7,474,194.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	625.00	18,750,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	275.00	16,374,600.00	
	STANDARD FOODS CORP	35,756	63.80	2,281,232.80	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	526,395	68.40	36,005,418.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	18.50	10,764,151.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,899,237	19.40	36,845,197.80	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,156,970	27.55	31,874,523.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,034,216	21.80	22,545,908.80	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	964,097	18.80	18,125,023.60	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,173,339	29.90	35,082,836.10	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	10.90	12,610,090.10	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,229,570	13.15	16,168,845.50	
	TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	10.15	5,079,577.65	

TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,087,289	20.50	22,289,424.50
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	43.00	14,227,023.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,302	138.00	18,947,676.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,170,159	18.85	22,057,497.15
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	823,123	40.55	33,377,637.65
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	8.65	10,871,147.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	307,791	20.45	6,294,325.95
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	710,082	42.75	30,356,005.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	8.40	10,042,510.80
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	103,120	44.45	4,583,684.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	39.05	5,766,123.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	232.50	11,160,000.00
ACER INC	255,803	23.90	6,113,691.70
ADVANTECH CO LTD	43,336	312.50	13,542,500.00
ASUSTEK COMPUTER INC	76,092	253.50	19,289,322.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	10.05	9,498,154.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	196.00	13,661,200.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	90.90	5,616,892.80
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	8.27	6,409,250.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	18.60	8,030,736.00
DELTA ELECTRONICS INC	209,903	200.00	41,980,600.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	53.50	4,967,475.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,287,248	79.30	102,078,766.40
INVENTEC CO LTD	280,511	23.25	6,521,880.75
LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	3,725.00	41,124,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	48.10	10,844,241.20
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	145.50	8,730,000.00
PEGATRON CORP	200,474	66.60	13,351,568.40
QUANTA COMPUTER INC	286,270	81.50	23,331,005.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	45.70	5,854,170.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	176.00	4,752,000.00
WISTRON CORP	355,695	32.40	11,524,518.00
WIWYNN CORP	8,000	806.00	6,448,000.00
WPG HOLDINGS LTD	143,692	41.00	5,891,372.00
YAGEO CORPORATION	22,764	354.50	8,069,838.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	132.50	7,939,665.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	371,315	109.00	40,473,335.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	62.80	9,859,600.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	178,200	103.00	18,354,600.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	349,315	64.80	22,635,612.00
GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	399.00	9,576,000.00
MEDIATEK INC	160,804	609.00	97,929,636.00

	NANYA TECHNOLOGY CORP	154,000	51.80	7,977,200.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	268.50	15,585,082.50
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	278.50	3,230,321.50
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	99,770	89.10	8,889,507.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	402.50	20,504,960.00
	SILERGY CORP	7,000	1,630.00	11,410,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,582,389	427.50	1,103,971,297.50
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	23.40	28,314,000.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	89.50	7,965,500.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	281.50	9,008,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	12.40	4,327,600.00
	新台湾ドル 小計	35,342,707		2,512,438,285.11 (9,069,902,209)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	403.70	26,692,644.00
	COAL INDIA LTD	147,331	135.10	19,904,418.10
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	210.80	12,526,790.00
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	88.00	17,051,320.00
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	79.55	20,103,000.95
	PETRONET LNG LTD	83,779	255.05	21,367,833.95
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	306,633	2,131.55	653,603,571.15
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	226.95	16,688,314.35
	ASIAN PAINTS LTD	28,520	1,885.70	53,780,164.00
	BERGER PAINTS INDIA LTD	16,698	556.20	9,287,427.60
	GRASIM INDUSTRIES LTD	41,773	664.85	27,772,779.05
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	196.80	23,883,057.60
	JSW STEEL LTD	80,284	278.55	22,363,108.20
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,449.55	17,783,079.40
	SHREE CEMENT LTD	901	22,081.30	19,895,251.30
	TATA STEEL LTD	39,709	431.70	17,142,375.30
	ULTRATECH CEMENT LTD	10,743	4,199.85	45,118,988.55
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	499.40	27,069,477.60
	VEDANTA LTD	198,772	129.05	25,651,526.60
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	629.20	14,771,099.20
	LARSEN & TOUBRO LTD	49,730	1,009.10	50,182,543.00
	SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,223.80	7,252,238.80
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	356.65	22,299,897.90
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	393.30	10,404,751.50
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,215.25	10,159,490.00
	BAJAJ AUTO LTD	8,362	3,059.80	25,586,047.60
	BHARAT FORGE LTD	30,322	490.05	14,859,296.10
	BOSCH LTD	965	13,615.90	13,139,343.50
	EICHER MOTORS LTD	1,254	21,261.35	26,661,732.90

HERO MOTOCORP LTD	10,359	2,933.05	30,383,464.95
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	623.90	47,209,889.10
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,151	6,990.30	84,939,135.30
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	125.05	9,608,466.85
TATA MOTORS LTD	190,082	125.15	23,788,762.30
PAGE INDUSTRIES LTD	601	18,920.35	11,371,130.35
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	1,148.40	37,770,876.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,132	1,941.90	9,965,830.80
INFO EDGE INDIA LTD	6,428	3,294.00	21,173,832.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	196.80	15,640,286.40
AVENUE SUPERMARTS LTD	14,325	2,266.60	32,469,045.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	3,875.40	19,795,543.20
ITC LTD	388,437	198.45	77,085,322.65
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	16,345.75	39,148,071.25
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	28,688	548.20	15,726,761.60
UNITED SPIRITS LTD	32,483	591.05	19,199,077.15
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	5,255	1,420.80	7,466,304.00
DABUR INDIA LTD	58,111	494.20	28,718,456.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	690.65	26,565,161.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	87,189	2,193.60	191,257,790.40
MARICO LTD	42,465	373.50	15,860,677.50
AUROBINDO PHARMA LTD	28,844	864.35	24,931,311.40
BIOCON LTD	17,686	396.35	7,009,846.10
CIPLA LTD	37,891	758.35	28,734,639.85
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	3,159.60	28,619,656.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,489.25	56,762,077.00
LUPIN LTD	26,552	980.95	26,046,184.40
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,436.30	16,836,308.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	525.40	43,581,930.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,552	2,794.60	9,926,419.20
AXIS BANK LTD	228,324	444.20	101,421,520.80
BANDHAN BANK LTD	36,073	289.65	10,448,544.45
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	177,443	1,827.95	324,356,931.85
ICICI BANK LTD	515,616	374.45	193,072,411.20
LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	277.50	7,761,952.50
STATE BANK OF INDIA	187,504	197.05	36,947,663.20
BAJAJ FINANCE LTD	18,080	3,409.95	61,651,896.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,430.80	9,954,126.00
REC LTD	48,168	113.60	5,471,884.80
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	688.95	14,616,763.20
BAJAJ FINSERV LTD	3,888	6,299.05	24,490,706.40
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	62,014	603.45	37,422,348.30

