

**【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】	2021年2月10日提出
【計算期間】	第7期(自 2020年5月12日至 2020年11月10日)
【ファンド名】	SMT 8資産インデックスバランス・オープン
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

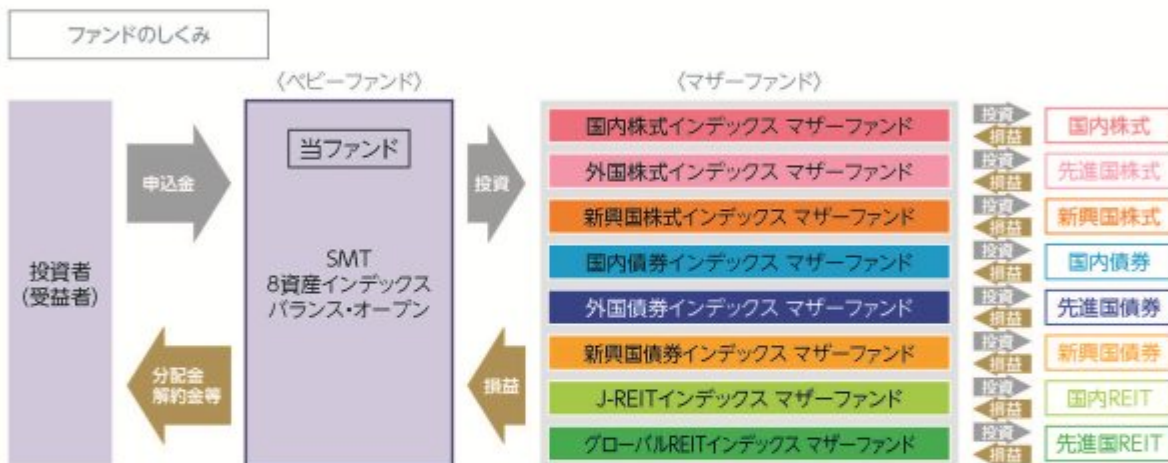
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

#### < ファンドの特色 >

## 特色1

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

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



### ? ファミリーファンド方式とは

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

### ? DR(預託証券)とは

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

### ? REITとは

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

## ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

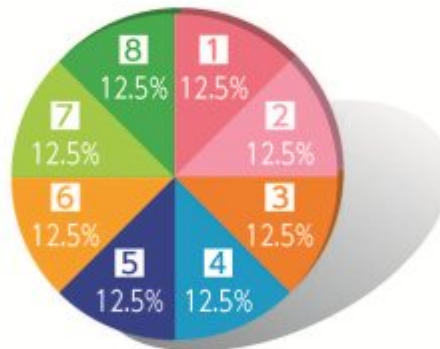
ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

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

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

詳しくは下記をご覧ください。



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

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

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

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

「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。

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

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

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

## 分配方針

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

## 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

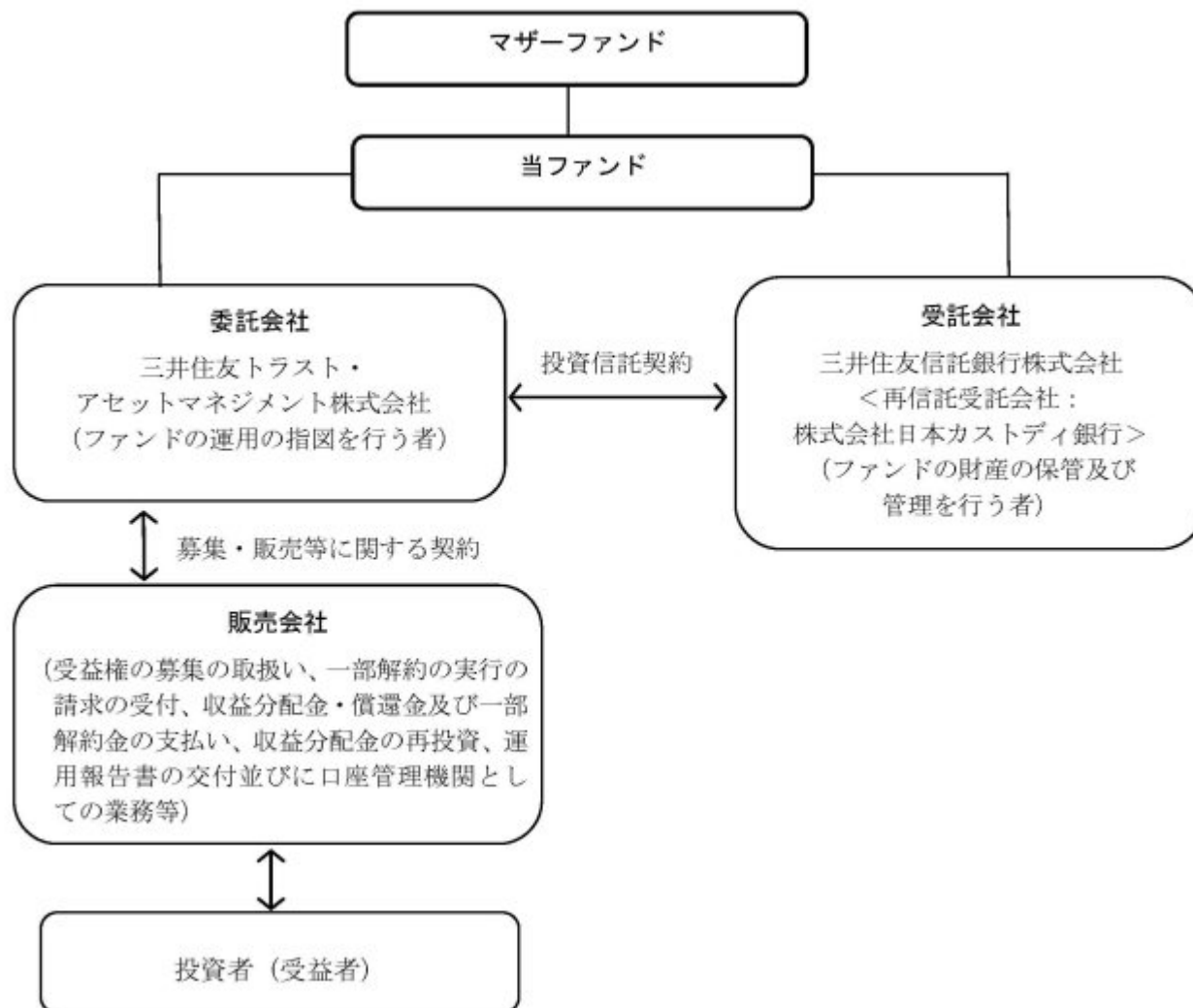
## (2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



## 委託会社の概況（2020年11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」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）及び債券、並びに国内及び先進国の不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．各マザーファンド受益証券の基本配分比率は、8分の1ずつの均等配分とします。また、各マザーファンド受益証券の配分比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ハ．各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

## 1. 為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

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

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

###### 1．基本方針

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

###### 2．運用方法

###### (1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

###### 3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件の

もとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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



社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

なるよう調整を行うこととします。

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

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

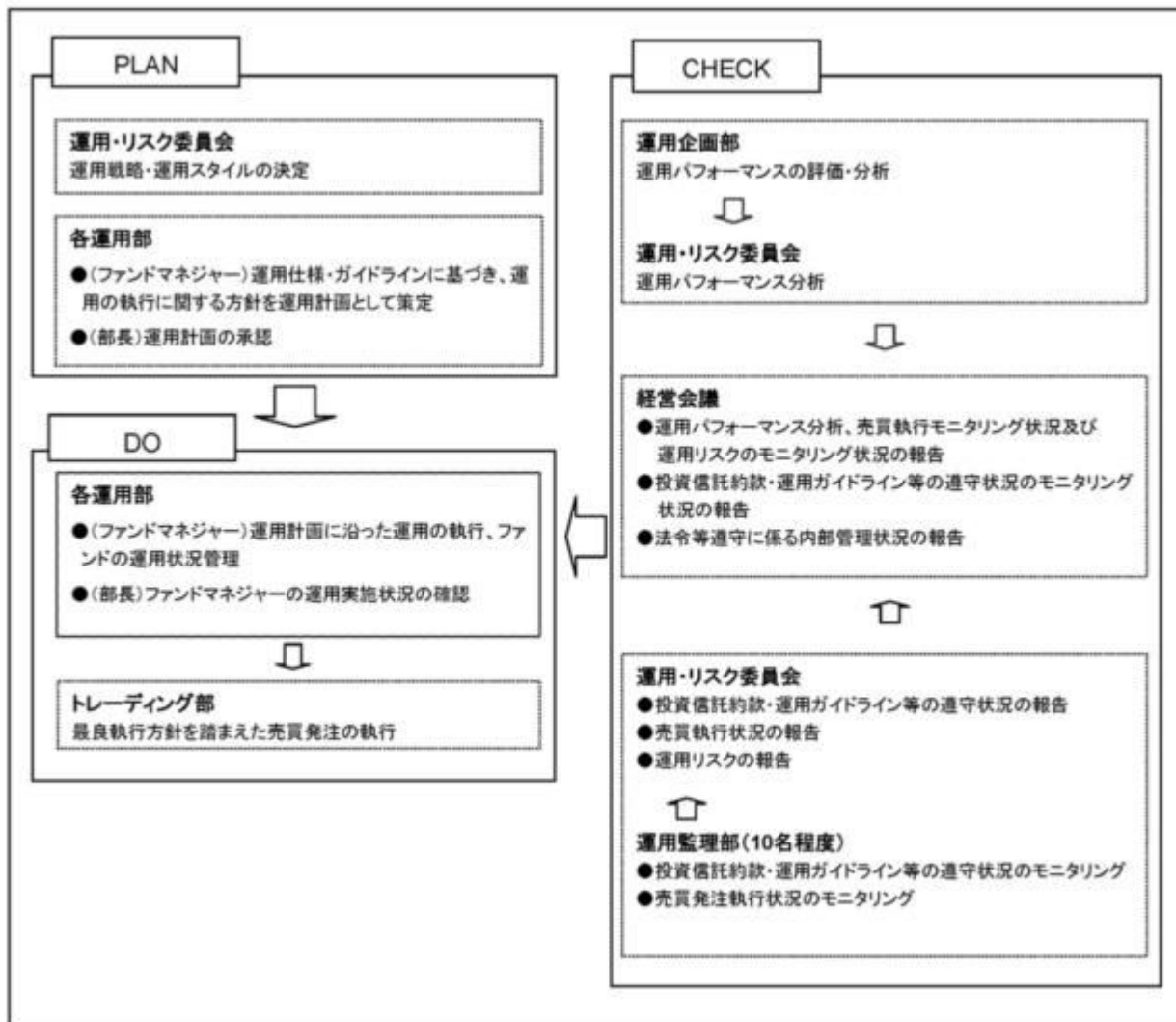
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

## (3)【運用体制】

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

ることがあります。



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### < 約款に定める投資制限 >

#### イ．株式等への投資割合

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

#### ロ．投資信託証券への投資割合

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

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとし

す。（以下同じ。）

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

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

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

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

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲



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

#### ル. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

#### ヲ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

#### カ. 資金の借入れ

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

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

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

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### リートの価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 信用リスク

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

### カントリーリスク

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

### 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

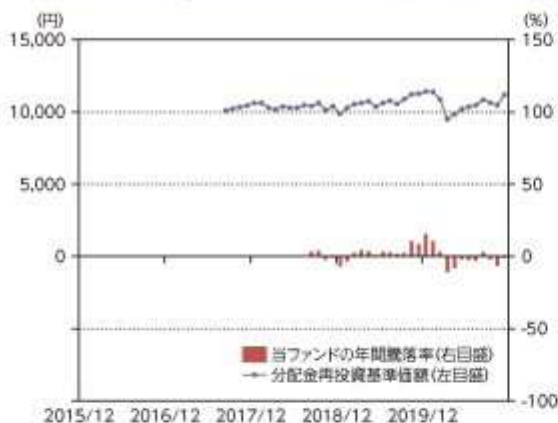
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドについては2018年8月～2020年11月の2年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2015年12月～2020年11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を銘柄を対象とした時価割増加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は充実に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIロイヤリティ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロイヤリティ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより提供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いません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延または遅延につき自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カンパニイ・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・リーダー・ファンド(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諾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 0.55%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

## （ 4 ）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息

（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

## （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ま  
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ます。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

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

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

NISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2020年11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11月30日現在の状況について記載してあります。



## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	59,408,518	97.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,484,492	2.44
合計(純資産総額)		60,893,010	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	新興国株式インデックス マザーファンド	2,595,296	3.1642	8,212,036	3.2258	8,371,905	13.75
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	2,700,593	2.9815	8,052,041	3.0537	8,246,800	13.54
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	4,640,929	1.6226	7,530,704	1.6740	7,768,915	12.76
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	4,422,546	1.6848	7,451,426	1.7254	7,630,660	12.53
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	4,181,204	1.6927	7,077,532	1.6899	7,065,816	11.60
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	4,048,379	1.7546	7,103,542	1.7348	7,023,127	11.53
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	2,345,492	2.9625	6,948,555	2.9723	6,971,505	11.45
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	4,488,895	1.4090	6,324,865	1.4101	6,329,790	10.39

(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	97.56
合計	97.56

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。



## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末 (2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
第3期計算期間末 (2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
第4期計算期間末 (2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
第5期計算期間末 (2019年11月11日)	32,350,523	32,350,523	11,176	11,176
第6期計算期間末 (2020年 5月11日)	38,971,244	38,971,244	9,884	9,884
第7期計算期間末 (2020年11月10日)	58,213,200	58,213,200	11,058	11,058
2019年11月末日	34,153,920		11,275	
12月末日	34,344,114		11,419	
2020年 1月末日	35,966,329		11,393	
2月末日	37,426,487		10,865	
3月末日	34,935,405		9,497	
4月末日	38,641,057		9,852	
5月末日	42,610,218		10,196	
6月末日	45,094,246		10,354	
7月末日	47,888,603		10,467	
8月末日	52,032,382		10,841	
9月末日	53,610,550		10,639	
10月末日	54,789,251		10,476	
11月末日	60,893,010		11,187	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	0

第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	0
---------	-------------------------	---

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.7
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	11.6
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	11.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	10,577,572	4,052,049	28,946,438
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	15,251,653	4,770,851	39,427,240
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	16,057,478	2,841,160	52,643,558

(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	360,665,654,520	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,883,428,390	1.87
合計(純資産総額)		367,549,082,910	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	4,774,960,000	1.30

(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	1,655,700	6,792.63	11,246,557,491	6,999.00	11,588,244,300	3.15
日本	株式	ソニー	電気機器	929,600	7,045.96	6,549,924,416	9,704.00	9,020,838,400	2.45
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,155,400	5,010.39	5,789,004,606	7,272.00	8,402,068,800	2.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	134,500	44,515.68	5,987,358,960	53,290.00	7,167,505,000	1.95
日本	株式	任天堂	その他製品	91,000	45,077.36	4,102,039,760	59,260.00	5,392,660,000	1.47
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,946,500	2,438.97	4,747,455,105	2,465.00	4,798,122,500	1.31
日本	株式	日本電産	電気機器	357,200	6,924.05	2,473,270,660	13,305.00	4,752,546,000	1.29
日本	株式	第一三共	医薬品	1,273,900	3,331.78	4,244,354,542	3,694.00	4,705,786,600	1.28
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,234,600	4,151.15	5,125,009,790	3,745.00	4,623,577,000	1.26
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,011,600	444.51	4,450,256,316	448.50	4,490,202,600	1.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	189,100	16,303.93	3,083,073,163	23,665.00	4,475,051,500	1.22
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,015,800	3,758.94	3,818,331,252	4,400.00	4,469,520,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	249,500	12,738.74	3,178,315,630	17,135.00	4,275,182,500	1.16
日本	株式	HOYA	精密機器	294,400	10,216.56	3,007,755,264	13,910.00	4,095,104,000	1.11
日本	株式	村田製作所	電気機器	436,000	6,113.44	2,665,459,840	9,129.00	3,980,244,000	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	139,500	19,368.84	2,701,953,180	25,365.00	3,538,417,500	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,168,300	2,781.45	3,249,568,035	2,871.50	3,354,773,450	0.91
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	94,200	22,243.85	2,095,370,670	35,470.00	3,341,274,000	0.91
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,061,600	3,119.09	3,311,225,944	2,982.50	3,166,222,000	0.86
日本	株式	S M C	機械	46,600	54,873.31	2,557,096,246	66,320.00	3,090,512,000	0.84
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,012,200	3,124.48	3,162,598,656	3,032.00	3,068,990,400	0.83
日本	株式	エムスリー	サービス業	312,700	4,560.69	1,426,127,763	9,622.00	3,008,799,400	0.82

日本	株式	日立製作所	電気機器	713,000	3,479.50	2,480,883,500	3,966.00	2,827,758,000	0.77
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,022,200	2,353.03	2,405,267,266	2,758.50	2,819,738,700	0.77
日本	株式	花王	化学	355,300	8,593.22	3,053,171,066	7,808.00	2,774,182,400	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	517,500	4,702.66	2,433,626,550	5,190.00	2,685,825,000	0.73
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	150,800	15,516.32	2,339,861,056	17,765.00	2,678,962,000	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,988,700	1,352.51	2,689,736,637	1,327.50	2,639,999,250	0.72
日本	株式	中外製薬	医薬品	464,100	5,245.92	2,434,631,472	5,044.00	2,340,920,400	0.64
日本	株式	三菱商事	卸売業	958,300	2,516.53	2,411,590,699	2,433.00	2,331,543,900	0.63

(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	0.08
		鉱業	0.14
		建設業	2.32
		食料品	3.49
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	7.48
		医薬品	5.98
		石油・石炭製品	0.35
		ゴム製品	0.53
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.60
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.61
		機械	5.66
		電気機器	16.70
		輸送用機器	6.90
		精密機器	2.76
		その他製品	2.66
		電気・ガス業	1.30
		陸運業	3.45
		海運業	0.17
		空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.17		
情報・通信業	8.94		
卸売業	4.38		
小売業	4.74		

	銀行業	4.48
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	1.90
	その他金融業	1.10
	不動産業	2.01
	サービス業	6.01
	小計	98.13
合計		98.13

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	272円		4,501,987,550	4,774,960,000	1.30

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

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

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	299,027,075,888	65.16
	イギリス	19,274,205,914	4.20
	スイス	15,710,709,017	3.42
	フランス	15,584,136,901	3.40
	カナダ	15,206,723,913	3.31
	ドイツ	13,441,923,987	2.93
	オーストラリア	9,273,268,569	2.02
	オランダ	8,897,911,160	1.94
	アイルランド	8,085,659,079	1.76
	スウェーデン	4,732,557,567	1.03
	スペイン	3,815,994,537	0.83
	デンマーク	3,625,558,370	0.79
	香港	3,551,615,806	0.77

	イタリア	2,861,449,466	0.62
	フィンランド	1,812,515,626	0.39
	バミューダ	1,485,385,076	0.32
	ベルギー	1,415,280,348	0.31
	シンガポール	1,377,464,084	0.30
	ジャージー	1,111,486,011	0.24
	ケイマン	877,625,540	0.19
	イスラエル	850,765,284	0.19
	ノルウェー	839,217,704	0.18
	ニュージーランド	477,833,028	0.10
	ルクセンブルク	371,033,924	0.08
	キュラソー	299,928,194	0.07
	オーストリア	285,838,402	0.06
	ポルトガル	260,130,798	0.06
	リベリア	132,078,727	0.03
	パナマ	90,442,352	0.02
	マン島	85,565,293	0.02
	パプアニューギニア	40,471,619	0.01
	小計	434,901,852,184	94.77
新株予約権証券	スイス	2,426,648	0.00
投資信託受益証券	オーストラリア	209,293,765	0.05
	香港	75,076,113	0.02
	小計	284,369,878	0.06
投資証券	アメリカ	8,232,830,811	1.79
	オーストラリア	641,761,484	0.14
	フランス	285,230,094	0.06
	イギリス	239,307,749	0.05
	シンガポール	213,986,287	0.05
	香港	182,662,100	0.04
	カナダ	85,443,974	0.02
	小計	9,881,222,499	2.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,853,977,052	3.02
合計(純資産総額)		458,923,848,261	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	9,766,026,212	2.13
	買建	カナダ	663,265,200	0.14

買建	ドイツ	2,064,127,733	0.45
買建	イギリス	757,991,809	0.17
買建	オーストラリア	380,877,547	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	売建		155,820,000	0.03

(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	1,632,757	8,375.74	13,675,564,054	12,112.53	19,776,826,472	4.31
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	678,610	18,926.85	12,843,954,514	22,360.24	15,173,885,656	3.31
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	39,938	251,864.06	10,058,946,948	331,963.87	13,257,973,144	2.89
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	226,861	23,567.41	5,346,526,597	28,861.68	6,547,589,791	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	28,424	147,530.26	4,193,400,370	186,294.50	5,295,235,127	1.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,190	147,669.01	4,162,789,647	185,653.50	5,233,572,385	1.14
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	69,867	17,803.53	1,243,879,443	60,854.60	4,251,728,785	0.93
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	15,275.48	3,781,401,026	14,960.16	3,703,342,728	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	286,357	10,373.91	2,970,644,286	12,593.54	3,606,249,995	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	158,538	20,218.22	3,205,357,198	21,920.78	3,475,278,205	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	232,638	12,130.49	2,822,014,736	14,400.19	3,350,032,076	0.73

スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	280,020	11,853.30	3,319,163,624	11,761.43	3,293,435,909	0.72
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	57,796	35,914.56	2,075,718,047	55,108.45	3,185,048,005	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	130,701	19,350.09	2,529,076,429	24,055.72	3,144,107,901	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	89,134	31,589.23	2,815,674,642	35,108.58	3,129,368,758	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	83,996	31,538.69	2,649,123,825	35,225.98	2,958,841,609	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	101,081	25,595.41	2,587,209,998	28,672.60	2,898,255,192	0.63
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	169,806	12,183.43	2,068,820,714	15,285.33	2,595,541,714	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	388,985	5,807.13	2,258,886,702	6,293.65	2,448,137,857	0.53
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	104,882	15,581.63	1,634,232,916	21,961.30	2,303,345,811	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	428,273	4,135.17	1,770,983,620	5,376.30	2,302,527,342	0.50
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	39,204.55	2,594,008,404	34,778.42	2,301,149,268	0.50
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	45,295	39,806.64	1,803,041,925	49,558.64	2,244,758,902	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	734,208	2,585.39	1,898,220,797	3,011.77	2,211,266,436	0.48
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	84,561	19,437.49	1,643,654,294	25,726.28	2,175,440,022	0.47
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	41,353	43,213.23	1,786,996,718	51,047.39	2,110,962,735	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	383,648	4,904.61	1,881,644,604	5,475.00	2,100,473,951	0.46
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	133,237	12,896.07	1,718,234,795	15,749.72	2,098,445,977	0.46
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	669,946	3,220.26	2,157,402,876	3,015.92	2,020,508,029	0.44
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	3,750.48	1,958,933,165	3,867.82	2,020,222,858	0.44