	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	17,954	1,310.65	23,531,410.10	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	454.55	14,423,780.60	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	32,481	863.65	28,052,215.65	
	DLF LTD	56,420	157.55	8,888,971.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	122,073	709.85	86,653,519.05	
	INFOSYS LTD	365,523	959.30	350,646,213.90	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	96,664	2,256.60	218,131,982.40	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	726.70	34,921,568.50	
	WIPRO LTD	118,712	279.75	33,209,682.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	263,301	535.85	141,089,840.85	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	201.30	7,207,345.20	
	GAIL INDIA LTD	174,768	101.45	17,730,213.60	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	13,220	395.00	5,221,900.00	
	NTPC LTD	260,019	94.65	24,610,798.35	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	177.35	35,712,082.75	
	インドルピー 小計	6,597,824		4,138,242,098.80 (5,917,686,201)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	118.19	8,627,870.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	122.36	8,136,940.00	
	MCB BANK LTD	53,300	177.43	9,457,019.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		26,221,829.00 (16,519,752)	
カタールリアル ピー	QATAR FUEL QSC	57,358	18.00	1,032,444.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.15	958,434.07	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	8.94	1,759,284.72	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.20	856,758.00	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.20	1,709,500.70	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	8.56	844,157.83	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	16.27	1,858,522.10	
	QATAR NATIONAL BANK	470,710	18.55	8,731,670.50	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.36	698,203.85	
	OOREDOO QSC	72,800	6.69	487,032.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	17.45	1,089,246.45	
	カタールリアル 小計	2,334,811		20,025,254.22 (581,132,877)	
南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	34,900	142.43	4,970,807.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	7,385	1,315.94	9,718,216.90	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,716	492.31	22,014,133.96	
	GOLD FIELDS LTD	89,344	215.40	19,244,697.60	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	77,953	167.31	13,042,316.43	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	549.36	2,951,161.92	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	156.81	5,323,699.50	

	SASOL LTD	57,207	129.00	7,379,703.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	218,901	51.68	11,312,803.68	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	147.64	4,089,923.28	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	104.83	4,248,655.07	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	131.32	3,743,933.20	
	NASPERS LTD-N SHS	46,871	2,951.78	138,352,880.38	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	83,044	10.70	888,570.80	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	34.00	3,756,830.00	
	BID CORP LTD	33,071	272.14	8,999,941.94	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	245.37	6,605,605.77	
	PICK N PAY STORES LTD	45,989	44.07	2,026,735.23	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	58,453	119.64	6,993,316.92	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	172.48	4,014,299.52	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	176.13	2,293,740.99	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	17.18	2,689,408.74	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	132.65	4,940,416.60	
	ABSA GROUP LTD	73,296	78.85	5,779,389.60	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,385	870.00	3,814,950.00	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	105.24	4,003,013.88	
	STANDARD BANK GROUP LTD	142,629	109.70	15,646,401.30	
	FIRSTRAND LTD	525,813	38.50	20,243,800.50	
	PSG GROUP LTD	18,494	161.00	2,977,534.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	308.50	5,302,189.50	
	REMGRO LTD	55,441	93.26	5,170,427.66	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	121.95	4,267,762.20	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	16.35	1,113,075.30	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	12.80	6,267,033.60	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	32.56	3,297,286.08	
	SANLAM LTD	221,098	60.33	13,338,842.34	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	32,121	85.34	2,741,206.14	
	MTN GROUP LTD	173,000	67.44	11,667,120.00	
	VODACOM GROUP	62,331	137.23	8,553,683.13	
	南アフリカランド 小計	3,359,183		403,785,513.66 (2,483,280,909)	
アラブ首長国連 邦ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	5.40	1,455,246.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	4.11	528,496.68	
	EMIRATES NBD PJSC	112,010	10.70	1,198,507.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	11.32	3,206,525.84	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	509,421	2.00	1,018,842.00	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.43	256,889.49	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	2.93	1,128,167.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	200,413	16.98	3,403,012.74	

	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	2,067,867		12,195,686.95 (352,821,223)	
香港・オフショア 人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	6.58	598,122.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	8.01	306,783.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	6.53	573,334.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	9.42	576,504.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	3.31	543,833.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	60.65	1,785,536.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.03	194,661.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	22,500	56.30	1,266,750.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	13.86	740,124.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	19.55	725,305.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.19	548,590.00	
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	12.52	482,896.40	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.49	265,441.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.24	493,024.00	
	SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	69,000	7.13	491,970.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	30.28	219,590.56	
	SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	23,600	37.90	894,440.00	
	TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	18.90	77,490.00	
	TIANQI LITHIUM CORP-A	31,500	25.71	809,865.00	
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	43,200	16.79	725,328.00	
	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.20	571,640.00	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	67.66	1,184,050.00	
	WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	83.49	769,777.80	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	75.78	788,112.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15,600	42.30	659,880.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	15.01	354,236.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	11.15	379,100.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	47.90	546,060.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	27.00	459,000.00	
	BEIJING NEW BUILDING MATER-A	25,000	33.05	826,250.00	
	CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	6.80	656,880.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	63,200	9.08	573,856.00	
	CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	110,200	5.19	571,938.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	16,100	45.38	730,618.00		
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.23	1,103,007.00		
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	190.19	2,548,546.00		
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	2.19	820,374.00		
CRRC CORP LTD-A	79,000	5.96	470,840.00		
EVE ENERGY CO LTD-A	24,521	50.09	1,228,256.89		
GUOCHENG MINING CO LTD-A	31,100	22.57	701,927.00		

HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	56.66	770,576.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	18,056	63.22	1,141,500.32
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	22.65	1,100,790.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.28	698,496.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	21.26	890,794.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	56.42	1,150,968.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,400	24.34	910,316.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	11.95	270,070.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	15.72	679,104.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.57	232,684.27
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	31.62	999,192.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	105.40	870,604.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	21.64	1,021,191.60
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	14.91	660,513.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	9.13	735,878.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	37,300	25.10	936,230.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	65.70	722,700.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.35	190,365.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.89	195,600.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.65	813,295.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	15.46	479,260.00
S F HOLDING CO LTD-A	13,700	70.71	968,727.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	78.52	417,647.88
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.53	201,132.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	44.70	371,010.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	23.30	508,872.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	104,734	7.30	764,558.20
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	28.56	1,065,288.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	24.98	856,814.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	23.59	691,187.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	18.41	784,266.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	55.19	1,021,015.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	17.93	595,276.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	105.60	813,120.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	23.28	605,280.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	30,100	24.27	730,527.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.38	585,234.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	16.86	564,472.80
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	14.64	784,704.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	14.64	248,880.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.48	903,312.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	1,800	552.00	993,600.00

MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	61.03	994,789.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	20.21	333,465.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	10.16	836,777.60
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	35.25	803,700.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	41.70	1,021,650.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	22,800	20.80	474,240.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	14,800	200.00	2,960,000.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	26.46	449,820.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	10.24	468,992.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,800	91.80	716,040.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	9.00	364,500.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	18,700	68.12	1,273,844.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	4,800	235.03	1,128,144.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	50.98	112,156.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	12.49	743,155.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	65.65	676,195.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	67.98	679,800.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	21,100	42.92	905,612.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	14,160	163.83	2,319,832.80
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	27.63	757,062.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	68.10	1,157,700.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	32,400	57.96	1,877,904.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	34.99	1,200,226.98
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	47.18	816,214.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	130.59	1,188,369.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	74.37	855,255.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,687.00	12,821,200.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	127.87	1,253,126.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	23,970	89.60	2,147,712.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	35.06	939,608.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	171.43	1,148,581.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	22.54	712,264.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	24.26	925,761.60
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	222.20	4,710,640.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	23.53	124,709.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	24.40	724,680.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,914	44.50	797,173.00
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	151.97	759,850.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	92.40	262,231.20
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	26.79	260,398.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	67.08	828,438.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	17.67	183,768.00

LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	38.05	563,140.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	15.90	394,956.00
OVCTEK CHINA INC-A	13,950	57.35	800,032.50
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	309.00	1,637,700.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	4,700	196.00	921,200.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	20.43	772,866.90
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	3,800	234.25	890,150.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	44.61	1,043,874.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	7,400	126.34	934,916.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	141.12	776,160.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	448.70	987,140.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	43.13	659,889.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	29.30	298,860.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	135.60	1,342,440.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	40.18	891,714.74
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	34.29	548,640.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	99.31	794,480.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	57.08	1,075,958.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	26,926	24.65	663,725.90
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	31,752	92.73	2,944,362.96
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	16,380	51.10	837,018.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	9.30	596,130.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	199.13	1,354,084.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	33.26	232,820.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	24.58	276,082.56
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	103,300	5.36	553,688.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	13.86	270,270.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	67.49	1,147,330.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	8,820	106.28	937,389.60
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	28.02	731,322.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	102.97	731,087.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	203.39	793,221.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	38.68	348,893.60
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	30.15	729,630.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	59.34	575,598.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.25	1,149,200.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.95	287,100.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.79	473,731.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	6.46	373,388.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	8.83	445,915.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	35.07	841,680.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.47	385,385.00

CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.27	783,123.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.95	509,155.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	38.35	4,022,915.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.63	1,540,368.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.53	779,682.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.03	1,313,836.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	16.04	1,527,008.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	15.10	1,802,940.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.58	1,463,214.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	5.28	646,800.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	8.74	173,926.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	73,060	22.50	1,643,850.00
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	32.69	1,412,208.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	55.85	1,345,985.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	102,600	25.16	2,581,416.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	22.28	2,268,104.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	9.01	746,028.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	15.87	961,722.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	140.89	760,806.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	8.92	387,128.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	8.49	746,271.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	12.30	389,910.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	45,800	15.22	697,076.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.85	1,212,120.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	31.93	581,126.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	78.17	5,221,756.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	18.01	327,782.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	17.06	933,182.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	27.44	1,473,528.00
GEMDALE CORP-A	45,500	15.16	689,780.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	8.29	974,904.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	10.12	712,043.20
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.72	1,367,696.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	35.44	453,632.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	21.65	184,025.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	18.90	508,410.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	32.22	434,970.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	25.07	722,016.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	104.66	701,222.00
GLODON CO LTD-A	15,400	65.89	1,014,706.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	101.44	923,104.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	37.85	408,780.00

SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	207.43	622,290.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	4,700	66.69	313,443.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	38,870	43.92	1,707,170.40
ADDSINO CO LTD -A	34,700	20.80	721,760.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	45.96	615,864.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	5.13	587,898.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	27.37	766,360.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	18.83	655,284.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	5,640	44.19	249,231.60
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	27.60	574,080.00
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	15,400	31.26	481,404.00
GOERTEK INC -A	26,900	37.81	1,017,089.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	11.18	559,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	98.08	686,560.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	58,500	38.14	2,231,190.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	36.00	709,632.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	38,500	30.70	1,181,950.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	59,450	50.29	2,989,740.50
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	207.80	644,180.00
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	19.08	597,204.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	27.03	656,829.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	141.90	675,444.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	26.08	612,880.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	56.39	755,626.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	26.90	766,650.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	16.87	792,890.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	13,100	44.15	578,365.00
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	23.00	64,400.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	132.87	558,054.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	21,080	36.90	777,852.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	61.21	688,612.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	23.73	719,019.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	58.35	507,645.00
ZTE CORP-A	12,600	38.65	486,990.00
CHINA UNITED NETWORK-A	166,400	5.39	896,896.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.62	802,956.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	18.53	2,483,020.00
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.99	1,190,217.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	9.49	641,524.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.93	889,500.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	5.44	448,800.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,480	206.85	926,688.00

	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	35,600	17.57	625,492.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	53.54	872,702.00
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	27.22	1,105,132.00
	SG MICRO CORP-A	1,400	310.00	434,000.00
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	203.90	530,140.00
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	26.00	584,116.00
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	11,700	136.00	1,591,200.00
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	43,600	15.15	660,540.00
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,900	187.30	543,170.00
	香港・オフショア人民元 小計	11,899,288		234,064,671.66 (3,588,211,416)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	13.38	315,219.42
	SAUDI ARABIAN OIL CO	129,846	34.15	4,434,240.90
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	56.90	557,847.60
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	11.34	362,063.52
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	15.52	501,032.16
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	19,671	86.50	1,701,541.50
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	40.25	1,810,606.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	91,783	88.10	8,086,082.30
	SAUDI CEMENT	7,489	55.70	417,137.30
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	20.90	440,133.10
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	8.59	567,919.26
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	55.10	1,463,235.60
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	81.20	359,878.40
	JARIR MARKETING CO	7,199	166.40	1,197,913.60
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	118.40	441,040.00
	ALMARAI CO	30,130	54.80	1,651,124.00
	SAVOLA	25,336	48.00	1,216,128.00
	AL RAJHI BANK	135,049	64.70	8,737,670.30
	ALINMA BANK	109,956	15.40	1,693,322.40
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	21.02	1,211,550.76
	BANK AL-JAZIRA	35,813	12.78	457,690.14
	BANK ALBILAD	45,859	24.68	1,131,800.12
	BANQUE SAUDI FRANSI	57,797	33.65	1,944,869.05
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	148,866	38.75	5,768,557.50
	RIYAD BANK	138,943	19.28	2,678,821.04
	SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	27.50	2,796,282.50
	SAUDI BRITISH BANK	71,793	25.50	1,830,721.50
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	124.20	753,024.60
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	82.30	544,249.90
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	7.87	370,614.04
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	7.66	353,792.42

	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	27.25	937,781.50	
	SAUDI TELECOM CO	60,811	96.40	5,862,180.40	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	15.74	1,451,558.54	
	サウジアラビアリアル 小計	1,772,696		64,047,629.37	(1,815,109,816)
	合 計	261,609,918		70,939,242,437	(70,939,242,437)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	5,613,408.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	5,613,408.00	(26,832,090)
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	2,130,552.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	58,600	1,699,400.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	724,020.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,664,742.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	26,962	1,251,306.42	
ブラジルリアル 小計	192,062	7,470,020.42	(142,602,689)		
投資信託受益証券合計			250,462	169,434,779	(169,434,779)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	5,538,864.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	5,538,864.00	(26,475,769)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	3,838,561.47	
		南アフリカランド 小計	295,047	3,838,561.47	(23,607,153)
投資証券合計			603,447	50,082,922	(50,082,922)
合計				219,517,701	(219,517,701)

(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 55銘柄	100.0%			16.4%
メキシコペソ	株式 22銘柄	95.6%			1.6%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.2%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.2%	0.0%
ブラジルリアル	株式 53銘柄	95.9%			4.7%
	投資信託受 益証券 5銘柄		4.1%		0.2%
チリペソ	株式 16銘柄	100.0%			0.6%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 4銘柄	100.0%			0.1%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%			0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%			0.7%
香港ドル	株式 207銘柄	100.0%			23.4%
マレーシアリングギット	株式 39銘柄	100.0%			1.7%
タイバーツ	株式 40銘柄	100.0%			2.0%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%			0.8%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%			1.4%
韓国ウォン	株式 106銘柄	100.0%			11.9%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			12.7%
インドルピー	株式 86銘柄	100.0%			8.3%
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%			0.8%
南アフリカランド	株式 39銘柄	99.1%			3.5%
	投資証券 1銘柄			0.9%	0.0%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 8銘柄	100.0%			0.5%
香港・オフショア人 民元	株式 259銘柄	100.0%			5.0%
サウジアラビアリアル	株式 34銘柄	100.0%			2.6%