(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	2.98
		素材	4.27
		資本財	6.39



	商業・専門サービス	1.15
	運輸	2.03
	自動車・自動車部品	1.83
	耐久消費財・アパレル	1.92
	消費者サービス	1.53
	メディア・娯楽	6.74
	小売	5.81
	食品・生活必需品小売り	1.46
	食品・飲料・タバコ	4.09
	家庭用品・パーソナル用品	2.00
	ヘルスケア機器・サービス	5.09
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.60
	銀行	5.58
	各種金融	4.21
	保険	3.08
	不動産	0.46
	ソフトウェア・サービス	11.59
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.74
	電気通信サービス	1.91
	公益事業	3.26
	半導体・半導体製造装置	4.03
	小計	94.77
新株予約権証券		0.00
投資信託受益証券		0.06
投資証券		2.15
合計		96.98

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	517	アメリカドル	87,214,534	9,060,717,937	94,003,525	9,766,026,212	2.13
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	40	カナダドル	7,712,760	616,635,162	8,296,000	663,265,200	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	4,755,419	546,730,522	4,923,720	566,080,088	0.12

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	341	ユーロ	10,799,704.5	1,343,267,245	12,044,120	1,498,047,645	0.33
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	30	オーストラリアドル	4,471,560	343,907,679	4,952,250	380,877,547	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	86	イギリスポンド	5,038,657.5	698,105,996	5,470,890	757,991,809	0.17

(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	売建	1,500,000.00	155,820,000	155,820,000	0.03

(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	20,985,447,371	25.17
	韓国	10,454,927,122	12.54
	台湾	10,059,322,891	12.06
	中国	9,617,719,158	11.53
	インド	7,247,781,631	8.69
	ブラジル	3,865,650,648	4.64
	南アフリカ	2,831,559,048	3.40
	サウジアラビア	2,102,371,774	2.52
	ロシア	2,094,875,937	2.51
	香港	1,671,805,101	2.00
	タイ	1,588,362,939	1.90
	メキシコ	1,376,793,770	1.65
	マレーシア	1,328,750,246	1.59
	インドネシア	1,146,747,574	1.38
	バミューダ	649,761,754	0.78
	フィリピン	619,770,690	0.74
	カタール	583,939,852	0.70
ポーランド	519,752,980	0.62	

	アラブ首長国連邦	451,302,798	0.54
	チリ	416,471,406	0.50
	アメリカ	302,836,228	0.36
	トルコ	267,868,353	0.32
	オランダ	224,670,160	0.27
	ハンガリー	170,289,368	0.20
	ルクセンブルク	165,296,806	0.20
	コロンビア	130,323,772	0.16
	ギリシャ	101,072,077	0.12
	チェコ	83,382,562	0.10
	エジプト	69,698,883	0.08
	ジャージー	58,707,652	0.07
	シンガポール	29,766,425	0.04
	アルゼンチン	21,284,160	0.03
	ペルー	19,118,783	0.02
	マン島	18,400,424	0.02
	パキスタン	16,646,426	0.02
	小計	81,292,476,769	97.49
投資信託受益証券	ブラジル	155,312,319	0.19
	メキシコ	26,745,191	0.03
	小計	182,057,510	0.22
投資証券	メキシコ	31,883,872	0.04
	南アフリカ	24,971,656	0.03
	小計	56,855,528	0.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,853,431,425	2.22
合計(純資産総額)		83,384,821,232	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	2,065,696,815	2.48

(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		218,148,000	0.26

(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	30,183.16	6,099,141,667	28,723.50	5,804,187,823	6.96
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	616,200	8,341.50	5,140,032,300	7,812.20	4,813,877,640	5.77
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,652,389	1,668.93	4,426,678,097	1,779.95	4,721,146,324	5.66
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	5,670.83	2,913,836,375	6,424.43	3,301,057,156	3.96
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	382,700	4,491.68	1,718,965,936	4,180.80	1,599,992,160	1.92
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	46,871	22,963.48	1,076,321,534	21,579.23	1,011,440,099	1.21
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	91,224	8,816.10	804,240,399	9,288.80	847,361,938	1.02
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,247,620	79.19	811,550,019	81.74	837,640,459	1.00
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	306,633	2,891.48	886,625,333	2,721.01	834,353,912	1.00
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	632,500	1,124.26	711,094,450	1,228.78	777,203,350	0.93
ブラジル	株式	VALE SA	素材	395,778	1,229.67	486,679,262	1,526.44	604,132,320	0.72
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	365,523	1,602.53	585,763,584	1,551.00	566,926,173	0.68
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	177,443	3,034.46	538,443,863	3,181.31	564,501,634	0.68
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	59,004	8,101.20	478,003,205	9,306.96	549,147,868	0.66
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	96,334	4,573.23	440,558,290	5,610.05	540,439,520	0.65
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	5,181.00	461,005,380	5,821.56	518,002,409	0.62
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	28,981	11,026.88	319,570,143	14,965.35	433,710,939	0.52
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	43,945	9,125.69	401,028,781	9,697.09	426,138,734	0.51
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	667,500	678.04	452,591,700	637.17	425,310,975	0.51
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	29,357	14,979.89	439,764,898	14,484.34	425,216,881	0.51
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	160,804	2,555.27	410,899,245	2,639.00	424,361,756	0.51
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,464,515	62.98	407,135,155	65.25	421,861,320	0.51
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	296,934	1,278.88	379,744,706	1,409.78	418,613,782	0.50

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	295.56	394,065,445	300.66	400,859,677	0.48
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	342.37	379,893,752	349.07	387,328,072	0.46
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	4,819	69,142.79	333,199,153	76,302.00	367,699,338	0.44
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	96,664	3,844.50	371,625,327	3,778.30	365,226,219	0.44
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	541,702	652.40	353,410,177	667.42	361,544,645	0.43
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	13,049	28,071.59	366,306,308	26,799.89	349,711,895	0.42
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	324,000	1,073.78	347,906,880	1,019.74	330,395,760	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.16
		素材	7.03
		資本財	2.65
		商業・専門サービス	0.26
		運輸	1.35
		自動車・自動車部品	3.05
		耐久消費財・アパレル	1.27
		消費者サービス	1.55
		メディア・娯楽	8.97
		小売	13.21
		食品・生活必需品小売り	1.25
		食品・飲料・タバコ	3.38
		家庭用品・パーソナル用品	1.02
		ヘルスケア機器・サービス	1.17
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.92
		銀行	12.66
		各種金融	2.04
		保険	2.99
		不動産	2.09
		ソフトウェア・サービス	2.06
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.32		
電気通信サービス	2.99		
公益事業	2.03		

		半導体・半導体製造装置	8.06
		小計	97.49
投資信託受益証券			0.22
投資証券			0.07
合計			97.78

(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	322	アメリカドル	19,173,490	1,991,933,876	19,883,500	2,065,696,815	2.48

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,100,000.00	218,148,000	218,148,000	0.26

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

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

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	502,772,530,200	83.51
地方債証券	日本	33,087,191,495	5.50
特殊債券	日本	38,929,940,750	6.47
社債券	日本	24,386,553,290	4.05
	フランス	1,390,774,000	0.23
	オーストラリア	400,904,000	0.07
	小計	26,178,231,290	4.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,091,286,835	0.18

合計(純資産総額)	602,059,180,570	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145回利付国債(5年)	7,810,000,000	100.99	7,887,905,300	100.98	7,887,240,900	0.100	2025/9/20	1.31
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	100.91	7,488,041,400	0.100	2024/9/20	1.24
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	100.85	7,362,488,000	0.100	2024/6/20	1.22
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	7,050,000,000	100.91	7,114,155,000	100.78	7,105,060,500	0.100	2023/12/20	1.18
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,860,000,000	100.86	6,918,996,000	100.67	6,906,305,000	0.100	2023/9/20	1.15
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	101.00	6,888,609,200	0.100	2025/6/20	1.14
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	101.42	6,734,288,000	101.16	6,717,488,800	0.100	2026/9/20	1.12
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	102.46	6,475,598,400	0.400	2025/9/20	1.08
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	101.06	6,447,947,000	0.100	2026/3/20	1.07
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	5,850,000,000	100.67	5,889,195,000	100.49	5,878,840,500	0.100	2022/12/20	0.98
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	101.39	5,870,770,500	0.100	2028/3/20	0.98
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	5,630,000,000	101.07	5,690,241,000	100.95	5,683,879,100	0.100	2024/12/20	0.94
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	101.26	5,265,884,000	0.100	2027/3/20	0.87
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	5,090,000,000	102.76	5,230,672,400	102.60	5,222,543,600	0.600	2024/6/20	0.87
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	102.37	5,170,139,500	0.400	2025/6/20	0.86
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	5,030,000,000	101.24	5,092,514,500	101.24	5,092,824,700	0.100	2029/3/20	0.85
日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	4,340,000,000	116.74	5,066,785,600	116.50	5,056,490,600	1.400	2034/9/20	0.84
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	100.28	5,004,271,400	0.100	2022/3/20	0.83
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	101.20	4,928,488,700	0.100	2029/6/20	0.82
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,850,000,000	101.47	4,921,472,000	101.36	4,916,299,500	0.100	2028/6/20	0.82
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	101.36	4,906,259,600	0.100	2027/9/20	0.81
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	4,830,000,000	100.88	4,872,795,000	101.14	4,885,400,100	0.100	2029/9/20	0.81
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	100.79	4,797,842,000	0.100	2024/3/20	0.80

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	100.34	4,786,647,300	0.100	2022/6/20	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	101.29	4,527,841,800	0.100	2028/12/20	0.75
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	100.43	4,398,965,400	0.100	2022/9/20	0.73
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	102.25	4,345,710,000	0.600	2023/12/20	0.72
日本	国債証券	第417回利付国債（2年）	4,300,000,000	100.46	4,320,043,400	100.45	4,319,350,000	0.100	2022/10/1	0.72
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	101.33	4,316,785,800	0.100	2028/9/20	0.72
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	4,130,000,000	101.45	4,189,903,600	101.38	4,187,159,200	0.100	2027/12/20	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.51
地方債証券	5.50
特殊債券	6.47
社債券	4.35
合計	99.82

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	117,813,560,629	42.18
	フランス	28,958,323,306	10.37
	イタリア	26,240,993,355	9.39
	ドイツ	21,093,726,501	7.55
	イギリス	18,194,359,176	6.51
	スペイン	16,968,964,941	6.07
	オーストラリア	7,365,014,996	2.64



	ベルギー	6,971,180,664	2.50
	カナダ	5,488,019,130	1.96
	オランダ	5,436,195,539	1.95
	オーストリア	4,196,914,091	1.50
	アイルランド	2,316,917,220	0.83
	メキシコ	2,244,344,675	0.80
	フィンランド	1,741,310,561	0.62
	ポーランド	1,730,940,724	0.62
	デンマーク	1,549,918,053	0.55
	マレーシア	1,351,833,740	0.48
	シンガポール	1,195,972,756	0.43
	イスラエル	1,174,921,978	0.42
	スウェーデン	904,933,288	0.32
	ノルウェー	599,009,490	0.21
	小計	273,537,354,813	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,799,292,985	2.08
合計(純資産総額)		279,336,647,798	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,614,723,311	0.58
	買建	ドイツ	2,351,146,433	0.84

(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		3,774,506,000	1.35

(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	10,341.74	1,458,185,682	10,215.30	1,440,358,555	0.625	2030/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,709.53	1,258,775,480	11,603.62	1,247,389,168	2.375	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,148.63	1,213,648,824	11,974.94	1,196,297,083	2.625	2029/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,386.10	1,163,659,469	11,314.27	1,156,318,426	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,280.58	1,144,979,601	11,198.20	1,136,617,884	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	10,950,000	10,290.70	1,126,832,192	10,190.14	1,115,821,217	0.625	2030/8/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,280.86	1,127,545,104	13,086.89	1,111,077,000	3.000	2022/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,286.61	1,095,966,128	12,113.73	1,080,545,284	2.875	2028/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,842.70	1,084,270,716	10,755.45	1,075,545,577	2.000	2022/10/31	0.39
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,490,000	22,470.97	1,008,946,679	23,693.27	1,063,827,849	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,691.33	1,069,133,611	10,629.04	1,062,904,273	1.500	2022/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,409.57	1,056,571,378	10,409.69	1,056,584,231	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,546.66	1,054,666,118	10,497.15	1,049,715,115	1.250	2021/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,541.47	1,053,483,559	12,350.73	1,037,461,777	3.125	2028/11/15	0.37
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	12,745.34	1,031,098,677	12,803.30	1,035,787,299	0.000	2025/3/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,382.55	1,038,255,882	10,346.38	1,034,638,889	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,587.79	1,037,107,495	11,493.64	1,028,681,043	2.250	2027/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,715.27	1,023,309,194	10,640.20	1,016,139,366	1.750	2022/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,688.29	1,020,731,928	10,614.43	1,013,678,370	1.750	2022/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	10,666.95	1,013,361,139	10,638.78	1,010,684,329	1.500	2022/9/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000	15,621.08	968,507,457	15,935.56	988,005,067	2.500	2030/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,653.53	996,377,336	11,541.52	986,800,788	2.250	2027/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375% 08/15/50	9,900,000	10,066.60	996,593,443	9,888.21	978,933,561	1.375	2050/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	10,900.24	981,021,843	10,852.04	976,683,686	1.375	2025/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/31/26	8,600,000	11,419.37	982,066,490	11,347.95	975,923,994	2.125	2026/5/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,339.44	982,247,225	10,254.26	974,155,427	0.375	2027/7/31	0.35
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000	18,713.71	967,499,183	18,836.10	973,826,742	5.500	2029/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	7,000,000	14,202.89	994,202,954	13,908.27	973,579,162	3.000	2049/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,142.20	978,285,380	11,085.38	973,297,036	1.625	2026/11/30	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,287.11	970,731,514	15,271.37	969,732,401	3.500	2026/4/25	0.35

(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	97.92
合計	97.92

(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	46	アメリカドル	5,792,167.96	601,748,330	5,796,000	602,146,440	0.22
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	30	アメリカドル	4,138,490.28	429,947,755	4,145,625	430,688,981	0.15
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	32	アメリカドル	5,574,245.85	579,108,401	5,601,000	581,887,890	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,809,112.5	349,397,413	2,808,750	349,352,325	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	32	ユーロ	4,334,077.2	539,072,522	4,335,680	539,271,878	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	67	ユーロ	11,736,800.7	1,459,823,271	11,758,500	1,462,522,230	0.52

(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	15,800,000.00	1,655,874,600	1,640,830,000	0.59
	カナダドル	買建	2,480,000.00	199,348,010	198,226,400	0.07
	ユーロ	買建	13,300,000.00	1,652,978,730	1,654,254,000	0.59
	イギリスポンド	買建	2,030,000.00	282,759,345	281,195,600	0.10

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

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

## 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	6,027,424,937	9.77
	インドネシア	5,935,642,830	9.62
	ブラジル	5,424,029,861	8.79
	タイ	5,389,149,626	8.73
	ポーランド	5,115,826,919	8.29

	ロシア	5,017,753,609	8.13
	中国	4,764,212,324	7.72
	南アフリカ	4,511,300,215	7.31
	マレーシア	4,319,084,061	7.00
	コロンビア	3,377,815,257	5.47
	チェコ	2,507,273,125	4.06
	ハンガリー	2,365,964,127	3.83
	ペルー	1,802,965,552	2.92
	チリ	1,598,753,517	2.59
	トルコ	1,225,036,686	1.98
	フィリピン	116,681,472	0.19
	ドミニカ共和国	84,528,714	0.14
	ウルグアイ	84,097,265	0.14
	小計	59,667,540,097	96.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,056,254,096	3.33
合計(純資産総額)		61,723,794,193	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		7,876,442	0.01
	売建		7,948,842	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。

#### 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	90,300,000,000	3.72	3,364,239,916	3.74	3,377,815,257	9.850	2027/6/28	5.47
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	61,500,000	1,617.87	994,991,220	1,636.87	1,006,677,156	0.000	2024/1/1	1.63
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	115,000,000	805.68	926,532,805	796.15	915,583,977	10.500	2026/12/21	1.48
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,683.87	862,145,678	1,681.33	860,843,545	0.000	2023/7/1	1.39
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000	2,140.88	808,184,092	2,136.11	806,383,574	10.000	2023/1/1	1.31

ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000	2,202.87	776,512,009	2,177.90	767,711,786	10.000	2025/1/1	1.24
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000	1,581.25	679,938,773	1,574.28	676,940,723	2.940	2024/10/17	1.10
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	24,350,000	2,810.11	684,262,425	2,759.61	671,966,079	3.885	2029/8/15	1.09
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	157,100,000	420.09	659,976,377	418.99	658,241,270	3.300	2038/6/17	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	578.08	628,092,775	580.85	631,103,966	7.500	2027/6/3	1.02
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,653.25	606,269,067	2,645.62	604,524,820	3.480	2023/3/15	0.98
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	93,900,000	650.25	610,593,877	641.97	602,813,041	8.000	2030/1/31	0.98
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	19,850,000	3,000.82	595,664,108	2,994.17	594,344,004	2.500	2024/4/25	0.96
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	19,400,000	3,068.63	595,314,823	3,058.26	593,304,296	2.500	2026/7/25	0.96
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	26,850,000	2,234.29	599,907,934	2,198.16	590,206,936	10.000	2027/1/1	0.96
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	93,600,000	615.53	576,144,682	621.21	581,454,301	8.500	2029/5/31	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,921.60	581,399,166	2,916.83	580,450,708	2.500	2023/1/25	0.94
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	536.20	580,173,648	535.59	579,511,009	6.500	2022/6/9	0.94
中国	国債証券	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000	1,596.62	558,817,098	1,592.77	557,472,458	3.250	2026/6/6	0.90
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	569.90	558,220,498	568.14	556,497,156	8.000	2023/12/7	0.90
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	1,874.56	535,189,213	1,878.74	536,380,773	0.000	2022/1/1	0.87
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	126,700,000	424.97	538,441,513	422.17	534,890,986	3.400	2036/6/17	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	617.79	508,133,632	616.79	507,314,027	10.000	2024/12/5	0.82
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	552.61	493,487,678	547.35	488,785,997	8.750	2048/2/28	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	418.62	478,484,043	416.37	475,912,202	3.650	2031/6/20	0.77
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	3,159.18	475,458,003	3,158.71	475,387,107	2.750	2029/10/25	0.77
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,950,000	3,083.40	460,968,679	3,075.39	459,771,455	2.500	2027/7/25	0.74
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000	3,136.24	445,346,862	3,131.92	444,733,030	2.750	2028/4/25	0.72
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000	0.84	436,925,008	0.84	438,064,016	8.375	2034/3/15	0.71
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	14,050,000	3,094.12	434,724,747	3,087.11	433,739,753	4.000	2023/10/25	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.67
合計	96.67

(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	75,822.51	7,948,842	7,876,442	0.01
	ロシアルーブル	売建	5,802,075.00	7,948,842	7,948,842	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。

## 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	92,795,477,080	96.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,270,085,661	3.40
合計(純資産総額)		96,065,562,741	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 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,254,464,000	3.39

(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	11,623	574,967.83	6,682,851,088	577,000	6,706,471,000	6.98

日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,327	550,915.61	5,689,305,504	542,000	5,597,234,000	5.83
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,626	330,498.6	5,164,371,123	327,500	5,117,515,000	5.33
日本	投資証券	G L P 投資法人	29,695	153,811.57	4,567,434,571	157,900	4,688,840,500	4.88
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	33,396	136,399.47	4,555,196,700	136,000	4,541,856,000	4.73
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,735	244,499.3	3,602,697,185	251,300	3,702,905,500	3.85
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	19,403	169,390.97	3,286,692,990	166,500	3,230,599,500	3.36
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	20,577	159,688.15	3,285,903,062	156,000	3,210,012,000	3.34
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,810	304,489.83	2,987,045,232	301,500	2,957,715,000	3.08
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	22,086	126,578.3	2,795,608,333	118,000	2,606,148,000	2.71
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,598	176,485.61	2,576,336,934	176,000	2,569,248,000	2.67
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	30,375	75,094.28	2,280,988,755	74,600	2,265,975,000	2.36
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,195	633,129.53	2,022,848,848	662,000	2,115,090,000	2.20
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,175	402,932.99	2,085,178,223	390,000	2,018,250,000	2.10
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,748	290,413.31	1,959,709,015	295,000	1,990,660,000	2.07
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,432	586,972.94	2,014,491,130	577,000	1,980,264,000	2.06
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,430	312,951.82	2,012,280,202	306,500	1,970,795,000	2.05
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,509	161,467.7	1,858,331,759	156,200	1,797,705,800	1.87
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	3,604	493,455.27	1,778,412,793	496,000	1,787,584,000	1.86
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,269	57,676.82	1,918,850,124	51,400	1,710,026,600	1.78
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,131	132,022.58	1,601,565,917	137,900	1,672,864,900	1.74
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	43,182	38,225.88	1,650,669,950	30,950	1,336,482,900	1.39
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,200	629,999.32	1,385,998,504	599,000	1,317,800,000	1.37
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,507	301,951.22	1,360,894,148	289,300	1,303,875,100	1.36
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,427	377,995.59	1,295,390,886	375,000	1,285,125,000	1.34
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,475	123,987.29	1,298,766,862	122,100	1,278,997,500	1.33
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	6,737	173,712.25	1,170,299,428	178,100	1,199,859,700	1.25
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	9,583	125,391.9	1,201,630,577	124,200	1,190,208,600	1.24
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,314	143,497.5	1,193,038,215	141,800	1,178,925,200	1.23
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,354	357,956.46	1,200,585,966	350,500	1,175,577,000	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	96.60
合計	96.60

(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	3,292,060,000	3,254,464,000	3.39

(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	58,430,794,465	72.55
	オーストラリア	6,198,721,181	7.70
	イギリス	4,358,554,276	5.41
	シンガポール	3,362,307,457	4.18
	フランス	2,058,801,476	2.56
	カナダ	1,549,254,085	1.92
	香港	1,385,152,372	1.72
	ベルギー	1,157,406,920	1.44
	ニュージーランド	404,376,783	0.50
	スペイン	391,948,739	0.49
	ドイツ	238,098,768	0.30
	ガーンジー	194,212,367	0.24
	オランダ	170,433,162	0.21
	アイルランド	106,996,402	0.13
	イスラエル	65,156,330	0.08
	韓国	64,989,204	0.08
	マン島	20,215,553	0.03
イタリア	15,067,039	0.02	
	小計	80,172,486,579	99.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		360,774,542	0.45
合計(純資産総額)		80,533,261,121	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		39,977,550	0.05
--------	----	--	------------	------