(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。

新興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 8月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	807,817,034
コール・ローン	576,223,965
国債証券	56,926,884,123
未収利息	666,456,755
前払費用	86,834,910
流動資産合計	59,064,216,787
資産合計	59,064,216,787
負債の部	
流動負債	
未払解約金	17,118,173
未払利息	978
流動負債合計	17,119,151
負債合計	17,119,151
純資産の部	
元本等	
元本	35,819,777,048
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	23,227,320,588
元本等合計	59,047,097,636
純資産合計	59,047,097,636
負債純資産合計	59,064,216,787

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8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>

2020年 8月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,819,777,048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 1.6484円 (1万口当たり純資産額) (16,484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 8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。

	2020年 8月20日現在

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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つた場合、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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	29,692,604,998円

区分	2020年 8月20日現在
期中追加設定元本額	8,655,607,350円
期中一部解約元本額	2,528,435,300円
期末元本額	35,819,777,048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	4,222,573,701円
世界経済インデックスファンド	6,231,331,787円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,613,665,766円
DC世界経済インデックスファンド	7,947,364,469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)	1,819,003,108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)	87,314,679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)	291,047,052円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,697,465,217円
コア投資戦略ファンド(切替型)	86,647,214円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	188,698,913円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	87,631,659円
SMT インデックスバランス・オープン	159,454,575円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	3,310,673,508円
SMT 世界経済インデックス・オープン	145,749,901円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	154,122,233円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	257,596,992円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,656,622円
グローバル経済コア	699,960,184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	297,780円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	380,574円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	124,508円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	149,145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)	90,502,984円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	91,888,137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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

2020年 8月20日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	821,385,744
合計	821,385,744

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	42,021,826.00		
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	98,303,143.75		
		MBONO 5.75% 03/05/26	61,800,000.00	63,447,897.00		
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	111,889,079.00		
		MBONO 6.75% 03/09/23	47,450,000.00	49,824,872.50		
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	85,295,948.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	121,155,071.75		
		MBONO 7.75% 05/29/31	56,200,000.00	64,358,835.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	68,449,807.50		
		MBONO 7.75% 11/23/34	29,200,000.00	33,504,080.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	98,800,000.00	117,698,958.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	57,450,000.00	69,153,139.50		
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	82,349,356.50		
		MBONO 8% 11/07/47	68,850,000.00	78,363,348.75		
		MBONO 8% 12/07/23	111,400,000.00	122,353,405.00		
		メキシコペソ 小計		1,078,850,000.00	1,208,168,768.25 (5,775,046,712)	
		ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	27,493,203.89	
			BLTN 0% 01/01/24	34,850,000.00	29,448,284.85	
			BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00	25,870,262.72	
BLTN 0% 07/01/23			53,750,000.00	47,299,365.75		

	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000.00	42,614,238.91	
	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000.00	40,873,327.13	
	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000.00	27,991,682.51	
	BNTNF 10% 01/01/29	13,200,000.00	15,649,464.74	
	BNTNF 10% 01/01/31	3,200,000.00	3,820,667.23	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,699,250.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	509,062.50	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,148,187.50	
ブラジルレアル 小計		261,800,000.00	265,416,997.73	(5,066,810,486)
チリペソ	BTPCL 2.5% 03/01/25	1,890,000,000.00	1,988,372,946.42	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,855,000,000.00	2,150,120,336.45	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,370,000,000.00	1,640,344,915.34	
	BTPCL 4% 03/01/23	945,000,000.00	1,032,403,697.32	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,110,000,000.00	2,656,423,231.16	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,650,000,000.00	2,427,860,856.30	
チリペソ 小計		9,820,000,000.00	11,895,525,982.99	(1,610,654,218)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	4,600,000,000.00	4,661,364,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	91,200,000,000.00	117,150,960,000.00	
コロンビアペソ 小計		95,800,000,000.00	121,812,324,000.00	(3,435,107,536)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,975,576.25	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,400,000.00	5,806,971.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,650,000.00	4,274,770.50	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,433,282.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	8,204,070.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,200,000.00	9,929,831.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	9,074,925.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,200,000.00	7,755,146.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,417,941.50	
ペルーヌエボソル 小計		54,700,000.00	64,872,513.25	(1,931,254,719)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	15,772,146.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,871,714.50	
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	33,643,860.50	(83,436,774)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,347,776.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	25,036,875.00	
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	45,384,651.00	(82,600,064)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,586,600.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	7,482,250.00	

	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	8,819,362.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	8,150,000.00	7,751,709.50	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,150,000.00	8,061,150.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	6,550,000.00	6,363,030.25	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,666,657.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	4,890,600.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,360,000.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,301,279.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	5,951,367.50	
	TURKGB 8% 03/12/25	7,100,000.00	5,772,300.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,600,000.00	10,225,979.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,862,075.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,277,267.50	
	トルコリラ 小計	107,950,000.00	99,371,627.25 (1,447,844,609)	
チェココ ルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	46,892,986.50	
	CZGB 0.45% 10/25/23	50,000,000.00	50,123,250.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	41,600,000.00	41,630,160.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	30,900,000.00	31,623,832.50	
	CZGB 1% 06/26/26	75,100,000.00	76,304,979.50	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	56,013,202.50	
	CZGB 2.5% 08/25/28	55,000,000.00	61,763,625.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	56,462,049.50	
	CZGB 2% 10/13/33	52,350,000.00	58,476,258.75	
	CZGB 3.85% 09/29/21	48,000,000.00	50,003,520.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	44,400,000.00	48,637,536.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	45,320,112.50	
		チェココルナ 小計	583,950,000.00	623,251,512.75 (3,004,072,291)
ハンガリー フォリント	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	566,774,325.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	575,271,220.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	265,000,000.00	271,352,050.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	570,500,000.00	606,612,650.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	232,000,000.00	252,846,360.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	429,318,575.00	
	HGB 3% 08/21/30	502,000,000.00	534,823,270.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	638,110,880.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	786,000,600.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	612,473,985.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	450,452,620.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	312,904,200.00	
	ハンガリーフォリント 小計	5,470,000,000.00	6,036,940,735.00	

			(2,172,091,276)	
ポーランド ズロチ	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,430,200.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	8,850,000.00	9,467,110.50	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	21,013,803.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000.00	16,066,690.25	
	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000.00	17,924,002.25	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,950,000.00	16,345,507.75	
	POLGB 2.75% 04/25/28	12,950,000.00	14,411,601.75	
	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000.00	16,959,544.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,839,072.50	
	POLGB 4% 10/25/23	14,050,000.00	15,674,109.75	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,112,723.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,100,000.00	7,579,534.00	
	ポーランドズロチ 小計		160,350,000.00	174,823,898.75
ロシアルー ブル	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	171,938,389.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	168,906,740.00	
	RFLB 6% 10/06/27	173,000,000.00	176,639,055.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	191,875,965.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	176,915,389.50	
	RFLB 7.15% 11/12/25	172,400,000.00	187,469,484.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	175,837,380.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	168,200,000.00	182,859,471.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	175,275,113.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	198,700,000.00	210,096,438.50	
	RFLB 7.65% 04/10/30	196,500,000.00	219,921,817.50	
	RFLB 7.7% 03/16/39	126,500,000.00	146,074,610.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	179,067,720.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	202,416,310.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	205,195,175.00	
	RFLB 7% 01/25/23	53,200,000.00	56,058,170.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	114,017,384.00	
	RFLB 7% 12/15/21	132,500,000.00	136,895,025.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	178,716,720.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	132,150,000.00	157,933,786.50	
ロシアルーブル 小計		3,123,650,000.00	3,414,110,143.00	(4,950,459,707)
マレーシア リングギット	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,425,679.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	10,750,000.00	11,193,813.75	
	MGS 3.502% 05/31/27	8,200,000.00	8,862,150.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	10,700,000.00	10,952,627.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,594,855.75	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,089,541.50	