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

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

## 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	466,206	10,348.48	4,824,524,819	10,451.33	4,872,474,619	6.05
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	55,731	77,212.08	4,303,106,815	72,777.02	4,055,936,258	5.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	170,086	14,359.67	2,442,379,818	14,204.87	2,416,051,169	3.00
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	96,138	23,071.89	2,218,085,476	22,858.91	2,197,610,534	2.73
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	205,108	8,230.17	1,688,074,553	8,887.78	1,822,956,729	2.26
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	263,631	6,925.30	1,825,725,715	6,705.06	1,767,661,831	2.19
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	88,926	17,109.64	1,521,492,212	17,440.01	1,550,870,712	1.93
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,050,018	1,535.89	1,612,714,981	1,431.29	1,502,885,618	1.87
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	217,664	6,399.62	1,392,967,758	6,403.77	1,393,872,283	1.73
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	214,906	6,158.59	1,323,519,920	6,150.28	1,321,733,793	1.64
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	74,036	16,006.33	1,185,044,818	16,844.72	1,247,116,030	1.55
香港	投資証券	LINK REIT	1,304,400	844.20	1,101,174,480	917.90	1,197,308,760	1.49
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	235,251	4,867.24	1,145,024,606	4,976.33	1,170,686,844	1.45
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	40,952	26,434.81	1,082,558,360	25,973.53	1,063,668,365	1.32
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	341,671	3,024.23	1,033,294,388	3,104.23	1,060,626,462	1.32
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	353,077	2,866.32	1,012,033,468	2,987.87	1,054,950,436	1.31
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	89,243	9,222.31	823,027,084	10,641.45	949,675,163	1.18
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	235,072	4,016.38	944,140,219	3,988.33	937,546,379	1.16
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	749,570	1,253.87	939,868,957	1,248.88	936,130,252	1.16
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	81,886	11,107.91	909,583,038	11,427.89	935,785,019	1.16
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	71,748	13,049.62	936,284,344	12,882.35	924,283,565	1.15
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	336,303	2,474.65	832,235,514	2,667.89	897,221,159	1.11
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	61,936	14,077.09	871,878,955	14,400.19	891,890,347	1.11
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	109,489	6,931.54	758,927,470	7,260.87	794,985,625	0.99
アメリカ	投資証券	UDR INC	185,727	3,963.40	736,111,042	4,074.56	756,756,882	0.94
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,249,393	185.35	602,285,066	221.50	719,743,149	0.89
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	86,346	5,318.48	459,230,234	7,855.84	678,320,430	0.84
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	330,728	1,993.64	659,355,580	2,033.12	672,412,126	0.83
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	441,054	1,417.05	624,999,805	1,518.87	669,904,483	0.83
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	106,541	6,044.32	643,967,918	6,099.38	649,834,247	0.81

(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、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	99.55
合計	99.55

(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	240,000.00	24,931,200	24,931,200	0.03
	カナダドル	売建	30,000.00	2,398,380	2,398,200	0.00
	イギリスポンド	売建	20,000.00	2,770,700	2,770,800	0.00
	オーストラリアドル	売建	60,000.00	4,614,120	4,614,000	0.01
	香港ドル	売建	45,000.00	603,045	602,550	0.00
	シンガポールドル	売建	60,000.00	4,660,380	4,660,800	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。

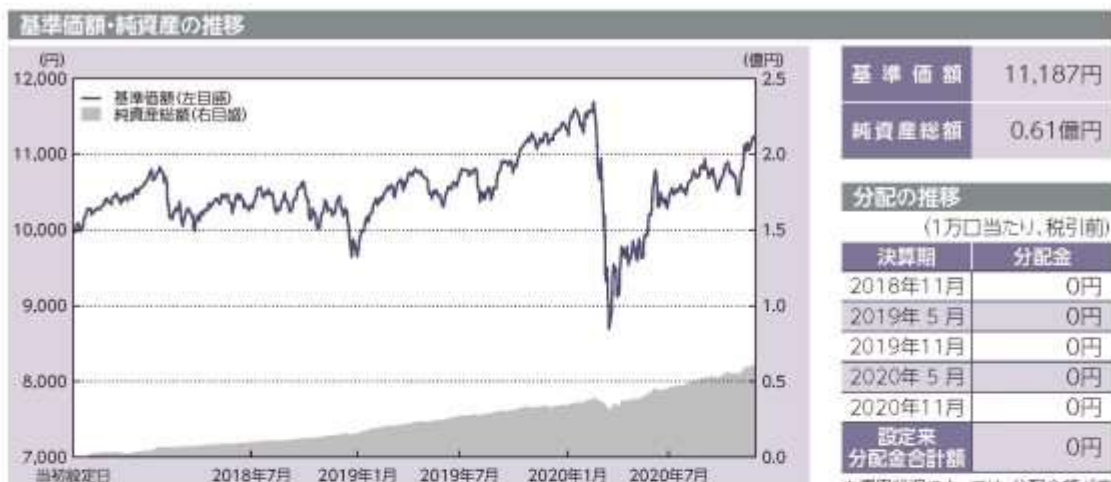
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2017年8月25日  
作成基準日：2020年11月30日



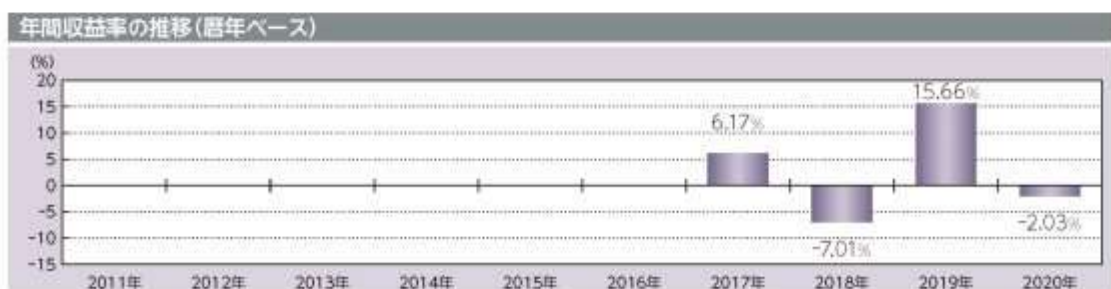
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

※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	上位紹介銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
新興国株式インデックスマザーファンド	13.7%	ALIBABA GROUP HOLDING SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	1.0%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.8%
外国株式インデックスマザーファンド	13.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	ハードウェア・ソフトウェア	-	-	0.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
国内株式インデックスマザーファンド	12.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.4%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.3%
グローバルREITインデックスマザーファンド	12.5%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
新興国債券インデックスマザーファンド	11.6%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.7%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.2%
J-REITインデックスマザーファンド	11.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.8%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
外国債券インデックスマザーファンド	11.4%	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.1%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	10.4%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.1%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル： 0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### (2) 【保管】

該当事項はありません。

### (3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年 8月25日設定）

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

### (4) 【計算期間】

原則として、毎年5月11日から11月10日まで及び11月11日から翌年5月10日までとします。

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

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

## （５）【その他】

### <投資信託契約の終了（償還）と手続き>

#### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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ものを除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2020年5月12日から2020年11月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2020年 5月11日現在)	第7期 (2020年11月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	744,838	662,194
親投資信託受益証券	38,502,325	57,690,708
未収入金	121,588	-
流動資産合計	39,368,751	58,352,902
資産合計	39,368,751	58,352,902
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	299,999	3,066
未払受託者報酬	9,670	13,544
未払委託者報酬	86,928	121,805
その他未払費用	910	1,287
流動負債合計	397,507	139,702
負債合計	397,507	139,702
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	39,427,240	52,643,558
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	455,996	5,569,642
(分配準備積立金)	2,130,143	2,713,476
元本等合計	38,971,244	58,213,200
純資産合計	38,971,244	58,213,200
負債純資産合計	39,368,751	58,352,902

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	2019年11月12日	自	2020年 5月12日
	至	2020年 5月11日	至	2020年11月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,385,151		5,524,578
営業収益合計		4,385,151		5,524,578
営業費用				
支払利息		49		87
受託者報酬		9,670		13,544
委託者報酬		86,928		121,805
その他費用		910		1,287
営業費用合計		97,557		136,723
営業利益又は営業損失（ ）		4,482,708		5,387,855
経常利益又は経常損失（ ）		4,482,708		5,387,855
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,482,708		5,387,855
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（ ）		124,189		193,369
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,404,085		455,996
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,050,485		831,152
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		13,834
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,050,485		817,318
剰余金減少額又は欠損金増加額		552,047		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		552,047		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		455,996		5,569,642

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月11日から11月10日まで、及び11月11日から翌年5月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期計算期間は2020年 5月12日から2020年11月10日までとなっております。

( 貸借対照表に関する注記 )

	第6期 (2020年 5月11日現在)	第7期 (2020年11月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,427,240口	52,643,558口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 455,996円	元本の欠損 - 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9884円 (1万口当たり純資産額) (9,884円)	1口当たり純資産額 1.1058円 (1万口当たり純資産額) (11,058円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第6期 自 2019年11月12日 至 2020年 5月11日			第7期 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	414,140円	費用控除後の配当等収益額	A	654,293円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	57,237円
収益調整金額	C	2,621,485円	収益調整金額	C	4,361,799円
分配準備積立金額	D	1,716,003円	分配準備積立金額	D	2,001,946円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,751,628円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,075,275円
当ファンドの期末残存口数	F	39,427,240口	当ファンドの期末残存口数	F	52,643,558口

第6期 自 2019年11月12日 至 2020年 5月11日			第7期 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日		
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,205円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,343円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第7期 (2020年11月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務



	第7期 (2020年11月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第6期 自 2019年11月12日 至 2020年 5月11日	第7期 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	28,946,438円	39,427,240円
期中追加設定元本額	15,251,653円	16,057,478円
期中一部解約元本額	4,770,851円	2,841,160円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第6期 (2020年 5月11日現在)	第7期 (2020年11月10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	4,261,884	5,417,965
合計	4,261,884	5,417,965

## （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	3,971,619	6,969,794	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	4,344,999	7,316,109	
	新興国株式インデックス マザーファンド	2,570,105	8,133,868	
	国内株式インデックス マザーファンド	4,559,129	7,395,819	
	外国株式インデックス マザーファンド	2,655,944	7,916,837	
	国内債券インデックス マザーファンド	4,400,682	6,200,560	
	外国債券インデックス マザーファンド	2,299,901	6,813,916	
	新興国債券インデックス マザーファンド	4,101,480	6,943,805	
合計		28,903,859	57,690,708	

(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11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,865,719,576
株式	357,655,953,420
派生商品評価勘定	202,487,900
未収入金	940,189,857
未収配当金	3,104,227,107
差入委託証拠金	319,381,300
流動資産合計	364,087,959,160
資産合計	364,087,959,160
負債の部	
流動負債	
前受金	202,512,100
未払解約金	316,808,330
未払利息	2,649
流動負債合計	519,323,079
負債合計	519,323,079
純資産の部	
元本等	
元本	224,126,876,199
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	139,441,759,882
元本等合計	363,568,636,081
純資産合計	363,568,636,081
負債純資産合計	364,087,959,160

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	2020年11月10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。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	224,126,876,199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 1.6222円 (1万口当たり純資産額) (16,222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11月10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11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	211,758,250,803円
期中追加設定元本額	36,939,153,158円
期中一部解約元本額	24,570,527,762円

区分	2020年11月10日現在
期末元本額	224,126,876,199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）	518,939,349円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,060,342,018円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,072,996円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,374,309,604円
世界経済インデックスファンド	2,414,403,128円
日本株式インデックス・オープン	3,945,656,121円
DCマイセレクション25	6,960,292,564円
DCマイセレクション50	19,626,225,010円
DCマイセレクション75	18,181,202,540円
DC日本株式インデックス・オープン	5,864,479,057円
DCマイセレクションS25	2,990,993,032円
DCマイセレクションS50	8,376,123,027円
DCマイセレクションS75	5,439,443,063円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,222,277,452円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	312,185,179円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	702,328,318円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	481,987,285円
DC世界経済インデックスファンド	3,043,211,252円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,716,249,587円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,312,268円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	33,243,911円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	30,422,250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）	247,534,628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）	63,652,039円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	220,773,171円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	46,610,654円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	203,587,697円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,424,637,860円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	620,117,793円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,643,001,277円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	582,600,657円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	34,121,626円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	680,071,635円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	385,822,024円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	478,665,577円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	47,345,667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）	801,313,893円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,431,058,451円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,949,037,625円

区分	2020年11月10日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,539,329,812円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,875,650,640円
分散投資コア戦略ファンドA	2,249,878,534円
分散投資コア戦略ファンドS	7,711,269,663円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	352,233,374円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	361,927,433円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,289,901,715円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,305,452円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,656,942円
SMT インデックスバランス・オープン	65,506,770円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,969,451,259円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	28,007,556円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	89,302,019円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	15,688,651円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,559,129円
グローバル経済コア	251,355,625円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,113,700円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	46,593,417円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,753,974円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,134,640,467円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	120,100,390円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	319,448円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	398,137円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	195,432円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	342,387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）	48,670,580,667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）	1,698,732,767円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	86,618,721円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,189,000円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	611,927,117円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	27,506,708,661
合計	27,506,708,661

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,208,257,900	-	5,410,770,000	202,512,100
合計		5,208,257,900	-	5,410,770,000	202,512,100

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,100	2,793.00	19,830,300	
日本水産	204,000	441.00	89,964,000	
マルハニチロ	29,500	2,317.00	68,351,500	
雪国まいたけ	12,500	1,920.00	24,000,000	
カネコ種苗	6,200	1,584.00	9,820,800	
サカタのタネ	24,300	3,645.00	88,573,500	
ホクト	15,600	2,100.00	32,760,000	
ホクリヨウ	3,200	684.00	2,188,800	
住石ホールディングス	41,200	125.00	5,150,000	
日鉄鉱業	4,700	5,170.00	24,299,000	
三井松島ホールディングス	7,900	733.00	5,790,700	
国際石油開発帝石	750,300	542.00	406,662,600	
石油資源開発	26,700	1,770.00	47,259,000	
K & O エナジーグループ	9,900	1,500.00	14,850,000	
ヒノキヤグループ	5,100	2,232.00	11,383,200	
ショーボンドホールディングス	31,800	5,310.00	168,858,000	
ミライト・ホールディングス	60,600	1,543.00	93,505,800	
タマホーム	11,000	1,451.00	15,961,000	
サンヨーホームズ	1,800	687.00	1,236,600	



日本アクア	8,100	646.00	5,232,600
ファーストコーポレーション	6,200	748.00	4,637,600
ベステラ	3,500	1,441.00	5,043,500
TATERU	38,300	189.00	7,238,700
キャンディル	3,500	613.00	2,145,500
スペースバリューホールディングス	24,900	612.00	15,238,800
ダイセキ環境ソリューション	3,900	697.00	2,718,300
第一カッター興業	2,500	2,273.00	5,682,500
安藤・間	121,500	753.00	91,489,500
東急建設	59,800	508.00	30,378,400
コムシスホールディングス	72,300	3,045.00	220,153,500
ビーアールホールディングス	22,200	761.00	16,894,200
高松コンストラクショングループ	12,700	2,220.00	28,194,000
東建コーポレーション	6,300	8,060.00	50,778,000
ソネック	2,100	852.00	1,789,200
ヤマウラ	8,900	906.00	8,063,400
大成建設	157,100	3,560.00	559,276,000
大林組	471,200	929.00	437,744,800
清水建設	478,200	816.00	390,211,200
飛鳥建設	13,500	1,143.00	15,430,500
長谷工コーポレーション	182,400	1,308.00	238,579,200
松井建設	18,500	735.00	13,597,500
銭高組	2,100	4,715.00	9,901,500
鹿島建設	369,900	1,232.00	455,716,800
不動テトラ	12,300	1,567.00	19,274,100
大末建設	5,400	870.00	4,698,000
鉄建建設	10,200	2,037.00	20,777,400
西松建設	36,300	1,974.00	71,656,200
三井住友建設	113,800	433.00	49,275,400
大豊建設	10,600	3,480.00	36,888,000
前田建設工業	118,000	818.00	96,524,000
佐田建設	10,100	454.00	4,585,400
ナカノフドー建設	12,900	423.00	5,456,700
奥村組	22,200	2,521.00	55,966,200
東鉄工業	20,200	2,883.00	58,236,600
イチケン	3,400	1,676.00	5,698,400
富士ピー・エス	6,900	622.00	4,291,800
浅沼組	5,300	4,125.00	21,862,500
戸田建設	195,700	640.00	125,248,000
熊谷組	21,800	2,536.00	55,284,800
北野建設	2,900	2,595.00	7,525,500
植木組	2,100	2,871.00	6,029,100

矢作建設工業	20,800	917.00	19,073,600
ピーエス三菱	15,500	576.00	8,928,000
日本ハウスホールディングス	32,200	246.00	7,921,200
大東建託	51,400	10,260.00	527,364,000
新日本建設	20,000	941.00	18,820,000
N I P P O	39,000	2,904.00	113,256,000
東亜道路工業	2,900	3,720.00	10,788,000
前田道路	41,600	1,891.00	78,665,600
日本道路	4,600	8,290.00	38,134,000
東亜建設工業	14,700	2,043.00	30,032,100
日本国土開発	45,800	574.00	26,289,200
若築建設	8,500	1,230.00	10,455,000
東洋建設	52,800	418.00	22,070,400
五洋建設	186,800	750.00	140,100,000
世紀東急工業	22,600	862.00	19,481,200
福田組	5,500	5,360.00	29,480,000
住友林業	119,300	1,674.00	199,708,200
日本基礎技術	15,800	459.00	7,252,200
巴コーポレーション	20,900	376.00	7,858,400
大和ハウス工業	466,200	3,087.00	1,439,159,400
ライト工業	27,000	1,575.00	42,525,000
積水ハウス	511,000	1,856.00	948,416,000
日特建設	12,300	812.00	9,987,600
北陸電気工事	8,200	1,290.00	10,578,000
ユアテック	27,000	665.00	17,955,000
日本リーテック	9,900	2,481.00	24,561,900
四電工	2,600	2,394.00	6,224,400
中電工	19,000	2,150.00	40,850,000
関電工	67,000	812.00	54,404,000
きんでん	111,900	1,703.00	190,565,700
東京エネシス	15,600	858.00	13,384,800
トーエネック	4,700	3,605.00	16,943,500
住友電設	13,300	2,818.00	37,479,400
日本電設工業	25,800	2,231.00	57,559,800
協和エクシオ	71,400	2,610.00	186,354,000
新日本空調	12,500	2,302.00	28,775,000
九電工	33,100	3,130.00	103,603,000
三機工業	33,400	1,201.00	40,113,400
日揮ホールディングス	145,000	967.00	140,215,000
中外炉工業	5,100	1,526.00	7,782,600
ヤマト	15,100	755.00	11,400,500
太平電業	11,400	2,375.00	27,075,000

高砂熱学工業	36,000	1,522.00	54,792,000
三晃金属工業	2,000	2,660.00	5,320,000
朝日工業社	3,200	2,980.00	9,536,000
明星工業	30,500	865.00	26,382,500
大気社	22,900	3,020.00	69,158,000
ダイダン	11,300	2,847.00	32,171,100
日比谷総合設備	15,200	1,799.00	27,344,800
フィル・カンパニー	2,700	2,158.00	5,826,600
O S J Bホールディングス	74,300	253.00	18,797,900
東洋エンジニアリング	19,800	327.00	6,474,600
レイズネクスト	25,300	1,216.00	30,764,800
日本製粉	44,100	1,738.00	76,645,800
日清製粉グループ本社	170,400	1,715.00	292,236,000
日東富士製粉	1,100	6,650.00	7,315,000
昭和産業	13,800	3,305.00	45,609,000
鳥越製粉	13,400	1,090.00	14,606,000
中部飼料	18,400	1,504.00	27,673,600
フィード・ワン	20,300	892.00	18,107,600
東洋精糖	2,500	1,279.00	3,197,500
日本甜菜製糖	7,900	1,850.00	14,615,000
三井製糖	13,200	1,859.00	24,538,800
塩水港精糖	16,300	224.00	3,651,200
日新製糖	7,100	1,901.00	13,497,100
森永製菓	35,400	4,320.00	152,928,000
中村屋	3,900	4,220.00	16,458,000
江崎グリコ	41,500	4,380.00	181,770,000
名糖産業	7,200	1,477.00	10,634,400
井村屋グループ	8,500	2,587.00	21,989,500
不二家	9,600	2,425.00	23,280,000
山崎製パン	113,000	1,761.00	198,993,000
第一屋製パン	2,900	1,005.00	2,914,500
モロゾフ	2,600	6,170.00	16,042,000
亀田製菓	8,600	4,870.00	41,882,000
寿スピリッツ	14,500	6,030.00	87,435,000
カルビー	68,700	3,035.00	208,504,500
森永乳業	27,900	4,890.00	136,431,000
六甲バター	10,000	1,822.00	18,220,000
ヤクルト本社	103,700	5,200.00	539,240,000
明治ホールディングス	99,700	7,600.00	757,720,000
雪印メグミルク	36,300	2,375.00	86,212,500
プリマハム	23,600	3,015.00	71,154,000
日本ハム	57,600	4,450.00	256,320,000

林兼産業	5,000	585.00	2,925,000
丸大食品	16,100	1,731.00	27,869,100
S Foods	12,000	3,320.00	39,840,000
柿安本店	5,200	2,564.00	13,332,800
伊藤ハム米久ホールディングス	97,100	705.00	68,455,500
サッポロホールディングス	51,500	2,029.00	104,493,500
アサヒグループホールディングス	329,400	4,049.00	1,333,740,600
キリンホールディングス	639,500	2,182.50	1,395,708,750
宝ホールディングス	111,800	1,181.00	132,035,800
オエノンホールディングス	42,800	440.00	18,832,000
養命酒製造	4,600	1,839.00	8,459,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	115,500	1,645.00	189,997,500
サントリー食品インターナショナル	100,900	3,910.00	394,519,000
ダイトーグループホールディングス	7,700	5,610.00	43,197,000
伊藤園	45,800	7,270.00	332,966,000
キーコーヒー	14,800	2,197.00	32,515,600
ユニカフェ	4,500	1,092.00	4,914,000
ジャパンフーズ	2,100	1,250.00	2,625,000
日清オイリオグループ	19,400	3,045.00	59,073,000
不二製油グループ本社	36,800	3,055.00	112,424,000
かどや製油	1,600	3,840.00	6,144,000
J-オイルミルズ	7,800	3,800.00	29,640,000
キッコーマン	108,500	6,290.00	682,465,000
味の素	333,000	2,180.50	726,106,500
キューピー	84,000	2,246.00	188,664,000
ハウス食品グループ本社	56,400	3,735.00	210,654,000
カゴメ	61,600	3,835.00	236,236,000
焼津水産化学工業	7,300	1,010.00	7,373,000
アリアケジャパン	13,800	7,170.00	98,946,000
ピエトロ	2,000	1,693.00	3,386,000
エバラ食品工業	3,700	2,319.00	8,580,300
やまみ	1,300	2,251.00	2,926,300
ニチレイ	71,800	2,843.00	204,127,400
東洋水産	77,600	5,210.00	404,296,000
イトアンドホールディングス	5,200	1,900.00	9,880,000
大冷	2,000	2,149.00	4,298,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,400	862.00	7,240,800
日清食品ホールディングス	64,100	8,590.00	550,619,000
永谷園ホールディングス	7,400	2,399.00	17,752,600
一正蒲鉾	5,900	1,137.00	6,708,300
フジッコ	16,300	2,025.00	33,007,500
ロック・フィールド	16,200	1,491.00	24,154,200

日本たばこ産業	808,500	2,088.00	1,688,148,000
ケンコーマヨネーズ	8,500	1,880.00	15,980,000
わらべや日洋ホールディングス	9,900	1,512.00	14,968,800
なとり	8,400	2,068.00	17,371,200
イフジ産業	2,600	936.00	2,433,600
ピククルスコーポレーション	3,300	2,870.00	9,471,000
北の達人コーポレーション	52,600	486.00	25,563,600
ユーグレナ	65,200	876.00	57,115,200
ミヨシ油脂	5,300	1,235.00	6,545,500
理研ビタミン	14,200	1,562.00	22,180,400
片倉工業	20,100	1,257.00	25,265,700
ゲンゼ	10,900	3,800.00	41,420,000
東洋紡	58,500	1,434.00	83,889,000
ユニチカ	44,300	371.00	16,435,300
富士紡ホールディングス	7,200	3,615.00	26,028,000
倉敷紡績	14,800	1,866.00	27,616,800
シキボウ	7,700	962.00	7,407,400
日本毛織	48,800	1,083.00	52,850,400
トーア紡コーポレーション	5,800	462.00	2,679,600
帝国繊維	16,800	2,770.00	46,536,000
帝人	120,300	1,720.00	206,916,000
東レ	1,066,300	541.10	576,974,930
サカイオーベックス	4,100	2,147.00	8,802,700
住江織物	3,200	2,174.00	6,956,800
日本フェルト	9,300	484.00	4,501,200
イチカワ	2,400	1,362.00	3,268,800
日東製網	1,700	1,454.00	2,471,800
アツギ	12,500	569.00	7,112,500
ダイニック	5,600	773.00	4,328,800
セーレン	36,400	1,668.00	60,715,200
ソトー	6,100	950.00	5,795,000
東海染工	2,200	1,134.00	2,494,800
小松マテーレ	24,400	920.00	22,448,000
ワコールホールディングス	36,800	2,176.00	80,076,800
ホギメディカル	16,800	3,230.00	54,264,000
T S Iホールディングス	45,500	248.00	11,284,000
マツオカコーポレーション	4,300	2,320.00	9,976,000
ワールド	21,000	1,441.00	30,261,000
三陽商会	7,700	540.00	4,158,000
ナイガイ	5,900	366.00	2,159,400
オンワードホールディングス	89,400	219.00	19,578,600
ルックホールディングス	5,200	1,033.00	5,371,600

ゴールドウイン	26,600	7,240.00	192,584,000
デサント	28,800	1,800.00	51,840,000
キング	7,300	564.00	4,117,200
ヤマトインターナショナル	13,500	342.00	4,617,000
特種東海製紙	9,000	5,080.00	45,720,000
王子ホールディングス	615,100	481.00	295,863,100
日本製紙	65,100	1,245.00	81,049,500
三菱製紙	16,700	336.00	5,611,200
北越コーポレーション	87,700	376.00	32,975,200
中越パルプ工業	6,200	1,355.00	8,401,000
巴川製紙所	4,400	958.00	4,215,200
大王製紙	71,000	1,640.00	116,440,000
阿波製紙	3,800	443.00	1,683,400
レンゴー	139,100	841.00	116,983,100
トーモク	9,000	1,731.00	15,579,000
ザ・パック	11,100	3,110.00	34,521,000
クラレ	231,700	1,048.00	242,821,600
旭化成	975,300	963.00	939,213,900
共和レザー	8,000	624.00	4,992,000
昭和電工	111,700	1,983.00	221,501,100
住友化学	1,081,100	389.00	420,547,900
住友精化	6,500	3,710.00	24,115,000
日産化学	81,200	5,910.00	479,892,000
ラサ工業	5,200	2,092.00	10,878,400
クレハ	12,600	4,735.00	59,661,000
多木化学	5,700	7,000.00	39,900,000
テイカ	10,800	1,453.00	15,692,400
石原産業	26,400	620.00	16,368,000
片倉コープアグリ	3,800	1,236.00	4,696,800
日本曹達	21,800	2,811.00	61,279,800
東ソー	227,500	1,717.00	390,617,500
トクヤマ	42,400	2,338.00	99,131,200
セントラル硝子	30,100	2,259.00	67,995,900
東亜合成	92,400	1,157.00	106,906,800
大阪ソーダ	15,000	2,581.00	38,715,000
関東電化工業	34,900	748.00	26,105,200
デンカ	53,700	3,195.00	171,571,500
信越化学工業	252,700	15,180.00	3,835,986,000
日本カーバイド工業	5,200	1,211.00	6,297,200
堺化学工業	9,500	2,050.00	19,475,000
第一稀元素化学工業	15,900	734.00	11,670,600
エア・ウォーター	136,900	1,573.00	215,343,700

日本酸素ホールディングス	141,400	1,706.00	241,228,400
日本化学工業	4,600	2,620.00	12,052,000
東邦アセチレン	2,200	1,239.00	2,725,800
日本パーカラライジング	74,200	1,102.00	81,768,400
高压ガス工業	23,300	836.00	19,478,800
チタン工業	1,800	1,804.00	3,247,200
四国化成工業	21,500	1,223.00	26,294,500
戸田工業	3,400	2,060.00	7,004,000
ステラ ケミファ	8,000	3,205.00	25,640,000
保土谷化学工業	5,500	4,420.00	24,310,000
日本触媒	22,800	5,280.00	120,384,000
大日精化工業	13,000	2,288.00	29,744,000
カネカ	38,100	3,135.00	119,443,500
三菱瓦斯化学	136,900	1,865.00	255,318,500
三井化学	136,500	2,885.00	393,802,500
J S R	137,100	2,547.00	349,193,700
東京応化工業	25,200	5,980.00	150,696,000
大阪有機化学工業	13,600	2,649.00	36,026,400
三菱ケミカルホールディングス	983,700	587.60	578,022,120
K Hネオケム	24,300	2,675.00	65,002,500
ダイセル	183,700	799.00	146,776,300
住友ベークライト	23,100	3,195.00	73,804,500
積水化学工業	311,200	1,708.00	531,529,600
日本ゼオン	132,700	1,305.00	173,173,500
アイカ工業	44,100	3,810.00	168,021,000
宇部興産	74,300	1,812.00	134,631,600
積水樹脂	26,500	2,327.00	61,665,500
タキロンシーアイ	31,800	692.00	22,005,600
旭有機材	8,300	1,450.00	12,035,000
ニチバン	7,700	1,748.00	13,459,600
リケンテクノス	35,900	434.00	15,580,600
大倉工業	6,900	2,041.00	14,082,900
積水化成成品工業	19,700	608.00	11,977,600
群栄化学工業	3,400	2,595.00	8,823,000
タイガースポリマー	7,700	442.00	3,403,400
ミライアル	5,200	1,231.00	6,401,200
ダイキアクシス	5,200	882.00	4,586,400
ダイキョーニシカワ	31,000	711.00	22,041,000
竹本容器	5,300	922.00	4,886,600
森六ホールディングス	7,900	2,039.00	16,108,100
日本化薬	91,100	936.00	85,269,600
カーリットホールディングス	15,700	563.00	8,839,100

日本精化	11,800	1,534.00	18,101,200
扶桑化学工業	14,900	3,370.00	50,213,000
トリケミカル研究所	3,300	12,170.00	40,161,000
A D E K A	67,700	1,482.00	100,331,400
日油	55,400	4,280.00	237,112,000
新日本理化	24,400	168.00	4,099,200
ハリマ化成グループ	12,200	1,022.00	12,468,400
花王	359,700	7,882.00	2,835,155,400
第一工業製薬	5,500	4,255.00	23,402,500
石原ケミカル	4,000	2,150.00	8,600,000
日華化学	5,000	930.00	4,650,000
ニイタカ	3,000	3,045.00	9,135,000
三洋化成工業	8,800	4,540.00	39,952,000
有機合成薬品工業	11,300	310.00	3,503,000
大日本塗料	16,600	1,005.00	16,683,000
日本ペイントホールディングス	121,400	10,240.00	1,243,136,000
関西ペイント	165,300	2,822.00	466,476,600
神東塗料	11,600	177.00	2,053,200
中国塗料	41,900	1,017.00	42,612,300
日本特殊塗料	11,000	1,021.00	11,231,000
藤倉化成	19,800	522.00	10,335,600
太陽ホールディングス	10,800	5,560.00	60,048,000
D I C	62,100	2,642.00	164,068,200
サカタインクス	32,100	1,120.00	35,952,000
東洋インキ S C ホールディングス	31,100	1,996.00	62,075,600
T & K T O K A	11,400	893.00	10,180,200
富士フイルムホールディングス	288,100	5,421.00	1,561,790,100
資生堂	298,500	7,375.00	2,201,437,500
ライオン	195,300	2,353.00	459,540,900
高砂香料工業	9,400	2,432.00	22,860,800
マンダム	33,800	1,692.00	57,189,600
ミルボン	20,100	5,700.00	114,570,000
ファンケル	60,800	3,655.00	222,224,000
コーセー	28,300	16,040.00	453,932,000
コタ	8,700	1,385.00	12,049,500
シーボン	1,900	1,936.00	3,678,400
ポーラ・オルビスホールディングス	64,100	2,205.00	141,340,500
ノエビアホールディングス	12,700	4,700.00	59,690,000
アジュバンコスメジャパン	3,400	1,017.00	3,457,800
エステー	9,700	2,007.00	19,467,900
アグロ カネショウ	5,600	1,730.00	9,688,000
コニシ	24,700	1,536.00	37,939,200



長谷川香料	25,900	2,136.00	55,322,400
星光PMC	8,600	662.00	5,693,200
小林製薬	42,100	10,940.00	460,574,000
荒川化学工業	13,500	1,162.00	15,687,000
メック	10,300	2,087.00	21,496,100
日本高純度化学	4,100	2,730.00	11,193,000
タカラバイオ	39,300	2,929.00	115,109,700
JCU	18,200	3,355.00	61,061,000
新田ゼラチン	9,400	710.00	6,674,000
OATアグリオ	2,800	1,300.00	3,640,000
デクセリアルズ	38,900	1,152.00	44,812,800
アース製薬	11,100	6,190.00	68,709,000
北興化学工業	14,000	1,125.00	15,750,000
大成ラミック	4,900	2,802.00	13,729,800
クミアイ化学工業	62,100	1,059.00	65,763,900
日本農薬	26,800	519.00	13,909,200
アキレス	10,400	1,633.00	16,983,200
有沢製作所	23,800	967.00	23,014,600
日東電工	103,700	7,660.00	794,342,000
レック	16,000	1,508.00	24,128,000
三光合成	17,200	304.00	5,228,800
きもと	25,500	184.00	4,692,000
藤森工業	13,500	4,380.00	59,130,000
前澤化成工業	9,500	993.00	9,433,500
未来工業	8,100	1,990.00	16,119,000
ウェーブロックホールディングス	5,200	710.00	3,692,000
JSP	8,800	1,521.00	13,384,800
エフピコ	31,600	4,165.00	131,614,000
天馬	10,000	1,918.00	19,180,000
信越ポリマー	27,000	947.00	25,569,000
東リ	37,400	270.00	10,098,000
ニフコ	55,200	3,440.00	189,888,000
バルカー	12,200	1,891.00	23,070,200
ユニ・チャーム	318,600	5,023.00	1,600,327,800
ショーエイコーポレーション	2,200	1,162.00	2,556,400
協和キリン	151,100	2,870.00	433,657,000
武田薬品工業	1,250,100	3,548.00	4,435,354,800
アステラス製薬	1,302,700	1,583.50	2,062,825,450
大日本住友製薬	111,400	1,350.00	150,390,000
塩野義製薬	188,900	5,566.00	1,051,417,400
わかもと製薬	17,900	264.00	4,725,600
あすか製薬	17,100	1,576.00	26,949,600

日本新薬	39,300	7,580.00	297,894,000
ピオフェルミン製薬	2,600	2,465.00	6,409,000
中外製薬	469,900	4,537.00	2,131,936,300
科研製薬	25,700	4,205.00	108,068,500
エーザイ	179,800	7,720.00	1,388,056,000
ロート製薬	77,100	3,465.00	267,151,500
小野薬品工業	345,000	3,227.00	1,113,315,000
久光製薬	39,700	5,620.00	223,114,000
持田製薬	20,800	4,155.00	86,424,000
参天製薬	280,000	1,707.00	477,960,000
扶桑薬品工業	5,300	3,050.00	16,165,000
日本ケミファ	2,000	2,537.00	5,074,000
ツムラ	46,500	3,335.00	155,077,500
日医工	42,600	1,112.00	47,371,200
キッセイ薬品工業	26,600	2,138.00	56,870,800
生化学工業	29,200	1,053.00	30,747,600
栄研化学	26,400	1,994.00	52,641,600
日水製薬	6,300	1,008.00	6,350,400
鳥居薬品	9,400	3,300.00	31,020,000
JCRファーマ	42,300	2,944.00	124,531,200
東和薬品	19,200	2,023.00	38,841,600
富士製薬工業	10,200	1,244.00	12,688,800
沢井製薬	30,900	5,020.00	155,118,000
ゼリア新薬工業	27,300	1,937.00	52,880,100
第一三共	1,289,800	3,337.00	4,304,062,600
キョーリン製薬ホールディングス	33,200	1,922.00	63,810,400
大幸薬品	18,500	1,826.00	33,781,000
ダイト	9,600	4,060.00	38,976,000
大塚ホールディングス	312,300	4,297.00	1,341,953,100
大正製薬ホールディングス	31,800	6,570.00	208,926,000
ペプチドリーム	76,400	5,040.00	385,056,000
日本コークス工業	126,900	71.00	9,009,900
ニチレキ	17,700	1,789.00	31,665,300
ユシロ化学工業	8,400	1,334.00	11,205,600
ビーピー・カストロール	5,400	1,268.00	6,847,200
富士石油	40,100	195.00	7,819,500
MORESCO	5,400	1,020.00	5,508,000
出光興産	166,700	2,220.00	370,074,000
ENEOSホールディングス	2,260,200	372.10	841,020,420
コスモエネルギーホールディングス	43,500	1,670.00	72,645,000
横浜ゴム	87,000	1,591.00	138,417,000
TOYO TIRE	79,100	1,689.00	133,599,900

ブリヂストン	399,500	3,656.00	1,460,572,000
住友ゴム工業	135,000	1,046.00	141,210,000
藤倉コンポジット	13,100	351.00	4,598,100
オカモト	9,100	4,150.00	37,765,000
フコク	6,600	725.00	4,785,000
ニッタ	16,900	2,339.00	39,529,100
住友理工	29,100	553.00	16,092,300
三ツ星ベルト	19,800	1,773.00	35,105,400
バンドー化学	26,400	617.00	16,288,800
日東紡績	22,400	4,090.00	91,616,000
A G C	138,000	3,405.00	469,890,000
日本板硝子	71,900	423.00	30,413,700
石塚硝子	2,800	1,929.00	5,401,200
日本山村硝子	6,500	861.00	5,596,500
日本電気硝子	55,800	2,227.00	124,266,600
オハラ	6,100	1,265.00	7,716,500
住友大阪セメント	28,500	3,455.00	98,467,500
太平洋セメント	95,000	2,638.00	250,610,000
日本ヒューム	15,300	804.00	12,301,200
日本コンクリート工業	33,000	325.00	10,725,000
三谷セキサン	7,000	4,785.00	33,495,000
アジアパイルホールディングス	21,800	473.00	10,311,400
東海カーボン	147,100	1,222.00	179,756,200
日本カーボン	8,300	3,795.00	31,498,500
東洋炭素	8,900	1,821.00	16,206,900
ノリタケカンパニーリミテド	8,400	3,065.00	25,746,000
T O T O	107,400	5,460.00	586,404,000
日本碍子	180,500	1,658.00	299,269,000
日本特殊陶業	114,400	1,897.00	217,016,800
M A R U W A	5,800	10,430.00	60,494,000
品川リフラクトリーズ	4,100	2,255.00	9,245,500
黒崎播磨	3,000	2,984.00	8,952,000
ヨータイ	12,200	824.00	10,052,800
イソライト工業	8,200	467.00	3,829,400
東京窯業	19,700	333.00	6,560,100
ニッカトー	7,100	703.00	4,991,300
フジインコーポレーテッド	13,400	3,460.00	46,364,000
クニミネ工業	6,300	1,110.00	6,993,000
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,093.00	2,732,500
ニチアス	41,200	2,302.00	94,842,400
ニチハ	21,000	3,155.00	66,255,000
日本製鉄	665,000	1,228.50	816,952,500

神戸製鋼所	272,100	492.00	133,873,200
中山製鋼所	20,800	373.00	7,758,400
合同製鐵	8,000	1,880.00	15,040,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	401,300	870.00	349,131,000
東京製鐵	72,400	717.00	51,910,800
共英製鋼	16,800	1,452.00	24,393,600
大和工業	31,600	2,623.00	82,886,800
東京鐵鋼	6,200	2,003.00	12,418,600
大阪製鐵	7,900	1,143.00	9,029,700
淀川製鋼所	20,100	2,055.00	41,305,500
丸一鋼管	48,300	2,500.00	120,750,000
モリ工業	4,500	2,557.00	11,506,500
大同特殊鋼	24,300	3,900.00	94,770,000
日本高周波鋼業	5,700	338.00	1,926,600
日本冶金工業	12,300	1,553.00	19,101,900
山陽特殊製鋼	10,200	1,092.00	11,138,400
愛知製鋼	8,400	2,727.00	22,906,800
日立金属	160,100	1,400.00	224,140,000
日本金属	3,400	644.00	2,189,600
大平洋金属	10,100	1,703.00	17,200,300
新日本電工	96,100	261.00	25,082,100
栗本鐵工所	7,400	1,829.00	13,534,600
虹技	2,300	1,295.00	2,978,500
三菱製鋼	11,100	550.00	6,105,000
日亜鋼業	22,000	320.00	7,040,000
日本精線	2,400	3,545.00	8,508,000
エンビプロ・ホールディングス	6,400	531.00	3,398,400
シンニッタン	23,400	206.00	4,820,400
新家工業	3,400	1,157.00	3,933,800
大紀アルミニウム工業所	24,600	681.00	16,752,600
日本軽金属ホールディングス	37,700	1,778.00	67,030,600
三井金属鉱業	40,100	2,967.00	118,976,700
東邦亜鉛	7,700	2,053.00	15,808,100
三菱マテリアル	98,200	2,036.00	199,935,200
住友金属鉱山	190,000	3,606.00	685,140,000
D O W A ホールディングス	37,600	3,355.00	126,148,000
古河機械金属	26,500	1,158.00	30,687,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,600	860.00	13,416,000
東邦チタニウム	26,800	685.00	18,358,000
U A C J	22,600	1,672.00	37,787,200
C K サンエツ	3,100	3,780.00	11,718,000
古河電気工業	46,200	2,450.00	113,190,000

住友電気工業	555,600	1,326.50	737,003,400
フジクラ	179,400	400.00	71,760,000
昭和電線ホールディングス	17,400	1,367.00	23,785,800
東京特殊電線	2,300	2,407.00	5,536,100
タツタ電線	29,700	582.00	17,285,400
カナレ電気	2,500	1,746.00	4,365,000
平河ヒューテック	7,500	1,097.00	8,227,500
リョービ	18,400	1,267.00	23,312,800
アーレスティ	19,900	332.00	6,606,800
アサヒホールディングス	26,100	3,455.00	90,175,500
稲葉製作所	8,400	1,386.00	11,642,400
宮地エンジニアリンググループ	4,500	2,003.00	9,013,500
トーカロ	41,300	1,121.00	46,297,300
アルファC o	5,200	990.00	5,148,000
SUMCO	190,200	1,644.00	312,688,800
川田テクノロジーズ	3,000	4,525.00	13,575,000
RS Technologies	4,800	3,640.00	17,472,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,755.00	3,755,000
信和	8,500	720.00	6,120,000
東洋製罐グループホールディングス	94,600	1,088.00	102,924,800
ホッカンホールディングス	8,200	1,466.00	12,021,200
コロナ	8,200	992.00	8,134,400
横河ブリッジホールディングス	27,600	1,967.00	54,289,200
駒井ハルテック	2,800	1,545.00	4,326,000
高田機工	1,400	2,505.00	3,507,000
三和ホールディングス	140,100	1,272.00	178,207,200
文化シャッター	43,800	935.00	40,953,000
三協立山	19,100	972.00	18,565,200
アルインコ	10,800	917.00	9,903,600
東洋シャッター	3,600	749.00	2,696,400
LIXILグループ	219,200	2,369.00	519,284,800
日本フィルコン	10,300	548.00	5,644,400
ノーリツ	30,800	1,673.00	51,528,400
長府製作所	15,100	2,161.00	32,631,100
リンナイ	28,900	11,140.00	321,946,000
ダイニチ工業	8,000	783.00	6,264,000
日東精工	18,700	493.00	9,219,100
三洋工業	2,000	1,983.00	3,966,000
岡部	30,100	830.00	24,983,000
ジーテクト	18,400	1,370.00	25,208,000
東プレ	27,700	1,125.00	31,162,500
高周波熱錬	28,600	493.00	14,099,800

東京製綱	10,600	520.00	5,512,000	
サンコール	11,100	439.00	4,872,900	
モリテック スチール	11,600	305.00	3,538,000	
パイオラックス	22,000	1,602.00	35,244,000	
エイチワン	14,600	638.00	9,314,800	
日本発條	159,400	649.00	103,450,600	
中央発條	1,800	2,951.00	5,311,800	
アドバネクス	2,100	1,222.00	2,566,200	
立川ブラインド工業	6,500	1,331.00	8,651,500	
三益半導体工業	11,600	2,562.00	29,719,200	
日本ドライケミカル	3,700	1,497.00	5,538,900	
日本製鋼所	45,100	2,619.00	118,116,900	
三浦工業	64,300	5,230.00	336,289,000	
タクマ	50,400	1,680.00	84,672,000	
ツガミ	30,900	1,507.00	46,566,300	
オークマ	17,300	5,750.00	99,475,000	
芝浦機械	16,900	2,087.00	35,270,300	
アマダ	184,400	948.00	174,811,200	
アイダエンジニアリング	39,100	862.00	33,704,200	
滝澤鉄工所	4,700	995.00	4,676,500	
F U J I	63,900	2,290.00	146,331,000	
牧野フライス製作所	17,500	4,160.00	72,800,000	
オーエスジー	73,400	1,791.00	131,459,400	
ダイジェット工業	1,800	1,440.00	2,592,000	
旭ダイヤモンド工業	39,300	474.00	18,628,200	
D M G 森精機	94,100	1,574.00	148,113,400	
ソディック	32,500	810.00	26,325,000	
ディスコ	20,200	28,720.00	580,144,000	
日東工器	8,200	1,706.00	13,989,200	
日進工具	5,900	2,342.00	13,817,800	
パンチ工業	13,600	503.00	6,840,800	
富士ダイス	6,700	657.00	4,401,900	
豊和工業	8,400	813.00	6,829,200	
O K K	6,100	383.00	2,336,300	
東洋機械金属	10,800	412.00	4,449,600	
津田駒工業	2,900	920.00	2,668,000	
エンシュウ	3,700	965.00	3,570,500	
島精機製作所	23,500	1,700.00	39,950,000	
オプトラン	18,700	2,277.00	42,579,900	
N C ホールディングス	4,600	614.00	2,824,400	
イワキポンプ	9,500	854.00	8,113,000	
フリーー	14,600	1,200.00	17,520,000	