	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	9,126,139.25
	MGS 3.828% 07/05/34	11,500,000.00	12,697,955.00
	MGS 3.885% 08/15/29	15,650,000.00	17,401,078.50
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,948,415.00
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,820,988.75
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	9,186,660.00
	MGS 3.955% 09/15/25	9,400,000.00	10,259,160.00
	MGS 4.059% 09/30/24	16,500,000.00	17,812,492.50
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	10,214,835.75
	MGS 4.762% 04/07/37	6,700,000.00	7,978,159.00
	マレーシアリングット 小計	154,400,000.00	167,564,551.25 (4,259,490,892)
タイバーツ	THAIGB 1.45% 12/17/24	75,500,000.00	77,691,765.00
	THAIGB 1.6% 06/17/35	37,400,000.00	37,567,926.00
	THAIGB 1.6% 12/17/29	52,700,000.00	54,137,656.00
	THAIGB 1.875% 06/17/22	75,300,000.00	77,239,351.50
	THAIGB 2.125% 12/17/26	88,100,000.00	94,268,321.50
	THAIGB 2.4% 12/17/23	101,000,000.00	106,903,450.00
	THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	73,876,821.00
	THAIGB 2% 12/17/22	84,500,000.00	87,419,475.00
	THAIGB 3.3% 06/17/38	136,400,000.00	166,519,848.00
	THAIGB 3.4% 06/17/36	133,500,000.00	165,271,665.00
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	91,222,740.00
	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	139,751,181.00
	THAIGB 3.65% 12/17/21	63,100,000.00	65,801,311.00
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	100,271,664.00
	THAIGB 3.85% 12/12/25	82,400,000.00	95,106,904.00
THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000.00	131,530,503.00	
	タイバーツ 小計	1,375,400,000.00	1,564,580,582.00 (5,288,282,367)
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,330,825.00
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	38,869,800.00
	フィリピンペソ 小計	45,000,000.00	54,200,625.00 (118,157,362)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,215,775,500.00
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,816,893,000.00
	INDOGB 5.625% 05/15/23	35,900,000,000.00	36,836,092,500.00
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	34,905,420,000.00
	INDOGB 6.5% 06/15/25	44,100,000,000.00	45,708,547,500.00
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	23,242,080,000.00
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	19,580,718,500.00
	INDOGB 7.5% 06/15/35	20,200,000,000.00	20,738,330,000.00
	INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	25,642,625,000.00

	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,649,407,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	38,182,208,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	32,200,000,000.00	32,937,380,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	39,119,950,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	38,000,000,000.00	41,962,070,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	36,071,468,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	30,400,000,000.00	32,998,136,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000.00	80,104,662,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	57,202,080,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,234,140,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	36,300,000,000.00	40,764,900,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	37,041,579,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,445,673,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	33,700,000,000.00	38,513,202,500.00	
	インドネシアルピア 小計	730,000,000,000.00	784,913,337,500.00 (5,651,376,030)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	115,000,000.00	132,355,225.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	22,917,962.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,900,000.00	29,653,463.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	52,000,000.00	56,041,440.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	34,347,269.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	43,659,712.50	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	54,938,359.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	53,117,570.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	69,100,340.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	52,674,832.50	
	SAGB 8% 01/31/30	89,900,000.00	82,798,349.50	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	28,499,275.00	
		南アフリカランド 小計	753,450,000.00	660,103,798.00 (4,059,638,357)
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	14,000,000.00	13,481,860.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	7,300,000.00	7,228,825.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	10,000,000.00	9,742,500.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000.00	43,224,030.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	11,000,000.00	11,082,940.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	10,000,000.00	10,053,100.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	6,000,000.00	6,090,600.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,202,860.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000.00	35,621,600.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	20,200,000.00	20,478,255.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,444,990.00	
	香港・オフショア人民元 小計	194,500,000.00	195,651,560.00	

		(2,999,338,414)	
	合計	56,926,884,123	
		(56,926,884,123)	

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 15銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	8.9%
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 2銘柄	100.0%	6.0%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	3.4%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	2.5%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	5.3%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	3.8%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	8.8%
ロシアルーブル	国債証券 20銘柄	100.0%	8.7%
マレーシアリンギット	国債証券 16銘柄	100.0%	7.5%
タイバーツ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.3%
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 23銘柄	100.0%	9.9%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	7.1%
香港・オフショア人民元	国債証券 11銘柄	100.0%	5.3%

(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。

J - REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,211,453,004
投資証券	111,841,523,520
未収入金	59,876,157
未収配当金	821,120,081
前払金	93,970,400
差入委託証拠金	960,638,000
流動資産合計	115,988,581,162
資産合計	115,988,581,162
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	93,970,400
未払金	30,219,565
未払解約金	94,408,712
未払利息	3,757
流動負債合計	218,602,434
負債合計	218,602,434
純資産の部	
元本等	
元本	67,393,999,603
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	48,375,979,125
元本等合計	115,769,978,728
純資産合計	115,769,978,728
負債純資産合計	115,988,581,162

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

	2020年 8月20日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	67,393,999,603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 1.7178円 (1万口当たり純資産額) (17,178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 8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不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	57,883,572,656円

区分	2020年 8月20日現在
期中追加設定元本額	18,652,278,216円
期中一部解約元本額	9,141,851,269円
期末元本額	67,393,999,603円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	1,629,821,478円
S B I 資産設計オープン(分配型)	5,307,128円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,519,911,248円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	30,857,657,393円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,260,170,305円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,024,464,783円
分散投資コア戦略ファンドA	3,015,585,050円
分散投資コア戦略ファンドS	6,092,076,647円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,107,909,967円
S M T インデックスバランス・オープン	30,532,539円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	427,055,025円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,555,636円
グローバル経済コア	276,096,707円
S B I 資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,778,962円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	489,812,542円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	44,809,289円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	955,694,186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)	4,523,876円
J - R E I T パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	313,002円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	928,281,475円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-11(適格機関投資家専用)	393,071,203円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019-03(適格機関投資家専用)	319,571,162円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	23,447,155,595
合計	23,447,155,595

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

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2020年 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	4,012,117,400	-	3,918,147,000	93,970,400
合計		4,012,117,400	-	3,918,147,000	93,970,400

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,065	212,695,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,092	284,154,800	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,815	408,175,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,198	2,774,878,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	15,460	1,120,850,000	
	森ヒルズリート投資法人	14,537	1,888,356,300	
	産業ファンド投資法人	17,859	3,293,199,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	12,001	3,780,315,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,243	1,577,710,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,331	2,450,097,000	
	G L P 投資法人	36,330	6,295,989,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,513	1,819,290,000	
	日本プロロジスリート投資法人	19,118	6,758,213,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,922	884,120,000	
	O n e リート投資法人	1,969	486,933,700	
	イオンリート投資法人	12,815	1,435,280,000	
	ヒューリックリート投資法人	10,172	1,354,910,400	
	日本リート投資法人	4,104	1,461,024,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	81,173	1,099,894,150	