ヤマシンフィルタ	32,400	1,043.00	33,793,200
日阪製作所	18,400	910.00	16,744,000
やまびこ	28,900	1,313.00	37,945,700
平田機工	7,000	6,550.00	45,850,000
ペガサスミシン製造	15,400	298.00	4,589,200
マルマエ	5,600	895.00	5,012,000
タツモ	6,400	1,556.00	9,958,400
ナプテスコ	87,600	4,115.00	360,474,000
三井海洋開発	15,800	1,750.00	27,650,000
レオン自動機	14,600	1,068.00	15,592,800
S M C	47,100	60,300.00	2,840,130,000
ホソカワミクロン	5,200	5,630.00	29,276,000
ユニオンツール	5,600	3,195.00	17,892,000
オイレス工業	19,300	1,587.00	30,629,100
日精エー・エス・ビー機械	4,300	4,290.00	18,447,000
サトーホールディングス	21,200	2,193.00	46,491,600
技研製作所	13,100	3,905.00	51,155,500
日本エアージェット	4,900	1,606.00	7,869,400
カワタ	4,500	826.00	3,717,000
日精樹脂工業	12,600	906.00	11,415,600
オカダアイヨン	4,800	1,009.00	4,843,200
ワイエイシイホールディングス	6,400	670.00	4,288,000
小松製作所	680,600	2,512.00	1,709,667,200
住友重機械工業	86,100	2,557.00	220,157,700
日立建機	60,300	2,838.00	171,131,400
日工	20,700	688.00	14,241,600
巴工業	5,900	1,959.00	11,558,100
井関農機	15,100	1,505.00	22,725,500
T O W A	15,200	1,373.00	20,869,600
丸山製作所	3,200	1,320.00	4,224,000
北川鉄工所	6,900	1,376.00	9,494,400
ローツェ	6,600	4,885.00	32,241,000
タカキタ	5,300	664.00	3,519,200
クボタ	797,200	2,033.50	1,621,106,200
荏原実業	3,800	3,630.00	13,794,000
三菱化工機	5,200	2,025.00	10,530,000
月島機械	27,800	1,304.00	36,251,200
帝国電機製作所	12,400	1,262.00	15,648,800
新東工業	35,900	732.00	26,278,800
澁谷工業	13,200	3,465.00	45,738,000
アイチ コーポレーション	26,100	940.00	24,534,000
小森コーポレーション	38,300	722.00	27,652,600

鶴見製作所	11,600	1,806.00	20,949,600
住友精密工業	2,300	1,959.00	4,505,700
日本ギア工業	6,300	297.00	1,871,100
酒井重工業	2,900	2,404.00	6,971,600
荏原製作所	62,300	3,030.00	188,769,000
石井鐵工所	2,000	2,759.00	5,518,000
西島製作所	15,300	813.00	12,438,900
北越工業	15,600	1,063.00	16,582,800
ダイキン工業	191,400	22,140.00	4,237,596,000
オルガノ	5,400	5,550.00	29,970,000
トーヨーカネツ	6,600	2,248.00	14,836,800
栗田工業	81,400	3,475.00	282,865,000
椿本チエイン	21,500	2,610.00	56,115,000
大同工業	7,400	695.00	5,143,000
木村化工機	12,800	457.00	5,849,600
アネスト岩田	23,500	952.00	22,372,000
ダイフク	76,800	11,340.00	870,912,000
サムコ	3,800	2,684.00	10,199,200
加藤製作所	8,400	1,080.00	9,072,000
油研工業	2,600	1,491.00	3,876,600
タダノ	72,700	792.00	57,578,400
フジテック	54,700	2,150.00	117,605,000
C K D	41,200	1,859.00	76,590,800
キトー	11,400	1,493.00	17,020,200
平和	42,000	1,715.00	72,030,000
理想科学工業	13,300	1,294.00	17,210,200
S A N K Y O	33,500	2,751.00	92,158,500
日本金銭機械	16,800	566.00	9,508,800
マースグループホールディングス	9,600	1,683.00	16,156,800
フクシマガリレイ	9,300	4,355.00	40,501,500
オーイズミ	6,500	384.00	2,496,000
ダイコク電機	7,000	951.00	6,657,000
竹内製作所	25,200	2,407.00	60,656,400
アマノ	39,400	2,585.00	101,849,000
J U K I	20,900	481.00	10,052,900
蛇の目マシン工業	13,800	656.00	9,052,800
マックス	23,000	1,524.00	35,052,000
グローリー	38,600	2,355.00	90,903,000
新晃工業	14,000	1,631.00	22,834,000
大和冷機工業	24,200	1,047.00	25,337,400
セガサミーホールディングス	149,100	1,484.00	221,264,400
日本ピストンリング	5,600	1,057.00	5,919,200



リケン	7,000	2,658.00	18,606,000
T P R	20,300	1,427.00	28,968,100
ツバキ・ナカシマ	28,800	880.00	25,344,000
ホシザキ	47,300	10,310.00	487,663,000
大豊工業	12,400	601.00	7,452,400
日本精工	283,000	901.00	254,983,000
N T N	347,700	229.00	79,623,300
ジェイテクト	144,200	916.00	132,087,200
不二越	14,000	4,415.00	61,810,000
日本トムソン	44,800	383.00	17,158,400
T H K	93,700	3,045.00	285,316,500
ユーシン精機	11,800	739.00	8,720,200
前澤給装工業	5,500	2,261.00	12,435,500
イーグル工業	18,700	895.00	16,736,500
前澤工業	10,200	483.00	4,926,600
日本ピラー工業	15,200	1,561.00	23,727,200
キッツ	61,000	598.00	36,478,000
マキタ	195,900	5,200.00	1,018,680,000
日立造船	119,500	430.00	51,385,000
三菱重工業	251,900	2,465.50	621,059,450
I H I	108,300	1,484.00	160,717,200
スター精密	23,200	1,465.00	33,988,000
日清紡ホールディングス	92,000	747.00	68,724,000
イビデン	92,100	4,155.00	382,675,500
コニカミノルタ	330,500	308.00	101,794,000
ブラザー工業	183,900	1,831.00	336,720,900
ミネベアミツミ	279,200	1,913.00	534,109,600
日立製作所	722,000	3,880.00	2,801,360,000
三菱電機	1,502,500	1,406.00	2,112,515,000
富士電機	90,600	3,535.00	320,271,000
東洋電機製造	5,600	1,166.00	6,529,600
安川電機	161,700	4,440.00	717,948,000
シンフォニアテクノロジー	19,500	1,252.00	24,414,000
明電舎	27,700	1,721.00	47,671,700
オリジン	4,100	1,393.00	5,711,300
山洋電気	7,400	4,770.00	35,298,000
デンヨー	12,800	2,485.00	31,808,000
東芝テック	18,800	4,235.00	79,618,000
芝浦メカトロニクス	2,800	3,615.00	10,122,000
マブチモーター	41,700	4,425.00	184,522,500
日本電産	361,600	11,225.00	4,058,960,000
トレックス・セミコンダクター	9,100	1,383.00	12,585,300

東光高岳	8,900	1,186.00	10,555,400
ダイヘン	16,500	4,200.00	69,300,000
ヤーマン	24,900	1,640.00	40,836,000
JVCケンウッド	126,600	159.00	20,129,400
ミマキエンジニアリング	14,900	500.00	7,450,000
I-PEX	7,300	1,931.00	14,096,300
日新電機	35,300	1,146.00	40,453,800
大崎電気工業	30,100	600.00	18,060,000
オムロン	134,700	7,930.00	1,068,171,000
日東工業	22,100	2,029.00	44,840,900
I D E C	21,800	1,945.00	42,401,000
正興電機製作所	3,900	1,605.00	6,259,500
不二電機工業	3,000	1,300.00	3,900,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	50,500	2,059.00	103,979,500
サクサホールディングス	3,600	1,414.00	5,090,400
メルコホールディングス	5,400	2,837.00	15,319,800
テクノメディカ	3,800	1,598.00	6,072,400
日本電気	182,300	5,740.00	1,046,402,000
富士通	144,800	13,400.00	1,940,320,000
沖電気工業	61,100	969.00	59,205,900
岩崎通信機	6,600	850.00	5,610,000
電気興業	7,300	2,798.00	20,425,400
サンケン電気	16,400	3,700.00	60,680,000
ナカヨ	3,000	1,494.00	4,482,000
アイホン	8,600	1,504.00	12,934,400
ルネサスエレクトロニクス	643,700	923.00	594,135,100
セイコーエプソン	186,500	1,393.00	259,794,500
ワコム	101,800	754.00	76,757,200
アルバック	27,700	4,135.00	114,539,500
アクセル	7,000	941.00	6,587,000
E I Z O	11,700	3,700.00	43,290,000
日本信号	38,400	955.00	36,672,000
京三製作所	35,400	442.00	15,646,800
能美防災	20,100	2,471.00	49,667,100
ホーチキ	11,400	1,298.00	14,797,200
星和電機	8,400	629.00	5,283,600
エレコム	17,300	4,815.00	83,299,500
パナソニック	1,716,600	1,035.50	1,777,539,300
シャープ	173,900	1,170.00	203,463,000
アンリツ	96,800	2,333.00	225,834,400
富士通ゼネラル	40,800	3,165.00	129,132,000
ソニー	941,200	8,920.00	8,395,504,000

TDK	72,600	13,100.00	951,060,000
帝国通信工業	7,200	1,171.00	8,431,200
タムラ製作所	50,400	527.00	26,560,800
アルプスアルパイン	133,400	1,562.00	208,370,800
池上通信機	4,800	815.00	3,912,000
鈴木	8,300	711.00	5,901,300
日本トリム	2,200	3,670.00	8,074,000
ローランド ディー・ジー	9,400	1,335.00	12,549,000
フォスター電機	15,900	1,236.00	19,652,400
SMK	3,900	2,886.00	11,255,400
ヨコオ	10,000	2,757.00	27,570,000
ホシデン	41,700	890.00	37,113,000
ヒロセ電機	23,200	14,310.00	331,992,000
日本航空電子工業	34,500	1,499.00	51,715,500
TOA	16,200	931.00	15,082,200
マクセルホールディングス	32,900	1,151.00	37,867,900
古野電気	19,900	1,191.00	23,700,900
ユニデンホールディングス	4,200	2,008.00	8,433,600
スミダコーポレーション	13,400	1,000.00	13,400,000
アイコム	8,400	2,997.00	25,174,800
リオン	6,600	2,492.00	16,447,200
本多通信工業	14,200	470.00	6,674,000
横河電機	137,900	1,781.00	245,599,900
新電元工業	5,400	2,348.00	12,679,200
アズビル	94,800	4,455.00	422,334,000
東亜ディーケーケー	8,200	864.00	7,084,800
日本光電工業	62,300	3,560.00	221,788,000
チノー	5,300	1,388.00	7,356,400
共和電業	16,000	433.00	6,928,000
日本電子材料	6,000	1,610.00	9,660,000
堀場製作所	29,800	5,900.00	175,820,000
アドバンテスト	111,700	6,480.00	723,816,000
小野測器	7,500	525.00	3,937,500
エスペック	13,700	1,806.00	24,742,200
キーエンス	136,100	51,760.00	7,044,536,000
日置電機	7,400	3,915.00	28,971,000
シスメックス	107,500	10,330.00	1,110,475,000
日本マイクロニクス	26,700	1,088.00	29,049,600
メガチップス	14,200	2,731.00	38,780,200
OBARA GROUP	8,900	3,480.00	30,972,000
澤藤電機	2,200	1,820.00	4,004,000
原田工業	7,800	884.00	6,895,200

コーセル	20,600	1,050.00	21,630,000
イリソ電子工業	12,800	4,755.00	60,864,000
オブテックスグループ	25,000	1,699.00	42,475,000
千代田インテグレ	6,700	1,695.00	11,356,500
アイ・オー・データ機器	5,400	1,079.00	5,826,600
レーザーテック	66,000	9,280.00	612,480,000
スタンレー電気	105,500	3,035.00	320,192,500
岩崎電気	6,300	1,351.00	8,511,300
ウシオ電機	83,400	1,279.00	106,668,600
岡谷電機産業	13,600	363.00	4,936,800
ハリオス テクノ ホールディング	15,900	317.00	5,040,300
エノモト	5,100	1,147.00	5,849,700
日本セラミック	15,500	2,733.00	42,361,500
遠藤照明	8,600	578.00	4,970,800
古河電池	11,300	1,201.00	13,571,300
双信電機	8,800	416.00	3,660,800
山一電機	11,300	1,378.00	15,571,400
図研	10,000	2,677.00	26,770,000
日本電子	29,800	3,610.00	107,578,000
カシオ計算機	133,000	1,832.00	243,656,000
ファナック	141,300	23,350.00	3,299,355,000
日本シイエムケイ	36,700	472.00	17,322,400
エンプラス	7,900	2,280.00	18,012,000
大真空	5,800	2,001.00	11,605,800
ローム	62,500	8,390.00	524,375,000
浜松ホトニクス	107,900	5,490.00	592,371,000
三井ハイテック	16,900	2,257.00	38,143,300
新光電気工業	50,800	1,810.00	91,948,000
京セラ	211,500	5,975.00	1,263,712,500
太陽誘電	67,000	3,945.00	264,315,000
村田製作所	441,400	7,563.00	3,338,308,200
双葉電子工業	24,500	930.00	22,785,000
北陸電気工業	6,700	929.00	6,224,300
ニチコン	51,700	923.00	47,719,100
日本ケミコン	11,600	1,498.00	17,376,800
K O A	23,200	1,335.00	30,972,000
市光工業	23,800	473.00	11,257,400
小糸製作所	90,100	5,590.00	503,659,000
ミツバ	27,600	478.00	13,192,800
S C R E E Nホールディングス	26,100	6,030.00	157,383,000
キヤノン電子	14,200	1,493.00	21,200,600
キヤノン	746,600	1,932.00	1,442,431,200

リコー	382,400	720.00	275,328,000
象印マホービン	41,000	1,975.00	80,975,000
MUTOHホールディングス	2,300	1,492.00	3,431,600
東京エレクトロン	95,300	29,470.00	2,808,491,000
トヨタ紡織	43,800	1,530.00	67,014,000
芦森工業	3,200	891.00	2,851,200
ユニプレス	29,200	909.00	26,542,800
豊田自動織機	121,600	6,960.00	846,336,000
モリタホールディングス	26,300	1,987.00	52,258,100
三櫻工業	19,200	634.00	12,172,800
デンソー	330,800	5,079.00	1,680,133,200
東海理化電機製作所	39,600	1,666.00	65,973,600
三井E & Sホールディングス	54,300	383.00	20,796,900
川崎重工業	116,900	1,599.00	186,923,100
名村造船所	48,300	152.00	7,341,600
日本車輛製造	5,500	2,452.00	13,486,000
三菱ロジスネクスト	19,900	1,002.00	19,939,800
近畿車輛	2,300	1,308.00	3,008,400
日産自動車	1,771,900	411.00	728,250,900
いすゞ自動車	435,300	958.00	417,017,400
トヨタ自動車	1,676,400	7,267.00	12,182,398,800
日野自動車	187,600	888.00	166,588,800
三菱自動車工業	556,100	203.00	112,888,300
エフテック	10,600	575.00	6,095,000
レシップホールディングス	5,900	555.00	3,274,500
G M B	2,800	615.00	1,722,000
ファルテック	2,800	627.00	1,755,600
武蔵精密工業	33,500	1,343.00	44,990,500
日産車体	29,300	972.00	28,479,600
新明和工業	40,500	842.00	34,101,000
極東開発工業	27,900	1,409.00	39,311,100
トピー工業	12,400	1,222.00	15,152,800
ティラド	5,500	1,340.00	7,370,000
曙ブレーキ工業	82,500	145.00	11,962,500
タチエス	24,700	1,162.00	28,701,400
N O K	80,800	1,318.00	106,494,400
フタバ産業	42,000	526.00	22,092,000
K Y B	16,800	2,382.00	40,017,600
大同メタル工業	29,000	567.00	16,443,000
プレス工業	74,700	314.00	23,455,800
ミクニ	19,400	290.00	5,626,000
太平洋工業	31,500	1,077.00	33,925,500

河西工業	20,500	385.00	7,892,500
アイシン精機	123,700	3,245.00	401,406,500
マツダ	442,100	635.00	280,733,500
今仙電機製作所	14,100	759.00	10,701,900
本田技研工業	1,182,900	2,927.50	3,462,939,750
スズキ	297,800	5,037.00	1,500,018,600
S U B A R U	466,400	2,208.50	1,030,044,400
安永	7,300	1,155.00	8,431,500
ヤマハ発動機	212,300	1,895.00	402,308,500
T B K	18,000	458.00	8,244,000
エクセディ	20,500	1,364.00	27,962,000
豊田合成	48,500	2,774.00	134,539,000
愛三工業	23,700	495.00	11,731,500
盟和産業	2,400	891.00	2,138,400
日本プラスト	12,000	461.00	5,532,000
ヨロズ	14,100	1,238.00	17,455,800
エフ・シー・シー	24,600	2,069.00	50,897,400
シマノ	56,200	22,650.00	1,272,930,000
テイ・エス テック	34,900	3,120.00	108,888,000
ジャムコ	7,500	677.00	5,077,500
テルモ	425,200	4,213.00	1,791,367,600
クリエートメディック	5,000	1,019.00	5,095,000
日機装	48,500	1,063.00	51,555,500
日本エム・ディ・エム	8,700	2,226.00	19,366,200
島津製作所	179,500	3,485.00	625,557,500
J M S	12,700	828.00	10,515,600
長野計器	10,900	815.00	8,883,500
ブイ・テクノロジー	7,000	4,920.00	34,440,000
東京計器	9,600	912.00	8,755,200
愛知時計電機	2,000	4,440.00	8,880,000
インターアクション	8,100	1,807.00	14,636,700
オーバル	13,600	235.00	3,196,000
東京精密	27,200	3,760.00	102,272,000
マニー	59,900	2,887.00	172,931,300
ニコン	229,500	729.00	167,305,500
トプコン	75,700	1,242.00	94,019,400
オリンパス	831,300	2,217.00	1,842,992,100
理研計器	13,300	2,992.00	39,793,600
タムロン	12,100	1,645.00	19,904,500
H O Y A	298,100	12,505.00	3,727,740,500
シード	6,400	627.00	4,012,800
ノーリツ鋼機	10,100	1,932.00	19,513,200

エー・アンド・デイ	13,800	813.00	11,219,400
朝日インテック	170,200	3,395.00	577,829,000
シチズン時計	176,100	303.00	53,358,300
リズム	4,800	649.00	3,115,200
大研医器	10,500	529.00	5,554,500
メニコン	21,300	7,350.00	156,555,000
シンシア	1,700	399.00	678,300
松風	6,800	1,648.00	11,206,400
セイコーホールディングス	21,300	1,438.00	30,629,400
ニプロ	104,000	1,192.00	123,968,000
中本パックス	3,800	1,578.00	5,996,400
スノーピーク	8,900	1,830.00	16,287,000
パラマウントベッドホールディングス	15,800	4,545.00	71,811,000
トランザクション	8,200	940.00	7,708,000
粧美堂	4,400	359.00	1,579,600
ニホンフラッシュ	14,000	1,316.00	18,424,000
前田工織	16,600	2,866.00	47,575,600
永大産業	19,600	310.00	6,076,000
アートネイチャー	16,000	662.00	10,592,000
バンダイナムコホールディングス	155,300	8,267.00	1,283,865,100
アイフィスジャパン	3,800	760.00	2,888,000
共立印刷	25,100	130.00	3,263,000
S H O E I	13,100	3,160.00	41,396,000
フランスベッドホールディングス	21,200	894.00	18,952,800
パイロットコーポレーション	26,600	3,150.00	83,790,000
萩原工業	8,300	1,611.00	13,371,300
トッパン・フォームズ	32,200	1,004.00	32,328,800
フジシールインターナショナル	33,700	2,143.00	72,219,100
タカラトミー	67,400	983.00	66,254,200
廣済堂	10,500	636.00	6,678,000
エステールホールディングス	4,000	616.00	2,464,000
タカノ	5,900	615.00	3,628,500
プロネクサス	12,900	1,148.00	14,809,200
ホクシン	9,300	116.00	1,078,800
ウッドワン	5,000	1,151.00	5,755,000
大建工業	10,100	2,031.00	20,513,100
凸版印刷	212,100	1,462.00	310,090,200
大日本印刷	196,600	2,185.00	429,571,000
共同印刷	4,600	2,800.00	12,880,000
N I S S H A	30,800	1,250.00	38,500,000
光村印刷	1,300	1,630.00	2,119,000
T A K A R A & C O M P A N Y	7,200	1,997.00	14,378,400

アシックス	132,900	1,763.00	234,302,700
ツツミ	4,700	2,290.00	10,763,000
小松ウオール工業	4,600	1,761.00	8,100,600
ヤマハ	89,400	5,490.00	490,806,000
河合楽器製作所	4,600	2,683.00	12,341,800
クリナップ	14,000	476.00	6,664,000
ピジョン	96,500	4,400.00	424,600,000
オリバー	3,200	2,468.00	7,897,600
兼松サステック	1,000	1,616.00	1,616,000
キングジム	12,500	906.00	11,325,000
リンテック	35,700	2,334.00	83,323,800
イトーキ	29,800	339.00	10,102,200
任天堂	92,100	54,010.00	4,974,321,000
三菱鉛筆	24,700	1,527.00	37,716,900
タカラスタANDARD	31,000	1,479.00	45,849,000
コクヨ	72,100	1,418.00	102,237,800
ナカバヤシ	14,800	609.00	9,013,200
グローブライド	6,700	3,600.00	24,120,000
オカムラ	52,400	878.00	46,007,200
美津濃	13,600	1,922.00	26,139,200
東京電力ホールディングス	1,199,400	296.00	355,022,400
中部電力	459,700	1,270.00	583,819,000
関西電力	569,200	1,004.00	571,476,800
中国電力	216,700	1,387.00	300,562,900
北陸電力	137,400	800.00	109,920,000
東北電力	375,300	960.00	360,288,000
四国電力	135,300	796.00	107,698,800
九州電力	309,700	915.00	283,375,500
北海道電力	140,600	425.00	59,755,000
沖縄電力	29,200	1,605.00	46,866,000
電源開発	119,500	1,542.00	184,269,000
エフオン	8,100	912.00	7,387,200
イーレックス	21,400	1,293.00	27,670,200
レノバ	25,200	1,755.00	44,226,000
東京瓦斯	288,900	2,532.00	731,494,800
大阪瓦斯	291,500	2,103.00	613,024,500
東邦瓦斯	73,900	5,750.00	424,925,000
北海道瓦斯	8,100	1,575.00	12,757,500
広島ガス	30,900	384.00	11,865,600
西部瓦斯	16,900	2,769.00	46,796,100
静岡ガス	42,600	1,000.00	42,600,000
メタウォーター	14,500	2,411.00	34,959,500