積水ハウス・リート投資法人	37,162	2,616,204,800	
トーセイ・リート投資法人	2,795	295,431,500	
ケネディクス商業リート投資法人	4,646	971,943,200	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,695	313,967,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,432	235,904,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	40,858	5,503,572,600	
いちごホテルリート投資法人	2,209	134,528,100	
ラサールロジポート投資法人	11,811	2,186,216,100	
スターアジア不動産投資法人	12,982	540,700,300	
マリモ地方創生リート投資法人	1,184	120,294,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,620	1,991,000,000	
大江戸温泉リート投資法人	2,039	123,767,300	
投資法人みらい	13,646	478,974,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,736	260,467,200	
三菱地所物流リート投資法人	2,510	1,147,070,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	3,448	540,301,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,936	165,528,000	
タカラレーベン不動産投資法人	3,797	329,199,900	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,990	614,460,000	
日本ビルファンド投資法人	12,235	7,438,880,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,635	6,961,885,000	
日本リテールファンド投資法人	23,880	3,512,748,000	
オリックス不動産投資法人	25,175	3,788,837,500	
日本プライムリアルティ投資法人	7,866	2,307,097,800	
プレミア投資法人	11,412	1,360,310,400	
東急リアル・エステート投資法人	8,471	1,114,783,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,774	849,323,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	27,021	3,026,352,000	
森トラスト総合リート投資法人	9,030	1,149,519,000	
インヴィンシブル投資法人	52,831	1,329,756,270	
フロンティア不動産投資法人	4,193	1,413,041,000	
平和不動産リート投資法人	7,868	905,606,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,255	2,307,272,500	
福岡リート投資法人	6,535	843,668,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,909	2,314,128,000	
いちごオフィスリート投資法人	10,482	754,704,000	
大和証券オフィス投資法人	2,692	1,572,128,000	
阪急阪神リート投資法人	5,707	664,865,500	
スターツプロシード投資法人	1,968	393,600,000	
大和ハウスリート投資法人	18,027	5,078,205,900	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,702	1,768,501,900	
大和証券リビング投資法人	15,940	1,640,226,000	

ジャパンエクセレント投資法人	11,724	1,390,466,400	
合計	753,545	111,841,523,520	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	341,800,882
コール・ローン	43,717,861
投資証券	92,957,614,323
派生商品評価勘定	72
未収入金	5,249,144
未収配当金	235,821,606
流動資産合計	93,584,203,888
資産合計	93,584,203,888
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,017
未払金	300,460,228
未払解約金	30,208,435
未払利息	74
流動負債合計	330,677,754
負債合計	330,677,754
純資産の部	
元本等	
元本	58,071,297,346
剰余金	
剰余金又は欠損金()	35,182,228,788
元本等合計	93,253,526,134
純資産合計	93,253,526,134
負債純資産合計	93,584,203,888

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2020年 8月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	58,071,297,346口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.6058円
の額	(1万口当たり純資産額) (16,058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 8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 8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 8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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	40,660,606,854円
期中追加設定元本額	23,262,290,141円
期中一部解約元本額	5,851,599,649円
期末元本額	58,071,297,346円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	96,683,160円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	142,414,037円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,657,148,734円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,494,831円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,998,938,573円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	28,016,130,275円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,438,322,562円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,051,476,108円
分散投資コア戦略ファンドA	2,049,375,041円
分散投資コア戦略ファンドS	5,991,685,818円

区分	2020年 8月20日現在
コア投資戦略ファンド(切替型)	971,406,530円
SMT インデックスバランス・オープン	183,291,744円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	461,760,605円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,897,134円
グローバル経済コア	282,338,708円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	8,026,115円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	321,460,040円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	47,989,078円
グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,165,621,060円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	802,145,843円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	46,280,177円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	158,797,646円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	170,613,527円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		15,748,949,454
合計		15,748,949,454

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2020年 8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	220,413,795	-	220,404,850	8,945
	アメリカドル	183,523,071	-	183,518,400	4,671
	カナダドル	3,611,596	-	3,611,250	346
	イギリスポンド	19,465,600	-	19,465,600	-
	香港ドル	6,844,000	-	6,840,000	4,000
	シンガポールドル	6,969,528	-	6,969,600	72
合計		220,413,795	-	220,404,850	8,945

(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
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	63,440	746,688.80	
		AGREE REALTY CORP	42,156	2,784,825.36	
		ALEXANDER'S INC	1,490	380,605.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	99,321	17,025,605.82	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	35,495	897,668.55	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	110,646	3,463,219.80	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	83,590	592,235.15	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	199,918	5,649,682.68	
		AMERICOLD REALTY TRUST	156,770	6,037,212.70	
		APARTMENT INVEST & MGMT	118,590	4,170,810.30	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	162,263	1,531,762.72	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	96,312.50	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,603	22,252.11	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	110,775	16,854,416.25	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	26,850	196,810.50	
		BOSTON PROPERTIES	114,530	9,639,990.10	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,000	57,360.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	138,000	1,484,880.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	236,933	2,783,962.75	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	42,700	500,871.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	59,850.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	77,090	6,696,037.40	
		CARETRUST REIT INC	72,760	1,321,321.60	
		CBL & ASSOCIATES PRYS	99,840	24,291.07	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	45,716.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	37,360	244,708.00	
CITY OFFICE REIT INC	37,050	310,849.50			
CLIPPER REALTY INC	7,300	51,684.00			

COLONY CAPITAL INC	405,384	1,131,021.36	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	85,383	1,007,519.40	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	16,300	762,840.00	
CORECIVIC INC	98,963	927,283.31	
COREPOINT LODGING INC	22,000	124,520.00	
CORESITE REALTY CORP	31,808	3,869,761.28	
CORPORATE OFFICE PPTYS	88,859	2,206,368.97	
COUSINS PROPERTIES INC	118,784	3,589,652.48	
CUBESMART	154,197	4,684,504.86	
CYRUSONE INC	91,830	7,566,792.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	167,540	859,480.20	
DIGITAL REALTY TRUST INC	212,412	32,282,375.76	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	180,800	681,616.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	132,555	3,703,586.70	
DUKE REALTY CORP	291,730	11,053,649.70	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	60,438	1,441,446.30	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	31,018	4,132,838.32	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	110,335	681,870.30	
EPR PROPERTIES	62,582	1,916,260.84	
EQUINIX INC	70,000	54,509,700.00	
EQUITY COMMONWEALTH	95,089	2,876,442.25	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	144,530	9,372,770.50	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	275,441	14,915,130.15	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	69,910	1,170,992.50	
ESSEX PROPERTY TRUST	51,840	10,922,688.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	102,360	10,461,192.00	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	129,770.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	56,064	4,380,840.96	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	102,017	4,336,742.67	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	56,920	1,401,370.40	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	361,696.34	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	37,530	362,164.50	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	162,208	6,026,027.20	
GEO GROUP INC/THE	100,676	1,093,341.36	
GETTY REALTY CORP	25,485	732,948.60	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	470,934.00	
GLADSTONE LAND CORP	11,500	180,435.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	34,430	440,359.70	
GLOBAL NET LEASE INC	73,892	1,275,375.92	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	104,018	2,819,927.98	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	171,176	4,226,335.44	