SBSホールディングス	11,100	2,404.00	26,684,400	
東武鉄道	156,600	3,410.00	534,006,000	
相鉄ホールディングス	48,100	2,794.00	134,391,400	
東急	378,900	1,448.00	548,647,200	
京浜急行電鉄	192,900	1,705.00	328,894,500	
小田急電鉄	223,500	2,922.00	653,067,000	
京王電鉄	78,000	7,050.00	549,900,000	
京成電鉄	104,600	3,585.00	374,991,000	
富士急行	20,500	5,100.00	104,550,000	
新京成電鉄	3,900	2,262.00	8,821,800	
東日本旅客鉄道	264,400	6,386.00	1,688,458,400	
西日本旅客鉄道	133,900	5,217.00	698,556,300	
東海旅客鉄道	124,900	14,775.00	1,845,397,500	
西武ホールディングス	196,100	1,250.00	245,125,000	
鴻池運輸	23,900	1,171.00	27,986,900	
西日本鉄道	41,600	3,110.00	129,376,000	
ハマキョウレックス	11,500	3,150.00	36,225,000	
サカイ引越センター	7,900	5,040.00	39,816,000	
近鉄グループホールディングス	142,300	4,800.00	683,040,000	
阪急阪神ホールディングス	189,800	3,635.00	689,923,000	
南海電気鉄道	67,400	2,693.00	181,508,200	
京阪ホールディングス	63,400	4,415.00	279,911,000	
神戸電鉄	3,400	3,795.00	12,903,000	
名古屋鉄道	117,000	3,030.00	354,510,000	
山陽電気鉄道	10,200	2,189.00	22,327,800	
日本通運	49,300	6,940.00	342,142,000	
ヤマトホールディングス	249,400	2,480.00	618,512,000	
山九	39,500	4,070.00	160,765,000	
丸運	8,100	247.00	2,000,700	
丸全昭和運輸	11,500	3,250.00	37,375,000	
センコーグループホールディングス	78,400	987.00	77,380,800	
トナミホールディングス	3,400	6,360.00	21,624,000	
ニッコンホールディングス	50,900	2,143.00	109,078,700	
日本石油輸送	1,600	2,582.00	4,131,200	
福山通運	18,200	4,950.00	90,090,000	
セイノーホールディングス	106,600	1,430.00	152,438,000	
エスライン	4,300	1,007.00	4,330,100	
神奈川中央交通	3,500	3,990.00	13,965,000	
日立物流	26,100	3,490.00	91,089,000	
丸和運輸機関	15,000	4,250.00	63,750,000	
C & F ロジホールディングス	14,400	1,804.00	25,977,600	
九州旅客鉄道	124,700	2,441.00	304,392,700	

S Gホールディングス	298,700	2,530.00	755,711,000
日本郵船	119,600	2,031.00	242,907,600
商船三井	90,500	2,518.00	227,879,000
川崎汽船	43,800	1,479.00	64,780,200
N Sユナイテッド海運	8,600	1,441.00	12,392,600
飯野海運	70,600	392.00	27,675,200
共栄タンカー	4,100	790.00	3,239,000
乾汽船	8,200	909.00	7,453,800
日本航空	251,600	1,989.00	500,432,400
A N Aホールディングス	260,100	2,660.00	691,866,000
パスコ	2,800	1,319.00	3,693,200
ランコム	4,000	8,000.00	32,000,000
日新	12,300	1,591.00	19,569,300
三菱倉庫	45,100	3,185.00	143,643,500
三井倉庫ホールディングス	16,200	1,992.00	32,270,400
住友倉庫	51,200	1,371.00	70,195,200
澁澤倉庫	7,800	2,183.00	17,027,400
東陽倉庫	25,700	363.00	9,329,100
日本トランスシティ	31,300	550.00	17,215,000
ケイヒン	2,700	1,376.00	3,715,200
中央倉庫	8,700	1,206.00	10,492,200
川西倉庫	2,600	1,117.00	2,904,200
安田倉庫	11,700	977.00	11,430,900
ファイズホールディングス	3,000	1,073.00	3,219,000
東洋埠頭	4,300	1,459.00	6,273,700
宇徳	12,200	515.00	6,283,000
上組	79,400	1,981.00	157,291,400
サンリツ	3,400	655.00	2,227,000
キムラユニティー	3,800	1,040.00	3,952,000
キューソー流通システム	3,500	1,741.00	6,093,500
近鉄エクスプレス	30,200	2,388.00	72,117,600
東海運	8,100	309.00	2,502,900
エーアイティー	10,000	1,035.00	10,350,000
内外トランスライン	5,000	1,247.00	6,235,000
日本コンセプト	4,500	1,607.00	7,231,500
N E C ネットエスアイ	42,000	1,871.00	78,582,000
クロスキャット	4,100	1,364.00	5,592,400
システナ	52,700	1,977.00	104,187,900
デジタルアーツ	7,300	9,120.00	66,576,000
日鉄ソリューションズ	22,200	3,180.00	70,596,000
キューブシステム	8,100	1,409.00	11,412,900
エイジア	2,800	1,895.00	5,306,000

コア	6,500	1,366.00	8,879,000
ラクーンホールディングス	7,200	2,013.00	14,493,600
ソリトンシステムズ	7,500	2,037.00	15,277,500
ソフトクリエイティブホールディングス	6,500	3,685.00	23,952,500
T I S	147,600	2,213.00	326,638,800
J N S ホールディングス	5,900	646.00	3,811,400
電算システム	5,600	3,250.00	18,200,000
グリー	90,900	566.00	51,449,400
コーエーテクモホールディングス	30,200	4,880.00	147,376,000
三菱総合研究所	6,400	4,205.00	26,912,000
電算	1,800	2,347.00	4,224,600
A G S	8,700	902.00	7,847,400
ファインデックス	12,600	1,311.00	16,518,600
ブレインパッド	3,900	4,150.00	16,185,000
K L a b	26,800	949.00	25,433,200
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	18,100	951.00	17,213,100
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	2,729.00	6,003,800
ネクソン	372,000	2,799.00	1,041,228,000
アイスタイル	42,100	490.00	20,629,000
エムアップホールディングス	4,400	2,480.00	10,912,000
エイチーム	10,500	886.00	9,303,000
エニグモ	14,100	1,248.00	17,596,800
テクノスジャパン	11,800	757.00	8,932,600
コロプラ	48,700	927.00	45,144,900
ブロードリーフ	73,600	602.00	44,307,200
クロス・マーケティンググループ	7,400	354.00	2,619,600
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,084.00	8,780,400
システム情報	11,300	1,243.00	14,045,900
メディアドゥ	4,800	6,620.00	31,776,000
じげん	37,400	348.00	13,015,200
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	856.00	3,081,600
サイバーリンクス	2,500	4,035.00	10,087,500
フィックスターズ	16,000	1,039.00	16,624,000
C A R T A H O L D I N G S	6,200	1,417.00	8,785,400
オブティム	7,800	3,060.00	23,868,000
セレス	5,000	1,974.00	9,870,000
S H I F T	6,000	13,600.00	81,600,000
ティーガイア	13,200	1,885.00	24,882,000
セック	2,200	2,977.00	6,549,400
日本アジアグループ	15,500	599.00	9,284,500
テクマトリックス	20,900	1,871.00	39,103,900
プロシップ	4,500	1,543.00	6,943,500

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	35,600	2,456.00	87,433,600
GMOペイメントゲートウェイ	31,200	13,460.00	419,952,000
ザップラス	7,000	435.00	3,045,000
システムリサーチ	4,100	1,687.00	6,916,700
インターネットイニシアティブ	21,900	4,865.00	106,543,500
さくらインターネット	16,200	750.00	12,150,000
ヴィンクス	4,400	1,247.00	5,486,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	10,210.00	33,693,000
SRAホールディングス	7,900	2,444.00	19,307,600
システムインテグレータ	5,100	714.00	3,641,400
朝日ネット	10,800	938.00	10,130,400
eBASE	17,900	1,007.00	18,025,300
アバント	14,300	1,090.00	15,587,000
アドソル日進	5,300	2,687.00	14,241,100
フリービット	8,000	887.00	7,096,000
コムチュア	16,700	2,745.00	45,841,500
サイバーコム	2,800	1,798.00	5,034,400
アステリア	9,400	786.00	7,388,400
アイル	8,400	1,363.00	11,449,200
マークライنز	6,300	2,379.00	14,987,700
メディカル・データ・ビジョン	16,900	2,351.00	39,731,900
gumi	19,300	856.00	16,520,800
ショーケース	3,500	792.00	2,772,000
モバイルファクトリー	3,600	1,081.00	3,891,600
テラスカイ	5,400	4,570.00	24,678,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,000	1,372.00	8,232,000
PCIホールディングス	5,800	1,137.00	6,594,600
パイプドHD	2,100	1,715.00	3,601,500
アイビーシー	2,700	1,059.00	2,859,300
ネオジャパン	2,900	2,359.00	6,841,100
PR TIMES	2,600	3,215.00	8,359,000
ランドコンピュータ	2,500	1,140.00	2,850,000
ダブルスタンダード	2,000	4,685.00	9,370,000
オープンドア	7,500	1,374.00	10,305,000
マイネット	4,800	1,156.00	5,548,800
アカツキ	5,300	4,960.00	26,288,000
ベネフィットジャパン	1,300	1,734.00	2,254,200
Ubicomホールディングス	3,400	2,725.00	9,265,000
LINE	34,200	5,360.00	183,312,000
カナミックネットワーク	13,900	799.00	11,106,100
ノムラシステムコーポレーション	7,200	421.00	3,031,200
チェンジ	10,300	8,940.00	92,082,000

シンクロ・フード	7,300	328.00	2,394,400
オークネット	8,000	1,499.00	11,992,000
セグエグループ	4,000	1,394.00	5,576,000
エイトレッド	2,600	2,627.00	6,830,200
AOI TYO Holdings	15,700	414.00	6,499,800
マクロミル	30,600	708.00	21,664,800
ビーグリー	3,000	2,034.00	6,102,000
オロ	4,700	3,590.00	16,873,000
ユーザーローカル	1,500	4,530.00	6,795,000
テモナ	3,400	1,214.00	4,127,600
ニーズウェル	3,100	841.00	2,607,100
サインポスト	3,400	972.00	3,304,800
ソルクシーズ	5,900	1,067.00	6,295,300
フェイス	5,500	947.00	5,208,500
プロトコーポレーション	13,500	1,167.00	15,754,500
ハイマックス	3,700	1,185.00	4,384,500
野村総合研究所	209,100	3,335.00	697,348,500
サイバネットシステム	10,800	858.00	9,266,400
CEホールディングス	8,300	644.00	5,345,200
日本システム技術	2,500	1,711.00	4,277,500
インターージホールディングス	18,700	1,088.00	20,345,600
東邦システムサイエンス	4,200	915.00	3,843,000
ソースネクスト	70,900	312.00	22,120,800
インフォコム	16,200	3,705.00	60,021,000
HEROZ	2,200	3,150.00	6,930,000
ラクスル	11,900	5,190.00	61,761,000
FIG	17,100	273.00	4,668,300
システムサポート	3,600	1,546.00	5,565,600
イーソル	8,200	1,315.00	10,783,000
アルテリア・ネットワークス	16,500	1,709.00	28,198,500
東海ソフト	1,300	1,106.00	1,437,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,486.00	4,012,200
東名	1,000	1,275.00	1,275,000
ヴィッツ	700	2,658.00	1,860,600
トビラシステムズ	1,600	1,510.00	2,416,000
Link-U	1,100	1,671.00	1,838,100
フォーカスシステムズ	9,400	919.00	8,638,600
クレスコ	9,200	1,305.00	12,006,000
フジ・メディア・ホールディングス	142,300	1,058.00	150,553,400
オービック	51,100	19,950.00	1,019,445,000
ジャストシステム	24,000	7,510.00	180,240,000
TDCソフト	13,200	1,043.00	13,767,600

Zホールディングス	2,025,100	613.20	1,241,791,320
トレンドマイクロ	78,700	6,130.00	482,431,000
IDホールディングス	5,800	1,316.00	7,632,800
日本オラクル	29,900	11,540.00	345,046,000
アルファシステムズ	4,700	3,320.00	15,604,000
フューチャー	18,000	1,748.00	31,464,000
CAC Holdings	9,800	1,372.00	13,445,600
SBテクノロジー	5,400	3,640.00	19,656,000
トーセ	4,300	885.00	3,805,500
オービックビジネスコンサルタント	15,100	5,850.00	88,335,000
伊藤忠テクノソリューションズ	67,300	3,755.00	252,711,500
アイティフォー	18,200	907.00	16,507,400
東計電算	2,300	4,300.00	9,890,000
エクスネット	2,600	1,024.00	2,662,400
大塚商会	79,800	5,260.00	419,748,000
サイボウズ	17,300	3,065.00	53,024,500
ソフトブレーン	11,900	868.00	10,329,200
電通国際情報サービス	9,200	5,550.00	51,060,000
ACCESS	14,200	789.00	11,203,800
デジタルガレージ	26,600	3,970.00	105,602,000
EMシステムズ	21,200	800.00	16,960,000
ウェザーニューズ	5,000	5,680.00	28,400,000
CIJ	10,300	996.00	10,258,800
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,580.00	6,444,000
日本エンタープライズ	16,300	230.00	3,749,000
WOWOW	7,200	2,804.00	20,188,800
スカラ	10,100	915.00	9,241,500
インテリジェント ウェイブ	9,000	733.00	6,597,000
IMAGICA GROUP	13,300	407.00	5,413,100
ネットワンシステムズ	56,200	3,550.00	199,510,000
システムソフト	34,900	96.00	3,350,400
アルゴグラフィックス	12,600	3,310.00	41,706,000
マーベラス	22,900	740.00	16,946,000
エイベックス	25,600	1,036.00	26,521,600
日本ユニシス	46,100	3,520.00	162,272,000
兼松エレクトロニクス	8,100	4,390.00	35,559,000
都築電気	4,900	1,510.00	7,399,000
TBSホールディングス	89,800	1,739.00	156,162,200
日本テレビホールディングス	123,300	1,165.00	143,644,500
朝日放送グループホールディングス	15,100	702.00	10,600,200
テレビ朝日ホールディングス	40,700	1,672.00	68,050,400
スカパーJ SATホールディングス	97,600	481.00	46,945,600

テレビ東京ホールディングス	12,200	2,488.00	30,353,600
日本BS放送	5,300	1,080.00	5,724,000
ビジョン	18,600	1,139.00	21,185,400
スマートバリュー	4,100	1,184.00	4,854,400
ワイヤレスゲート	6,500	636.00	4,134,000
コネクシオ	8,600	1,225.00	10,535,000
クロップス	3,100	820.00	2,542,000
日本電信電話	1,970,900	2,433.00	4,795,199,700
KDDI	1,074,900	3,050.00	3,278,445,000
ソフトバンク	1,340,100	1,225.00	1,641,622,500
光通信	15,200	25,430.00	386,536,000
NTTドコモ	1,054,300	3,890.00	4,101,227,000
エムティーアイ	14,600	862.00	12,585,200
GMOインターネット	52,900	2,847.00	150,606,300
ファイバーゲート	4,900	1,899.00	9,305,100
アйдママーケティングコミュニケーション	5,200	405.00	2,106,000
KADOKAWA	39,800	3,185.00	126,763,000
学研ホールディングス	20,000	1,454.00	29,080,000
ゼンリン	29,600	1,300.00	38,480,000
昭文社ホールディングス	7,400	499.00	3,692,600
インプレスホールディングス	12,200	176.00	2,147,200
アイネット	7,800	1,507.00	11,754,600
松竹	9,800	13,530.00	132,594,000
東宝	87,100	4,520.00	393,692,000
東映	5,500	17,610.00	96,855,000
エヌ・ティ・ティ・データ	392,800	1,358.00	533,422,400
ピー・シー・エー	2,600	4,730.00	12,298,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,483.00	7,711,600
DTS	33,100	2,306.00	76,328,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	62,900	5,150.00	323,935,000
シーイーシー	16,000	1,573.00	25,168,000
カブコン	69,600	5,270.00	366,792,000
アイ・エス・ビー	3,500	2,659.00	9,306,500
ジャステック	9,600	1,496.00	14,361,600
SCSK	34,100	5,860.00	199,826,000
日本システムウエア	5,000	2,130.00	10,650,000
アイネス	14,700	1,491.00	21,917,700
TKC	12,500	6,810.00	85,125,000
富士ソフト	15,800	5,950.00	94,010,000
NSD	47,500	1,995.00	94,762,500
コナミホールディングス	53,600	5,260.00	281,936,000
福井コンピュータホールディングス	5,900	3,605.00	21,269,500

J B C Cホールディングス	10,100	1,572.00	15,877,200
ミロク情報サービス	13,100	2,289.00	29,985,900
ソフトバンクグループ	1,169,800	6,748.00	7,893,810,400
ハウスイ	1,200	950.00	1,140,000
高千穂交易	5,700	980.00	5,586,000
カワニシホールディングス	1,800	1,394.00	2,509,200
伊藤忠食品	3,700	5,530.00	20,461,000
エレマテック	13,800	1,039.00	14,338,200
J A L U X	4,200	1,500.00	6,300,000
あらた	11,800	5,010.00	59,118,000
トーメンデバイス	2,200	3,675.00	8,085,000
東京エレクトロン デバイス	5,400	3,155.00	17,037,000
フィールズ	11,300	333.00	3,762,900
双日	817,300	241.00	196,969,300
アルフレッサ ホールディングス	164,500	2,078.00	341,831,000
横浜冷凍	38,700	902.00	34,907,400
ラサ商事	7,900	911.00	7,196,900
アルコニックス	15,700	1,442.00	22,639,400
神戸物産	102,100	2,972.00	303,441,200
ハイパー	2,300	566.00	1,301,800
あい ホールディングス	21,100	1,939.00	40,912,900
ディーブイエックス	5,300	1,068.00	5,660,400
ダイワボウホールディングス	12,600	6,640.00	83,664,000
マクニカ・富士エレホールディングス	35,300	2,022.00	71,376,600
ラクト・ジャパン	6,400	3,205.00	20,512,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,900	978.00	27,286,200
八洲電機	11,500	958.00	11,017,000
メディアスホールディングス	8,400	907.00	7,618,800
レスターホールディングス	15,400	2,354.00	36,251,600
ジューテックホールディングス	3,400	996.00	3,386,400
大光	6,300	713.00	4,491,900
O C H Iホールディングス	4,300	1,469.00	6,316,700
T O K A Iホールディングス	78,200	1,091.00	85,316,200
黒谷	4,100	577.00	2,365,700
C o m i n i x	2,600	719.00	1,869,400
三洋貿易	14,900	981.00	14,616,900
ビューティガレージ	2,400	2,842.00	6,820,800
ウイン・パートナーズ	10,700	1,128.00	12,069,600
ミタチ産業	4,500	626.00	2,817,000
シップヘルスケアホールディングス	23,700	5,260.00	124,662,000
明治電機工業	4,700	1,347.00	6,330,900
デリカフーズホールディングス	5,300	619.00	3,280,700



スターティアホールディングス	3,400	704.00	2,393,600
コメダホールディングス	32,300	1,923.00	62,112,900
ピーバンドットコム	1,500	927.00	1,390,500
アセンテック	3,200	1,966.00	6,291,200
富士興産	4,500	907.00	4,081,500
協栄産業	1,700	1,348.00	2,291,600
小野建	13,300	1,290.00	17,157,000
南陽	3,300	1,768.00	5,834,400
佐島電機	10,100	843.00	8,514,300
エコートレーディング	3,400	617.00	2,097,800
伯東	9,000	1,148.00	10,332,000
コンドーテック	11,500	1,082.00	12,443,000
中山福	8,500	511.00	4,343,500
ナガイレーベン	19,600	2,777.00	54,429,200
三菱食品	16,300	2,885.00	47,025,500
松田産業	10,800	1,533.00	16,556,400
第一興商	22,000	3,775.00	83,050,000
メディバルホールディングス	159,700	1,883.00	300,715,100
S P K	6,400	1,319.00	8,441,600
萩原電気ホールディングス	5,500	2,469.00	13,579,500
アズワン	9,700	15,080.00	146,276,000
スズデン	5,200	1,195.00	6,214,000
尾家産業	4,300	1,408.00	6,054,400
シモジマ	9,100	1,400.00	12,740,000
ドウシシャ	14,000	1,891.00	26,474,000
小津産業	3,300	1,853.00	6,114,900
高速	8,800	1,595.00	14,036,000
たけびし	5,200	1,489.00	7,742,800
リックス	3,300	1,710.00	5,643,000
丸文	13,100	480.00	6,288,000
ハピネット	12,400	1,474.00	18,277,600
橋本総業ホールディングス	3,000	2,398.00	7,194,000
日本ライフライン	43,900	1,422.00	62,425,800
タカショー	9,600	689.00	6,614,400
マルカ	4,800	2,242.00	10,761,600
I D O M	39,900	563.00	22,463,700
進和	8,800	2,058.00	18,110,400
エスケイジャパン	3,200	522.00	1,670,400
ダイトロン	6,300	1,452.00	9,147,600
シークス	18,800	1,343.00	25,248,400
田中商事	4,600	713.00	3,279,800
オーハシテクニカ	7,600	1,441.00	10,951,600