HEALTHPEAK PROPERTIES INC	426,430	11,509,345.70	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	35,650	227,447.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	80,854	3,011,002.96	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	559,046	6,032,106.34	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	120,690	2,750,525.10	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	79,888	925,901.92	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	48,270	1,020,427.80	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	17,153	2,050,641.15	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,899	632,718.90	
INVITATION HOMES INC	430,390	12,352,193.00	
IRON MOUNTAIN INC	225,187	6,755,610.00	
JBG SMITH PROPERTIES	91,912	2,511,035.84	
KILROY REALTY CORPORATION	83,110	4,696,546.10	
KIMCO REALTY CORP	338,259	3,866,300.37	
KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	671,830.20	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	216,452	2,478,375.40	
LIFE STORAGE INC	36,608	3,656,773.12	
LTC PROPERTIES INC	32,366	1,160,644.76	
MACERICH CO/THE	95,047	713,802.97	
MACK-CALI REALTY CORP	70,670	889,028.60	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,186,564	860,258.90	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	417,722	7,786,338.08	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	90,760	10,281,292.80	
MONMOUTH REIT -CL A	81,052	1,153,369.96	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	136,765	4,743,010.20	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	49,810	1,594,916.20	
NATL HEALTH INVESTORS INC	36,335	2,212,074.80	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	63,000	269,010.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	17,500	717,150.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	40,330	972,356.30	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	177,679	5,298,387.78	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,136	224,756.96	
PARAMOUNT GROUP INC	142,226	988,470.70	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	178,994	1,537,558.46	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	106,965	1,230,097.50	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	61,970	68,786.70	
PHYSICIANS REALTY TRUST	156,071	2,704,710.43	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	101,955	1,593,556.65	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,300	103,750.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	46,280	311,464.40	
PRIME US REIT	295,000	233,050.00	
PROLOGIS INC	583,930	59,409,038.20	

PS BUSINESS PARKS INC	16,100	2,036,811.00	
PUBLIC STORAGE	119,047	23,503,449.21	
QTS REALTY TRUST INC	48,028	3,245,251.96	
REALTY INCOME CORP	270,441	16,239,982.05	
REGENCY CENTERS CORP	132,761	5,336,992.20	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	97,770	1,081,336.20	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	165,590	1,031,625.70	
RETAIL VALUE	8,969	117,493.90	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	95,973	4,459,865.31	
RLJ LODGING TRUST	123,769	1,111,445.62	
RPT REALTY	70,450	414,246.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	43,490	1,541,720.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	161,856	2,317,777.92	
SAFEHOLD INC	9,940	500,180.80	
SAUL CENTERS INC	8,800	243,848.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	29,200	372,592.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	125,070	968,041.80	
SIMON PROPERTY GROUP	240,783	15,381,218.04	
SITE CENTERS CORP	111,320	822,654.80	
SL GREEN REALTY CORP	61,870	2,840,451.70	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	83,349	2,898,878.22	
STAG INDUSTRIAL INC	116,030	3,725,723.30	
STORE CAPITAL CORP	174,028	4,333,297.20	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	90,470	517,488.40	
SUN COMMUNITIES INC	77,880	11,213,941.20	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	162,412	1,278,182.44	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	75,170	443,503.00	
TAUBMAN CENTERS INC	48,540	1,834,812.00	
TERRENO REALTY CORP	52,507	3,033,854.46	
UDR INC	234,660	8,020,678.80	
UMH PROPERTIES INC	27,000	366,120.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10,040	679,607.60	
URBAN EDGE PROPERTIES	92,220	938,799.60	
URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	218,925.00	
VENTAS INC	295,610	11,933,775.70	
VEREIT INC	845,510	5,521,180.30	
VICI PROPERTIES INC	372,756	8,614,391.16	
VORNADO REALTY TRUST	123,525	4,225,790.25	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	195,250	138,627.50	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	62,270	1,396,716.10	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	98,770	1,736,376.60	

	WELLTOWER INC	328,565	17,726,081.75	
	WHITESTONE REIT	38,340	247,293.00	
	WP CAREY INC	136,740	9,487,021.20	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	95,450	828,506.00	
	アメリカドル 小計	19,827,611	655,934,836.25 (69,588,126,777)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	46,542	1,787,678.22	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	379,567.80	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	19,560	593,450.40	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	66,990	3,096,277.80	
	CHOICE PROPERTIES REIT	123,670	1,580,502.60	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	70,620	497,871.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,577	531,152.93	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	40,730	566,554.30	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	55,550	622,160.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	369,813.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	90,705	1,346,969.25	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,970	1,690,591.50	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	115,539	1,166,943.90	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	58,250	749,677.50	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	38,900	692,420.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	277,236.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	203,146.40	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	27,000	937,980.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	69,170	789,921.40	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	120,696	1,849,062.72	
	SLATE OFFICE REI	17,000	66,130.00	
	SLATE RETAIL REIT	10,300	97,335.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	57,576	1,172,247.36	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	58,000	702,960.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	151,704.00		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	32,500	560,625.00		
	カナダドル 小計	1,298,285	22,479,978.08 (1,804,243,040)	
ユーロ	AEDIFICA	21,900	2,122,110.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	120,690	1,477,245.60	
	ALTAREA	2,730	341,250.00	

	BEFIMMO S.C.A.	16,810	626,172.50
	COFINIMMO	19,267	2,285,066.20
	COVIVIO(FP)	37,732	2,333,724.20
	EUROCOMMERCIAL	32,890	298,970.10
	GECINA SA	43,330	4,796,631.00
	HAMBORNER REIT AG	59,000	489,700.00
	HIBERNIA REIT PLC	562,550	641,307.00
	ICADE	21,380	1,164,141.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	102,045.80
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	198,362	1,407,378.39
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	18,300	400,770.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	328,021	475,630.45
	KLEPIERRE	161,860	2,175,398.40
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	54,000	237,600.00
	MERCIALYS	23,450	130,851.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	288,918	2,080,209.60
	MONTEA	8,100	788,130.00
	NSI NV	12,300	364,695.00
	RETAIL ESTATES	8,800	491,040.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	109,292	4,206,649.08
	VASTNED RETAIL	13,750	323,125.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	101,370	2,904,250.50
	WERELDHAVE NV	34,970	239,544.50
	ユーロ 小計	2,333,562	32,903,635.32 (4,134,999,850)
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	72,000	58,320.00
	ASSURA PLC	2,085,040	1,653,436.72
	BIG YELLOW GROUP PLC	129,746	1,310,434.60
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	615,000	412,050.00
	BRITISH LAND CO PLC	730,850	2,557,975.00
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	700,297	858,564.12
	CAPITAL & REGIONAL PLC	29,000	19,604.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	466,910	509,865.72
	DERWENT LONDON PLC	84,941	2,349,468.06
	ELITE COMMERCIAL REIT	131,700	88,239.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	496,000	320,912.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	198,030	1,150,554.30
	HAMMERSON PLC	611,600	318,032.00
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	603,342	3,306,314.16
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	732,660	1,696,840.56
LXI REIT PLC	415,000	438,240.00	

	NEWRIVER REIT PL	218,000	129,928.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	450,000	311,400.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	1,044,207	1,555,868.43	
	RDI REIT PLC	154,400	131,240.00	
	REGIONAL REIT LTD	292,000	224,840.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	160,426	1,177,526.84	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	114,100.00	
	SEGRO PLC	945,070	8,927,131.22	
	SHAFTESBURY PLC	181,483	879,466.61	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	273,286	282,851.01	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,368,658	2,106,364.66	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	652,000	436,188.00	
	UNITE GROUP PLC	316,092	2,949,138.36	
	WORKSPACE GROUP PLC	94,047	499,859.80	
	イギリスポンド 小計	15,123,745	36,784,023.17 (5,114,818,421)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	266,440	698,072.80	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	181,500.00	
	ARENA REIT	241,053	585,758.79	
	BWP TRUST	393,160	1,556,913.60	
	CENTURIA OFFICE REIT	319,000	606,100.00	
	CHARTER HALL GROUP	374,594	4,214,182.50	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	339,112	1,644,693.20	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	369,160	1,210,844.80	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	242,250	634,695.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,462,633	1,243,238.05	
	DEXUS	869,100	7,369,968.00	
	GDI PROPERTY GROUP	446,500	471,057.50	
	GOODMAN GROUP	1,281,444	23,424,796.32	
	GPT GROUP	1,527,757	5,759,643.89	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	243,760	762,968.80	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	148,000	444,000.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	202,588	972,422.40	
	MIRVAC GROUP	3,084,690	6,323,614.50	
	NATIONAL STORAGE REIT	795,670	1,440,162.70	
	RURAL FUNDS GROUP	272,766	591,902.22	
SCENTRE GROUP	4,059,733	8,078,868.67		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	851,060	1,804,247.20		
STOCKLAND	1,871,604	6,400,885.68		
VICINITY CENTERS	3,129,280	3,989,832.00		
WAYPOINT REIT LTD	568,970	1,507,770.50		
	オーストラリアドル 小計	23,435,324	81,918,139.12 (6,245,438,926)	