白銅	5,300	1,328.00	7,038,400
ダイコー通産	1,000	1,354.00	1,354,000
伊藤忠商事	1,035,000	2,644.50	2,737,057,500
丸紅	1,540,300	613.90	945,590,170
高島	2,300	1,840.00	4,232,000
長瀬産業	83,200	1,440.00	119,808,000
蝶理	9,500	1,728.00	16,416,000
豊田通商	165,200	3,370.00	556,724,000
三共生興	22,500	455.00	10,237,500
兼松	55,200	1,297.00	71,594,400
ツカモトコーポレーション	2,700	1,249.00	3,372,300
三井物産	1,281,200	1,793.00	2,297,191,600
日本紙パルプ商事	8,400	3,835.00	32,214,000
カメイ	19,300	1,164.00	22,465,200
東都水産	1,900	4,545.00	8,635,500
OUGホールディングス	2,300	2,868.00	6,596,400
スターゼン	5,500	4,330.00	23,815,000
山善	57,800	1,076.00	62,192,800
椿本興業	2,700	3,815.00	10,300,500
住友商事	933,600	1,286.50	1,201,076,400
内田洋行	5,800	5,410.00	31,378,000
三菱商事	970,200	2,481.50	2,407,551,300
第一実業	7,200	3,950.00	28,440,000
キャノンマーケティングジャパン	36,700	2,282.00	83,749,400
西華産業	8,400	1,231.00	10,340,400
佐藤商事	12,200	1,029.00	12,553,800
菱洋エレクトロ	15,000	2,987.00	44,805,000
東京産業	13,400	553.00	7,410,200
ユアサ商事	14,100	3,100.00	43,710,000
神鋼商事	3,700	1,869.00	6,915,300
トルク	8,900	300.00	2,670,000
阪和興業	27,700	2,455.00	68,003,500
正栄食品工業	9,600	3,840.00	36,864,000
カナデン	12,000	1,255.00	15,060,000
菱電商事	10,700	1,589.00	17,002,300
フルサト工業	8,200	1,372.00	11,250,400
岩谷産業	34,700	4,915.00	170,550,500
ナイス	6,300	1,486.00	9,361,800
昭光通商	4,700	609.00	2,862,300
二チモウ	2,300	1,871.00	4,303,300
極東貿易	4,300	1,490.00	6,407,000
イワキ	19,500	537.00	10,471,500

三愛石油	36,500	1,141.00	41,646,500
稲畑産業	32,600	1,380.00	44,988,000
G S I クレオス	3,600	1,733.00	6,238,800
明和産業	13,700	421.00	5,767,700
クワザワホールディングス	5,300	578.00	3,063,400
ヤマエ久野	10,800	1,255.00	13,554,000
ワキタ	31,600	1,142.00	36,087,200
東邦ホールディングス	47,500	2,060.00	97,850,000
サンゲツ	40,000	1,640.00	65,600,000
ミツウロコグループホールディングス	21,800	1,290.00	28,122,000
シナネンホールディングス	6,100	3,140.00	19,154,000
伊藤忠エネクス	32,700	990.00	32,373,000
サンリオ	41,600	1,919.00	79,830,400
サンワテクノス	10,500	966.00	10,143,000
リョーサン	16,300	2,028.00	33,056,400
新光商事	22,200	900.00	19,980,000
トーホー	6,700	1,945.00	13,031,500
三信電気	7,900	2,139.00	16,898,100
東陽テクニカ	15,800	1,122.00	17,727,600
モスフードサービス	19,400	2,904.00	56,337,600
加賀電子	14,700	2,113.00	31,061,100
ソーダニッカ	15,300	582.00	8,904,600
立花エレテック	10,900	1,723.00	18,780,700
フォーバル	6,500	1,000.00	6,500,000
P A L T A C	23,700	5,660.00	134,142,000
三谷産業	19,500	423.00	8,248,500
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,400	1,926.00	6,548,400
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,427.00	1,855,100
コア商事ホールディングス	2,800	1,281.00	3,586,800
国際紙パルプ商事	35,100	252.00	8,845,200
ヤマタネ	7,400	1,399.00	10,352,600
丸紅建材リース	1,500	1,739.00	2,608,500
日鉄物産	10,600	3,200.00	33,920,000
泉州電業	4,200	2,991.00	12,562,200
トラスコ中山	33,900	2,852.00	96,682,800
オートバックスセブン	54,900	1,368.00	75,103,200
モリト	10,800	635.00	6,858,000
加藤産業	21,400	3,655.00	78,217,000
北恵	3,800	995.00	3,781,000
イノテック	7,700	974.00	7,499,800
イエローハット	28,000	1,668.00	46,704,000
J Kホールディングス	13,400	832.00	11,148,800

日伝	13,400	2,344.00	31,409,600
北沢産業	11,200	291.00	3,259,200
杉本商事	8,000	2,198.00	17,584,000
因幡電機産業	42,100	2,601.00	109,502,100
東テク	4,900	2,580.00	12,642,000
ミスミグループ本社	185,500	3,430.00	636,265,000
アルテック	10,900	301.00	3,280,900
タキヒヨー	4,500	1,820.00	8,190,000
蔵王産業	2,900	1,345.00	3,900,500
スズケン	62,700	3,880.00	243,276,000
ジェコス	10,200	984.00	10,036,800
グローセル	14,900	413.00	6,153,700
ローソン	37,500	5,130.00	192,375,000
サンエー	12,400	4,320.00	53,568,000
カワチ薬品	11,500	3,115.00	35,822,500
エービーシー・マート	23,100	6,080.00	140,448,000
ハードオフコーポレーション	6,200	669.00	4,147,800
アスクル	15,500	4,000.00	62,000,000
ゲオホールディングス	26,800	1,385.00	37,118,000
アダストリア	20,600	1,810.00	37,286,000
くら寿司	8,700	6,360.00	55,332,000
キャンドウ	7,200	1,933.00	13,917,600
パルグループホールディングス	15,300	1,237.00	18,926,100
エディオン	68,200	1,028.00	70,109,600
サーラコーポレーション	30,500	604.00	18,422,000
ワッツ	6,800	810.00	5,508,000
ハローズ	5,600	3,420.00	19,152,000
フジオフードグループ本社	12,500	1,462.00	18,275,000
あみやき亭	3,300	2,957.00	9,758,100
ひらまつ	27,200	205.00	5,576,000
大黒天物産	3,600	5,810.00	20,916,000
ハニーズホールディングス	13,300	996.00	13,246,800
ファーマライズホールディングス	3,900	781.00	3,045,900
アルペン	11,400	2,439.00	27,804,600
ハブ	4,600	669.00	3,077,400
クオールホールディングス	22,000	1,134.00	24,948,000
ジinzホールディングス	7,900	7,660.00	60,514,000
ビックカメラ	88,000	1,185.00	104,280,000
D C Mホールディングス	90,700	1,255.00	113,828,500
Monotaro	105,300	5,580.00	587,574,000
東京一番フーズ	4,200	581.00	2,440,200
きちりホールディングス	4,300	680.00	2,924,000

アークランドサービスホールディングス	12,500	2,086.00	26,075,000
J.フロント リテイリング	177,000	927.00	164,079,000
ドトール・日レスホールディングス	21,400	1,526.00	32,656,400
マツモトキヨシホールディングス	61,200	4,180.00	255,816,000
ブロンコビリー	7,800	2,395.00	18,681,000
Z O Z O	101,800	2,670.00	271,806,000
トレジャー・ファクトリー	4,700	721.00	3,388,700
物語コーポレーション	4,000	11,630.00	46,520,000
ココカラファイン	15,500	6,840.00	106,020,000
三越伊勢丹ホールディングス	259,300	574.00	148,838,200
H a m e e	5,400	1,690.00	9,126,000
ウエルシアホールディングス	88,100	4,110.00	362,091,000
クリエイティブSDホールディングス	25,000	3,695.00	92,375,000
丸善C H Iホールディングス	17,300	375.00	6,487,500
ティーライフ	2,400	1,159.00	2,781,600
チムニー	4,700	1,358.00	6,382,600
シュッピン	10,300	939.00	9,671,700
オイシックス・ラ・大地	14,700	3,030.00	44,541,000
ネクステージ	25,000	1,256.00	31,400,000
ジョイフル本田	43,500	1,576.00	68,556,000
鳥貴族	4,500	1,641.00	7,384,500
ホットランド	11,200	1,253.00	14,033,600
すかいらーくホールディングス	166,000	1,679.00	278,714,000
S F Pホールディングス	8,600	1,378.00	11,850,800
綿半ホールディングス	11,200	1,323.00	14,817,600
ヨシックス	2,600	1,805.00	4,693,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,200	1,117.00	48,254,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,000	916.00	7,328,000
B E E N O S	7,000	2,268.00	15,876,000
あさひ	11,200	1,611.00	18,043,200
日本調剤	9,100	1,711.00	15,570,100
コスモス薬品	13,100	17,070.00	223,617,000
トーエル	7,500	791.00	5,932,500
オンリー	3,000	491.00	1,473,000
セブン&アイ・ホールディングス	578,900	3,417.00	1,978,101,300
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	79,500	621.00	49,369,500
ツルハホールディングス	32,300	14,680.00	474,164,000
サンマルクホールディングス	11,900	1,566.00	18,635,400
フェリシモ	3,500	1,289.00	4,511,500
トリドールホールディングス	36,800	1,410.00	51,888,000
T O K Y O B A S E	13,900	498.00	6,922,200

ウイルプラスホールディングス	2,300	620.00	1,426,000	
JMホールディングス	11,300	2,406.00	27,187,800	
サツドラホールディングス	2,300	2,017.00	4,639,100	
アレンザホールディングス	7,600	1,391.00	10,571,600	
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,826.00	7,304,000	
パロックジャパンリミテッド	10,600	690.00	7,314,000	
クスリのアオキホールディングス	13,300	8,610.00	114,513,000	
力の源ホールディングス	6,700	650.00	4,355,000	
スシログローバルホールディングス	81,300	3,280.00	266,664,000	
メディカルシステムネットワーク	14,900	579.00	8,627,100	
はるやまホールディングス	7,300	706.00	5,153,800	
ノジマ	26,400	3,060.00	80,784,000	
カッパ・クリエイト	20,700	1,493.00	30,905,100	
ライトオン	11,100	657.00	7,292,700	
良品計画	196,600	2,257.00	443,726,200	
三城ホールディングス	16,600	288.00	4,780,800	
アドヴァン	22,800	1,401.00	31,942,800	
アルビス	5,700	2,686.00	15,310,200	
コナカ	18,500	241.00	4,458,500	
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,674.00	3,348,000	
G-7ホールディングス	8,800	2,234.00	19,659,200	
イオン北海道	19,700	899.00	17,710,300	
コジマ	25,800	669.00	17,260,200	
ヒマラヤ	5,400	902.00	4,870,800	
コーナン商事	21,100	3,455.00	72,900,500	
エコス	5,500	2,302.00	12,661,000	
ワタミ	17,800	1,033.00	18,387,400	
マルシェ	4,300	571.00	2,455,300	
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	325,400	2,345.00	763,063,000	
西松屋チェーン	32,600	1,605.00	52,323,000	
ゼンショーホールディングス	71,000	2,578.00	183,038,000	
幸楽苑ホールディングス	9,400	1,865.00	17,531,000	
ハークスレイ	3,400	914.00	3,107,600	
サイゼリヤ	22,100	1,956.00	43,227,600	
V Tホールディングス	61,900	379.00	23,460,100	
魚力	4,200	1,722.00	7,232,400	
フジ・コーポレーション	4,000	2,263.00	9,052,000	
ユナイテッドアローズ	15,700	1,489.00	23,377,300	
ハイデイ日高	21,500	1,749.00	37,603,500	
京都きもの友禅	10,500	232.00	2,436,000	
コロワイド	49,200	1,745.00	85,854,000	
ピーシーデボコーポレーション	20,000	667.00	13,340,000	

壱番屋	10,500	5,520.00	57,960,000
P L A N T	4,100	778.00	3,189,800
スギホールディングス	29,600	6,940.00	205,424,000
薬王堂ホールディングス	6,500	2,491.00	16,191,500
スクロール	23,100	680.00	15,708,000
ヨンドシーホールディングス	15,200	1,942.00	29,518,400
木曽路	19,400	2,535.00	49,179,000
S R S ホールディングス	17,700	922.00	16,319,400
タカキュー	11,400	145.00	1,653,000
リテールパートナーズ	19,800	1,403.00	27,779,400
ケーヨー	30,600	764.00	23,378,400
上新電機	17,500	2,613.00	45,727,500
日本瓦斯	23,400	4,975.00	116,415,000
ロイヤルホールディングス	25,800	2,023.00	52,193,400
いなげや	18,400	1,810.00	33,304,000
鳥忠	27,900	5,500.00	153,450,000
チヨダ	15,800	985.00	15,563,000
ライフコーポレーション	11,300	3,560.00	40,228,000
リンガーハット	18,200	2,270.00	41,314,000
M r M a x H D	20,600	778.00	16,026,800
テンアライド	13,600	360.00	4,896,000
A O K I ホールディングス	30,200	473.00	14,284,600
オークワ	23,300	1,432.00	33,365,600
コメリ	22,900	2,870.00	65,723,000
青山商事	31,100	544.00	16,918,400
しまむら	17,200	10,820.00	186,104,000
はせがわ	8,700	304.00	2,644,800
高島屋	108,000	886.00	95,688,000
松屋	30,100	732.00	22,033,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	70,400	652.00	45,900,800
近鉄百貨店	5,700	3,460.00	19,722,000
丸井グループ	135,700	2,093.00	284,020,100
アクシアル リテイリング	12,300	4,630.00	56,949,000
イオン	569,500	2,859.50	1,628,485,250
イズミ	30,100	3,655.00	110,015,500
平和堂	30,100	2,136.00	64,293,600
フジ	17,900	1,987.00	35,567,300
ヤオコー	16,800	7,240.00	121,632,000
ゼビオホールディングス	18,200	755.00	13,741,000
ケーズホールディングス	143,000	1,306.00	186,758,000
O l y m p i c グループ	7,900	941.00	7,433,900
日産東京販売ホールディングス	22,700	255.00	5,788,500

シルバーライフ	2,100	2,047.00	4,298,700
Genky DrugStores	6,600	4,235.00	27,951,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	810.00	2,916,000
ブックオフグループホールディングス	8,600	899.00	7,731,400
ギフト	1,500	1,870.00	2,805,000
アインホールディングス	18,200	7,800.00	141,960,000
元気寿司	3,800	2,411.00	9,161,800
ヤマダホールディングス	451,400	498.00	224,797,200
アークランドサカモト	23,300	1,875.00	43,687,500
ニトリホールディングス	64,100	20,960.00	1,343,536,000
グルメ杵屋	10,800	1,000.00	10,800,000
愛眼	11,800	227.00	2,678,600
ケーユーホールディングス	8,000	800.00	6,400,000
吉野家ホールディングス	48,700	2,003.00	97,546,100
松屋フーズホールディングス	7,200	3,580.00	25,776,000
サガミホールディングス	20,000	1,333.00	26,660,000
関西スーパーマーケット	12,500	1,266.00	15,825,000
王将フードサービス	10,900	6,140.00	66,926,000
プレナス	16,700	1,759.00	29,375,300
ミニストップ	11,100	1,405.00	15,595,500
アークス	30,400	2,236.00	67,974,400
パローホールディングス	32,800	2,558.00	83,902,400
ベルク	7,300	6,390.00	46,647,000
大庄	8,100	1,172.00	9,493,200
ファーストリテイリング	19,800	76,840.00	1,521,432,000
サンドラッグ	55,700	4,075.00	226,977,500
サックスパーホールディングス	13,000	549.00	7,137,000
ヤマザワ	3,600	1,742.00	6,271,200
やまや	3,000	2,204.00	6,612,000
ベルーナ	32,000	853.00	27,296,000
島根銀行	3,900	606.00	2,363,400
じもとホールディングス	10,000	1,033.00	10,330,000
めぶきフィナンシャルグループ	770,000	231.00	177,870,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20,000	1,160.00	23,200,000
九州フィナンシャルグループ	324,200	526.00	170,529,200
ゆうちょ銀行	419,800	877.00	368,164,600
富山第一銀行	35,300	302.00	10,660,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	846,400	377.00	319,092,800
西日本フィナンシャルホールディングス	98,600	727.00	71,682,200
関西みらいフィナンシャルグループ	87,000	485.00	42,195,000
三十三フィナンシャルグループ	13,700	1,410.00	19,317,000
第四北越フィナンシャルグループ	25,700	2,108.00	54,175,600



ひろぎんホールディングス	218,600	588.00	128,536,800
新生銀行	108,700	1,411.00	153,375,700
あおぞら銀行	88,300	1,810.00	159,823,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,136,800	445.90	4,519,999,120
りそなホールディングス	1,611,100	369.00	594,495,900
三井住友トラスト・ホールディングス	280,100	3,091.00	865,789,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,024,900	3,085.00	3,161,816,500
千葉銀行	494,500	588.00	290,766,000
群馬銀行	284,700	348.00	99,075,600
武蔵野銀行	22,100	1,585.00	35,028,500
千葉興業銀行	40,600	256.00	10,393,600
筑波銀行	61,600	188.00	11,580,800
七十七銀行	50,100	1,569.00	78,606,900
青森銀行	11,500	2,416.00	27,784,000
秋田銀行	9,500	1,558.00	14,801,000
山形銀行	16,700	1,343.00	22,428,100
岩手銀行	9,700	2,424.00	23,512,800
東邦銀行	132,500	240.00	31,800,000
東北銀行	7,100	1,065.00	7,561,500
みちのく銀行	9,500	1,176.00	11,172,000
ふくおかフィナンシャルグループ	124,800	1,897.00	236,745,600
静岡銀行	360,900	743.00	268,148,700
十六銀行	18,600	2,035.00	37,851,000
スルガ銀行	151,600	366.00	55,485,600
八十二銀行	357,600	399.00	142,682,400
山梨中央銀行	17,200	927.00	15,944,400
大垣共立銀行	29,300	2,469.00	72,341,700
福井銀行	12,700	1,953.00	24,803,100
北國銀行	14,800	2,957.00	43,763,600
清水銀行	6,100	1,815.00	11,071,500
富山銀行	2,900	3,145.00	9,120,500
滋賀銀行	29,700	2,393.00	71,072,100
南都銀行	24,600	1,957.00	48,142,200
百五銀行	133,400	333.00	44,422,200
京都銀行	53,100	4,990.00	264,969,000
紀陽銀行	52,500	1,672.00	87,780,000
ほくほくフィナンシャルグループ	98,600	1,039.00	102,445,400
山陰合同銀行	87,900	559.00	49,136,100
中国銀行	127,500	968.00	123,420,000
鳥取銀行	5,000	1,183.00	5,915,000
伊予銀行	211,400	688.00	145,443,200
百十四銀行	15,700	1,704.00	26,752,800

四国銀行	22,500	771.00	17,347,500
阿波銀行	24,200	2,670.00	64,614,000
大分銀行	8,500	2,540.00	21,590,000
宮崎銀行	9,900	2,417.00	23,928,300
佐賀銀行	9,000	1,405.00	12,645,000
沖縄銀行	13,600	3,075.00	41,820,000
琉球銀行	34,200	903.00	30,882,600
セブン銀行	495,100	254.00	125,755,400
みずほフィナンシャルグループ	2,013,600	1,406.00	2,831,121,600
高知銀行	5,400	764.00	4,125,600
山口フィナンシャルグループ	185,000	730.00	135,050,000
長野銀行	4,900	1,429.00	7,002,100
名古屋銀行	11,100	2,785.00	30,913,500
北洋銀行	223,400	235.00	52,499,000
愛知銀行	5,400	3,145.00	16,983,000
中京銀行	6,100	2,221.00	13,548,100
大光銀行	5,100	1,373.00	7,002,300
愛媛銀行	20,700	1,144.00	23,680,800
トマト銀行	5,700	1,093.00	6,230,100
京葉銀行	63,200	496.00	31,347,200
栃木銀行	71,600	190.00	13,604,000
北日本銀行	4,600	2,058.00	9,466,800
東和銀行	26,000	725.00	18,850,000
福島銀行	13,900	233.00	3,238,700
大東銀行	7,700	624.00	4,804,800
トモニホールディングス	114,600	335.00	38,391,000
フィデアホールディングス	143,900	111.00	15,972,900
池田泉州ホールディングス	170,400	164.00	27,945,600
F P G	46,100	527.00	24,294,700
マーキュリアインベストメント	6,100	640.00	3,904,000
S B Iホールディングス	170,200	2,700.00	459,540,000
ジャフコ グループ	22,800	4,725.00	107,730,000
大和証券グループ本社	1,189,500	448.10	533,014,950
野村ホールディングス	2,607,800	527.10	1,374,571,380
岡三証券グループ	126,800	353.00	44,760,400
丸三証券	44,400	481.00	21,356,400
東洋証券	54,600	121.00	6,606,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	170,900	293.00	50,073,700
光世証券	3,800	678.00	2,576,400
水戸証券	43,700	221.00	9,657,700
いちよし証券	28,200	431.00	12,154,200
松井証券	84,900	887.00	75,306,300

マネックスグループ	109,500	273.00	29,893,500
極東証券	20,200	719.00	14,523,800
岩井コスモホールディングス	14,200	1,282.00	18,204,400
藍澤証券	26,900	710.00	19,099,000
マネーパートナーズグループ	16,700	207.00	3,456,900
スパークス・グループ	69,200	241.00	16,677,200
かんぽ生命保険	52,500	1,733.00	90,982,500
S O M P Oホールディングス	278,600	4,102.00	1,142,817,200
アニコム ホールディングス	49,300	1,107.00	54,575,100
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	387,500	3,124.00	1,210,550,000
第一生命ホールディングス	838,500	1,734.00	1,453,959,000
東京海上ホールディングス	523,900	5,315.00	2,784,528,500
T & Dホールディングス	442,900	1,154.00	511,106,600
アドバンスクリエイト	3,100	1,979.00	6,134,900
全国保証	41,800	4,675.00	195,415,000
イントラスト	5,400	872.00	4,708,800
日本モーゲージサービス	6,200	1,057.00	6,553,400
C a s a	5,300	1,280.00	6,784,000
アルヒ	23,600	2,179.00	51,424,400
プレミアグループ	8,100	2,086.00	16,896,600
クレディセゾン	103,900	1,338.00	139,018,200
芙蓉総合リース	15,600	6,380.00	99,528,000
みずほリース	22,900	2,732.00	62,562,800
東京センチュリー	29,900	6,010.00	179,699,000
日本証券金融	65,600	512.00	33,587,200
アイフル	226,500	315.00	71,347,500
リコーリース	11,700	2,959.00	34,620,300
イオンフィナンシャルサービス	90,800	1,199.00	108,869,200
アコム	298,100	508.00	151,434,800
ジャックス	16,400	1,883.00	30,881,200
オリエントコーポレーション	402,000	118.00	47,436,000
日立キャピタル	35,000	2,397.00	83,895,000
オリックス	919,500	1,494.50	1,374,192,750
三菱U F Jリース	376,400	483.00	181,801,200
九州リースサービス	7,500	620.00	4,650,000
日本取引所グループ	425,400	2,490.50	1,059,458,700
イー・ギャランティ	17,000	1,975.00	33,575,000
アサックス	7,900	760.00	6,004,000
N E Cキャピタルソリューション	6,100	1,862.00	11,358,200
いちご	195,400	333.00	65,068,200
日本駐車場開発	162,400	133.00	21,599,200
スター・マイカ・ホールディングス	9,100	1,534.00	13,959,400