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	652,278	854,484.18	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	840,300	1,936,891.50	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,288,490	1,275,605.10	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	800,000	1,348,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	295,460	842,061.00	
ニュージーランドドル 小計		3,876,528	6,257,041.78	(435,928,100)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,523,000	6,152,920.00	
	FORTUNE REIT	1,134,000	7,518,420.00	
	LINK REIT	1,627,900	100,278,640.00	
	PROSPERITY REIT	952,000	2,332,400.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	791,000	2,958,340.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,208,000	4,397,120.00	
香港ドル 小計		7,235,900	123,637,840.00	(1,692,602,029)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	442,500.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	881,000	559,435.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,376,100	8,102,501.00	
	ASCOTT TRUST	1,442,077	1,254,606.99	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	2,253,728	3,583,427.52	
	CAPITALAND MALL TRUST	2,212,000	4,092,200.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	637,729	739,765.64	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	712,300	726,546.00	
	ESR REIT	1,854,065	723,085.35	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	780,000	397,800.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	317,479.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	562,529	1,327,568.44	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	197,800.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,894,296	2,633,071.44	
	KEPPEL DC REIT	952,903	2,792,005.79	
	KEPPEL REIT	1,539,900	1,647,693.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	341,325.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	112,572.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,703,173	3,218,996.97	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,201,160	3,783,654.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,333,552	4,900,459.20	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,652,100	1,503,411.00	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,903,644	704,348.28		
PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	288,000	1,056,960.00		

	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	179,452.50	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	465,800	365,653.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	282,701.56	
	SPH REIT	692,300	595,378.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	488,136.00	
	SUNTEC REIT	1,891,900	2,554,065.00	
	シンガポールドル 小計	35,389,812	49,624,597.68	(3,843,425,090)
韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	69,030	356,885,100.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	125,059,150.00	
	韓国ウォン 小計	88,123	481,944,250.00	(43,230,399)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	131,500	1,758,155.00	
	イスラエルシェケル 小計	131,500	1,758,155.00	(54,801,691)
	合計	108,740,390	92,957,614,323	(92,957,614,323)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 157銘柄	100.0%	74.9%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	4.4%
イギリスポンド	投資証券 31銘柄	100.0%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	4.1%
韓国ウォン	投資証券 2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注) 時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

項目	2020年 8月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	160,972,974
コール・ローン	56,696,500
投資信託受益証券	31,140,973,757
派生商品評価勘定	3,946,623
未収入金	1,057,740
流動資産合計	31,363,647,594
資産合計	31,363,647,594
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,571,047
未払金	135,614,828
未払解約金	263,902
未払利息	96
流動負債合計	140,449,873
負債合計	140,449,873
純資産の部	
元本等	
元本	22,711,024,127
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,512,173,594
元本等合計	31,223,197,721
純資産合計	31,223,197,721
負債純資産合計	31,363,647,594

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月20日現在
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法

2020年 8月20日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,711,024,127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 1.3748円 (1万口当たり純資産額) (13,748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 8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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2020年 8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 8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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	25,825,073,104円
期中追加設定元本額	4,836,986,891円
期中一部解約元本額	7,951,035,868円
期末元本額	22,711,024,127円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,957,446,265円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,286,036,417円
分散投資コア戦略ファンドA	3,371,188,673円
分散投資コア戦略ファンドS	6,802,087,287円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,390,424,922円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	535,416,980円
グローバル経済コア	1,310,800,793円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,213,068,711円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	600,116,874円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	42,982,854円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	201,454,351円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	2,087,650,232
合計	2,087,650,232

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 8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	31,439,232,002	-	31,439,856,426	624,424
	アメリカドル	31,439,232,002	-	31,439,856,426	624,424
合計		31,439,232,002	-	31,439,856,426	624,424

(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
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	15,840,990	293,533,544.70	
		アメリカドル 小計	15,840,990	293,533,544.70 (31,140,973,757)	
合計			15,840,990	31,140,973,757 (31,140,973,757)	

(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	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【グローバル経済コア】

【純資産額計算書】

(2020年 9月30日現在)

資産総額	10,657,818,703円
負債総額	16,670,182円
純資産総額(-)	10,641,148,521円
発行済口数	9,915,089,620口
1口当たり純資産額(/)	1.0732円
(1万口当たり純資産額)	(10,732円)

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 9月30日現在)

資産総額	356,817,190,585円
負債総額	554,649,547円
純資産総額(-)	356,262,541,038円
発行済口数	229,881,049,283口
1口当たり純資産額(/)	1.5498円
(1万口当たり純資産額)	(15,498円)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 9月30日現在)

資産総額	582,623,467,189円
負債総額	5,714,428,131円
純資産総額(-)	576,909,039,058円
発行済口数	409,009,122,769口
1口当たり純資産額(/)	1.4105円
(1万口当たり純資産額)	(14,105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 9月30日現在)

資産総額	422,833,635,889円
負債総額	280,570,089円
純資産総額(-)	422,553,065,800円
発行済口数	150,010,636,596口
1口当たり純資産額(/)	2.8168円
(1万口当たり純資産額)	(28,168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 9月30日現在)

資産総額	286,677,232,074円
負債総額	116,553,354円
純資産総額(-)	286,560,678,720円
発行済口数	95,980,753,365口
1口当たり純資産額(/)	2.9856円
(1万口当たり純資産額)	(29,856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 9月30日現在)

資産総額	74,055,057,728円
負債総額	15,446,155円
純資産総額(-)	74,039,611,573円
発行済口数	25,934,369,748口
1口当たり純資産額(/)	2.8549円
(1万口当たり純資産額)	(28,549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 9月30日現在）

資産総額	58,664,021,607円
負債総額	9,623,973円
純資産総額（ - ）	58,654,397,634円
発行済口数	36,443,833,704口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6094円
（1万口当たり純資産額）	（16,094円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 9月30日現在）

資産総額	105,656,791,847円
負債総額	550,103,492円
純資産総額（ - ）	105,106,688,355円
発行済口数	59,571,162,308口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7644円
（1万口当たり純資産額）	（17,644円）

グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 9月30日現在）

資産総額	79,429,047,218円
負債総額	267,278,791円
純資産総額（ - ）	79,161,768,427円
発行済口数	49,969,960,012口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5842円
（1万口当たり純資産額）	（15,842円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2020年 9月30日現在）

資産総額	32,280,647,887円
負債総額	208,339,146円
純資産総額（ - ）	32,072,308,741円

発行済口数	23,879,284,265口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3431円
（1万口当たり純資産額）	（13,431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て）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年9月30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11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9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	523	12,894,768
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	80	296,836
単位型公社債投資信託	38	268,815
合計	641	13,460,419

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

	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11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
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年11月20日	有価証券届出書
2019年11月20日	有価証券報告書
2020年 5月20日	有価証券届出書
2020年 5月20日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル経済コアの2019年8月21日から2020年8月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル経済コアの2020年8月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。