A Dワークスグループ	27,900	155.00	4,324,500	
ヒューリック	316,400	1,059.00	335,067,600	
三栄建築設計	7,100	1,791.00	12,716,100	
野村不動産ホールディングス	91,100	2,045.00	186,299,500	
三重交通グループホールディングス	34,500	513.00	17,698,500	
サムティ	22,300	1,748.00	38,980,400	
ディア・ライフ	26,300	402.00	10,572,600	
日本商業開発	10,600	1,779.00	18,857,400	
ハウスコム	4,200	1,286.00	5,401,200	
日本管理センター	9,500	1,320.00	12,540,000	
サンセイランディック	7,200	773.00	5,565,600	
フージャースホールディングス	29,500	691.00	20,384,500	
オープンハウス	47,200	4,015.00	189,508,000	
東急不動産ホールディングス	407,400	517.00	210,625,800	
飯田グループホールディングス	124,700	2,064.00	257,380,800	
イーランド	5,100	782.00	3,988,200	
ムゲンエステート	13,100	535.00	7,008,500	
ハウズドゥ	7,300	1,313.00	9,584,900	
シーアールイー	5,300	1,358.00	7,197,400	
グッドコムアセット	8,500	1,489.00	12,656,500	
ジェイ・エス・ビー	3,400	2,956.00	10,050,400	
テンポイノベーション	5,700	914.00	5,209,800	
パーク24	81,100	1,565.00	126,921,500	
パラカ	5,100	1,727.00	8,807,700	
三井不動産	721,500	2,064.00	1,489,176,000	
三菱地所	1,039,600	1,773.50	1,843,730,600	
平和不動産	27,900	3,245.00	90,535,500	
東京建物	148,000	1,367.00	202,316,000	
ダイビル	39,800	1,314.00	52,297,200	
京阪神ビルディング	24,700	2,152.00	53,154,400	
住友不動産	333,800	3,328.00	1,110,886,400	
テーオーシー	32,400	679.00	21,999,600	
東京楽天地	2,900	4,460.00	12,934,000	
スターツコーポレーション	21,000	2,644.00	55,524,000	
フジ住宅	20,700	604.00	12,502,800	
空港施設	19,400	493.00	9,564,200	
明和地所	12,600	474.00	5,972,400	
ゴールドクレスト	13,200	1,433.00	18,915,600	
エスリード	7,300	1,362.00	9,942,600	
日神グループホールディングス	27,200	402.00	10,934,400	
日本エスコン	26,800	897.00	24,039,600	
タカラレーベン	67,700	300.00	20,310,000	

AVANTIA	10,700	892.00	9,544,400
イオンモール	75,500	1,750.00	132,125,000
毎日コムネット	6,700	738.00	4,944,600
ファースト住建	8,400	1,025.00	8,610,000
カチタス	37,400	3,090.00	115,566,000
トーセイ	22,400	1,131.00	25,334,400
穴吹興産	4,500	1,694.00	7,623,000
サンフロンティア不動産	22,800	957.00	21,819,600
エフ・ジェー・ネクスト	15,000	1,007.00	15,105,000
インテリックス	4,200	535.00	2,247,000
ランドビジネス	5,000	350.00	1,750,000
サンネクスタグループ	6,700	1,017.00	6,813,900
グランディハウス	17,300	378.00	6,539,400
日本空港ビルデング	47,800	5,100.00	243,780,000
明豊ファシリティワークス	7,000	650.00	4,550,000
日本工営	9,800	2,963.00	29,037,400
LIFULL	50,800	421.00	21,386,800
ミクシィ	27,500	2,992.00	82,280,000
ジェイエイシーリクルートメント	9,800	1,472.00	14,425,600
日本M&Aセンター	109,900	6,160.00	676,984,000
メンバーズ	4,400	2,073.00	9,121,200
中広	2,600	471.00	1,224,600
UTグループ	22,700	3,440.00	78,088,000
アイティメディア	5,800	2,487.00	14,424,600
タケエイ	16,000	1,040.00	16,640,000
E・Jホールディングス	2,700	2,219.00	5,991,300
ビーネックスグループ	18,300	1,118.00	20,459,400
コシダカホールディングス	35,300	442.00	15,602,600
アルトナー	3,800	891.00	3,385,800
パソナグループ	15,700	1,777.00	27,898,900
CDS	3,800	1,290.00	4,902,000
リンクアンドモチベーション	26,400	447.00	11,800,800
GCA	19,100	692.00	13,217,200
エス・エム・エス	44,800	3,270.00	146,496,000
サニーサイドアップグループ	5,400	706.00	3,812,400
パーソルホールディングス	143,700	1,881.00	270,299,700
リニカル	7,300	765.00	5,584,500
クックパッド	45,800	340.00	15,572,000
アイ・ケイ・ケイ	7,400	676.00	5,002,400
学情	5,400	1,072.00	5,788,800
スタジオアリス	7,400	1,988.00	14,711,200
シミックホールディングス	7,300	1,400.00	10,220,000

エプコ	3,700	1,022.00	3,781,400
N J S	3,700	1,970.00	7,289,000
総合警備保障	57,200	5,180.00	296,296,000
カカクコム	106,200	3,365.00	357,363,000
アイロムグループ	5,200	1,861.00	9,677,200
セントケア・ホールディング	9,700	830.00	8,051,000
サイネックス	2,700	822.00	2,219,400
ルネサンス	8,300	916.00	7,602,800
ディップ	19,800	2,414.00	47,797,200
デジタルホールディングス	10,200	1,412.00	14,402,400
ツクイホールディングス	34,300	553.00	18,967,900
キャリアデザインセンター	3,600	1,044.00	3,758,400
ベネフィット・ワン	52,300	2,791.00	145,969,300
エムスリー	316,600	7,599.00	2,405,843,400
ツカダ・グローバルホールディング	11,400	287.00	3,271,800
アウトソーシング	82,500	1,328.00	109,560,000
ウェルネット	15,000	553.00	8,295,000
ワールドホールディングス	5,000	1,983.00	9,915,000
ディー・エヌ・エー	60,900	1,833.00	111,629,700
博報堂D Yホールディングス	199,900	1,509.00	301,649,100
ぐるなび	25,400	642.00	16,306,800
タカミヤ	15,700	508.00	7,975,600
ジャパンベストレスキューシステム	11,300	997.00	11,266,100
ファンコミュニケーションズ	40,100	458.00	18,365,800
ライク	4,900	2,201.00	10,784,900
ビジネス・ブレークスルー	6,700	403.00	2,700,100
エスプール	37,200	725.00	26,970,000
W D Bホールディングス	6,600	3,140.00	20,724,000
手間いらず	1,000	5,650.00	5,650,000
ティア	9,100	414.00	3,767,400
C D G	1,700	1,554.00	2,641,800
バリューコマース	9,700	3,255.00	31,573,500
インフォマート	145,500	1,036.00	150,738,000
J Pホールディングス	46,000	304.00	13,984,000
エコナックホールディングス	29,000	93.00	2,697,000
E P Sホールディングス	19,700	1,016.00	20,015,200
レッグス	3,700	1,510.00	5,587,000
プレステージ・インターナショナル	54,100	912.00	49,339,200
アミューズ	7,900	2,644.00	20,887,600
ドリームインキュベータ	4,600	1,540.00	7,084,000
クイック	9,200	1,143.00	10,515,600
T A C	9,900	226.00	2,237,400

ケネディクス	123,900	568.00	70,375,200
電通グループ	161,500	3,350.00	541,025,000
イオンファンタジー	5,700	2,400.00	13,680,000
シーティーエス	16,500	880.00	14,520,000
ネクシィーズグループ	4,700	1,038.00	4,878,600
H.U.グループホールディングス	40,300	2,621.00	105,626,300
アルプス技研	12,800	2,055.00	26,304,000
ダイオーズ	3,100	951.00	2,948,100
日本空調サービス	15,400	770.00	11,858,000
オリエンタルランド	152,700	16,805.00	2,566,123,500
ダスキン	35,800	2,864.00	102,531,200
明光ネットワークジャパン	18,600	621.00	11,550,600
ファルコホールディングス	8,100	1,641.00	13,292,100
ラウンドワン	40,400	949.00	38,339,600
リゾートトラスト	66,000	1,695.00	111,870,000
ビー・エム・エル	18,600	3,100.00	57,660,000
りらいあコミュニケーションズ	25,200	1,192.00	30,038,400
リソー教育	66,400	335.00	22,244,000
早稲田アカデミー	6,500	997.00	6,480,500
ユー・エス・エス	160,900	2,249.00	361,864,100
東京個別指導学院	5,500	621.00	3,415,500
サイバーエージェント	88,500	6,040.00	534,540,000
楽天	669,400	1,089.00	728,976,600
クリーク・アンド・リバー社	7,800	1,056.00	8,236,800
テー・オー・ダブリュー	23,800	297.00	7,068,600
山田コンサルティンググループ	9,600	1,032.00	9,907,200
セントラルスポーツ	5,500	2,400.00	13,200,000
フルキャストホールディングス	12,700	1,677.00	21,297,900
エン・ジャパン	25,600	2,837.00	72,627,200
リソルホールディングス	1,600	3,825.00	6,120,000
テクノプロ・ホールディングス	28,700	7,460.00	214,102,000
アトラ	3,300	279.00	920,700
インターワークス	3,600	328.00	1,180,800
アイ・アールジャパンホールディングス	5,800	12,770.00	74,066,000
Keeper 技研	10,700	1,491.00	15,953,700
ファーストロジック	3,100	800.00	2,480,000
三機サービス	3,000	972.00	2,916,000
Gunosy	9,300	787.00	7,319,100
デザインワン・ジャパン	5,400	235.00	1,269,000
イー・ガーディアン	6,400	3,330.00	21,312,000
リブセンス	8,900	270.00	2,403,000
ジャパンマテリアル	44,300	1,374.00	60,868,200

ベクトル	18,200	907.00	16,507,400
ウチヤマホールディングス	8,000	313.00	2,504,000
チャーム・ケア・コーポレーション	12,400	1,127.00	13,974,800
キャリアリンク	4,900	1,529.00	7,492,100
I B J	12,000	1,013.00	12,156,000
アサンテ	5,900	1,637.00	9,658,300
N・フィールド	10,200	818.00	8,343,600
バリューHR	5,900	1,628.00	9,605,200
M&Aキャピタルパートナーズ	11,700	5,850.00	68,445,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,600	2,075.00	11,620,000
E R Iホールディングス	4,500	674.00	3,033,000
アビスト	2,300	2,891.00	6,649,300
シグマクシス	10,000	1,573.00	15,730,000
ウィルグループ	9,700	903.00	8,759,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,100	314.00	6,939,400
メドピア	6,800	5,200.00	35,360,000
リクルートホールディングス	1,028,500	4,851.00	4,989,253,500
エラン	10,000	2,506.00	25,060,000
土木管理総合試験所	7,700	403.00	3,103,100
ネットマーケティング	6,000	604.00	3,624,000
日本郵政	1,177,100	766.10	901,776,310
ベルシステム24ホールディングス	24,200	1,628.00	39,397,600
鎌倉新書	11,100	1,205.00	13,375,500
S M N	3,400	792.00	2,692,800
L I T A L I C O	5,000	3,055.00	15,275,000
グローバルキッズCOMPANY	2,900	771.00	2,235,900
エアトリ	7,600	1,407.00	10,693,200
アトラエ	4,500	2,855.00	12,847,500
ストライク	5,500	5,900.00	32,450,000
ソラスト	39,800	1,376.00	54,764,800
セラク	4,600	1,939.00	8,919,400
インソース	6,000	3,150.00	18,900,000
ベйкаレント・コンサルティング	8,700	15,790.00	137,373,000
Orchestra Holdings	3,100	2,229.00	6,909,900
アイモバイル	5,300	1,240.00	6,572,000
キャリアインデックス	6,400	501.00	3,206,400
M S - J a p a n	5,000	825.00	4,125,000
船場	3,100	925.00	2,867,500
グレイステクノロジー	6,700	5,630.00	37,721,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	16,500	4,210.00	69,465,000
フルテック	2,200	1,439.00	3,165,800
グリーンズ	3,600	515.00	1,854,000



GameWith	4,800	565.00	2,712,000
ソウルドアウト	3,600	1,488.00	5,356,800
MS&Consulting	3,100	633.00	1,962,300
エル・ティー・エス	1,100	4,875.00	5,362,500
ミダック	2,000	2,773.00	5,546,000
日総工産	9,900	820.00	8,118,000
キュービーネットホールディングス	6,100	1,718.00	10,479,800
RPAホールディングス	11,300	710.00	8,023,000
スプリックス	4,300	937.00	4,029,100
マネジメントソリューションズ	7,200	1,425.00	10,260,000
プロレド・パートナーズ	2,000	4,840.00	9,680,000
フロンティア・マネジメント	1,300	4,690.00	6,097,000
ピアラ	900	2,379.00	2,141,100
コプロ・ホールディングス	1,000	3,150.00	3,150,000
ギークス	1,700	1,161.00	1,973,700
カーブスホールディングス	39,800	724.00	28,815,200
フォーラムエンジニアリング	7,800	872.00	6,801,600
アドバンテッジリスクマネジメント	7,700	669.00	5,151,300
リログループ	78,600	2,713.00	213,241,800
東祥	9,200	1,375.00	12,650,000
エイチ・アイ・エス	22,400	1,630.00	36,512,000
ラックランド	4,200	2,315.00	9,723,000
共立メンテナンス	23,900	4,055.00	96,914,500
イチネンホールディングス	16,300	1,305.00	21,271,500
建設技術研究所	9,400	2,048.00	19,251,200
スペース	9,700	842.00	8,167,400
長大	5,900	1,295.00	7,640,500
燦ホールディングス	6,500	1,310.00	8,515,000
スバル興業	900	7,950.00	7,155,000
東京テアトル	5,800	1,300.00	7,540,000
タナベ経営	3,000	1,400.00	4,200,000
ナガワ	4,600	8,450.00	38,870,000
よみうりランド	3,200	6,100.00	19,520,000
東京都競馬	9,400	4,925.00	46,295,000
カナモト	25,400	2,250.00	57,150,000
東京ドーム	58,400	906.00	52,910,400
西尾レントオール	13,400	2,148.00	28,783,200
トランス・コスモス	13,700	2,886.00	39,538,200
乃村工藝社	61,900	810.00	50,139,000
藤田観光	5,700	1,596.00	9,097,200
KNT-CTホールディングス	8,900	1,002.00	8,917,800
日本管財	15,500	2,118.00	32,829,000

トーカイ	14,000	2,060.00	28,840,000	
セコム	152,400	9,451.00	1,440,332,400	
セントラル警備保障	7,000	3,515.00	24,605,000	
丹青社	27,500	782.00	21,505,000	
メイテック	17,600	5,230.00	92,048,000	
応用地質	17,000	1,283.00	21,811,000	
船井総研ホールディングス	29,800	2,517.00	75,006,600	
進学会ホールディングス	6,200	436.00	2,703,200	
オオバ	10,600	799.00	8,469,400	
いであ	3,700	1,713.00	6,338,100	
学究社	4,400	1,075.00	4,730,000	
ベネッセホールディングス	47,900	2,623.00	125,641,700	
イオンディライト	17,800	2,857.00	50,854,600	
ナック	8,200	935.00	7,667,000	
ダイセキ	24,200	2,781.00	67,300,200	
ステップ	5,400	1,615.00	8,721,000	
合 計	158,143,500		357,655,953,420	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	13,942,337,475
コール・ローン	155,893,225
株式	424,683,294,686
投資信託受益証券	274,486,515
投資証券	9,813,366,881
派生商品評価勘定	860,857,615
未収入金	767,627

	2020年11月10日現在
項目	金額（円）
未収配当金	343,674,656
差入委託証拠金	4,663,512,601
流動資産合計	454,738,191,281
資産合計	454,738,191,281
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,882,386
前受金	858,329,889
未払株式払込金	30,960,697
未払解約金	161,967,045
未払利息	221
流動負債合計	1,055,140,238
負債合計	1,055,140,238
純資産の部	
元本等	
元本	152,201,958,636
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	301,481,092,407
元本等合計	453,683,051,043
純資産合計	453,683,051,043
負債純資産合計	454,738,191,281

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

2020年11月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 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。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2020年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	152,201,958,636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 2.9808円 (1万口当たり純資産額) (29,808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11月10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11月10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11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	153,553,031,075円
期中追加設定元本額	13,802,125,514円
期中一部解約元本額	15,153,197,953円
期末元本額	152,201,958,636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）	2,277,743,089円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,644,941円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,280,106,939円
世界経済インデックスファンド	8,209,613,752円
外国株式インデックス・オープン	819,445,819円
D C マイセレクション 2 5	1,008,389,141円
D C マイセレクション 5 0	4,747,095,028円
D C マイセレクション 7 5	5,024,553,014円
D C 外国株式インデックス・オープン	10,115,165,530円
D C マイセレクション S 2 5	424,747,413円

区分	2020年11月10日現在
DCマイセレクションS50	2,020,164,918円
DCマイセレクションS75	1,490,454,193円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	83,769,105円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	186,751,658円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	128,173,740円
DC世界経済インデックスファンド	10,473,425,835円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	2,130,562,096円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	7,945,373円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,576,295円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	33,102,542円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	34,272,595円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	121,692,333円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	26,354,971円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	115,165,196円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	521,072,144円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	296,128,681円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,948,953,596円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,645,290,893円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	57,841,571円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	280,497,699円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	94,529,298円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,654,386,064円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,727,732,250円
外国株式ファンド・シリーズ1	977,642,529円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,832,322,811円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,722,679,110円
分散投資コア戦略ファンドA	2,254,795,118円
分散投資コア戦略ファンドS	10,941,726,462円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,199,280,196円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,197,898,510円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,280,763,619円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	721,465,286円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,147,350円
SMT インデックスバランス・オープン	207,384,090円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,096,141,084円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	32,789,443,109円
SMT 世界経済インデックス・オープン	142,228,961円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	455,632,755円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	82,197,391円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,655,944円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	81,221,052円
グローバル経済コア	884,832,901円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,774,465円

区分	2020年11月10日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	1,533,345円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	682,028,181円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	75,292,414円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	1,008,461円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	1,251,039円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	624,147円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,104,123円
F O F s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）	928,565,312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）	1,507,228,591円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,718,063,615円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	426,297,296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）	114,269,093円
S M T A M海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	348,442,118円
S M T A Mバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	764,579,343円
S M T A M海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	361,990,038円
S M T A M海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	349,101,065円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	54,765,705,575
投資信託受益証券	10,544,942
投資証券	408,586,406
合計	55,163,747,039

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引	17,110,733,739	-	858,329,889
	買建			
合計		17,110,733,739	-	858,329,889

## (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11月10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	860,365,340	-	861,720,000	1,354,660
	アメリカドル	652,999,300	-	654,344,000	1,344,700
	ユーロ	124,263,100	-	124,270,000	6,900
	イギリスポンド	83,102,940	-	83,106,000	3,060
合計		860,365,340	-	861,720,000	1,354,660

### (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	17.67	1,024,506.60	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	16.65	597,385.35	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	51.80	1,138,356.80	
	CHEVRON CORP	180,665	79.40	14,344,801.00	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	48.53	933,959.85	
	CONOCOPHILLIPS	100,048	33.38	3,339,602.24	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	16,913	32.40	547,981.20	
	EOG RESOURCES INC	55,405	40.31	2,233,375.55	
	EXXON MOBIL	397,774	36.93	14,689,793.82	
	HALLIBURTON CO	77,539	14.38	1,115,010.82	
	HESS CORP	24,844	43.39	1,077,981.16	
	KINDER MORGAN INC	193,367	12.30	2,378,414.10	

MARATHON PETROLEUM CORP	61,979	36.47	2,260,374.13
NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	11.46	425,876.52
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,482	12.23	984,294.86
ONEOK INC	41,832	31.35	1,311,433.20
PHILLIPS 66	39,493	57.03	2,252,285.79
PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	88.37	1,400,134.28
SCHLUMBERGER	131,946	18.25	2,408,014.50
VALERO ENERGY CORP	38,903	50.08	1,948,262.24
WILLIAMS COS	114,214	19.35	2,210,040.90
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	20,949	312.67	6,550,123.83
ALBEMARLE CORP	10,180	116.73	1,188,311.40
AMCOR PLC	151,315	12.04	1,821,832.60
AVERY DENNISON CORP	7,457	152.35	1,136,073.95
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	27.88	490,855.28
BALL CORP	29,987	92.98	2,788,191.26
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	126.25	1,395,441.25
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	28.96	552,296.16
CORTEVA INC	70,180	34.64	2,431,035.20
CROWN HOLDINGS INC	12,992	91.35	1,186,819.20
DOW INC	70,527	52.12	3,675,867.24
DUPONT DE NEMOURS INC	69,779	61.66	4,302,573.14
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	14,391	90.34	1,300,082.94
ECOLAB INC	24,220	216.90	5,253,318.00
FMC CORP	12,118	109.84	1,331,041.12
FREEMONT-MCMORAN INC	138,927	19.79	2,749,365.33
INT'L PAPER CO	33,803	47.36	1,600,910.08
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,504	112.38	843,299.52
LINDE PLC	49,702	257.65	12,805,720.30
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	79.39	2,025,477.07
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	261.43	1,563,612.83
MOSAIC CO/THE	31,911	17.00	542,487.00
NEWMONT CORPORATION	76,214	66.01	5,030,886.14
NUCOR CORP	29,015	50.76	1,472,801.40
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	126.79	1,127,163.10
PPG INDUSTRIES INC	22,118	141.87	3,137,880.66
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	89.80	1,116,214.00
SEALED AIR CORP	14,689	42.87	629,717.43
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,757	690.76	5,358,225.32
STEEL DYNAMICS INC	18,273	33.35	609,404.55
VULCAN MATERIALS CO	12,657	135.68	1,717,301.76
WESTROCK CO	24,734	40.34	997,769.56
3 M COMPANY	54,179	163.43	8,854,473.97

AERCAP HOLDINGS NV	10,498	35.52	372,888.96
ALLEGION PLC	8,963	111.87	1,002,690.81
AMETEK INC	20,674	114.07	2,358,283.18
BOEING CO	50,512	179.36	9,059,832.32
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	38.80	2,931,378.80
CATERPILLAR	51,008	170.82	8,713,186.56
CUMMINS INC	13,804	228.97	3,160,701.88
DEERE&CO	28,040	248.87	6,978,314.80
DOVER CORP	13,872	119.72	1,660,755.84
EATON CORP	37,842	113.50	4,295,067.00
EMERSON ELECTRIC CO	56,530	76.29	4,312,673.70
FASTENAL CO	51,828	45.99	2,383,569.72
FORTIVE CORP	28,503	70.33	2,004,615.99
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	80.06	1,025,568.60
GENERAL DYNAMICS CORP	22,742	147.13	3,346,030.46
GENERAL ELECTRIC CO	826,055	8.72	7,203,199.60
GRAINGER (WW) INC	4,351	388.22	1,689,145.22
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	43.75	666,137.50
HEICO CORP	3,640	125.79	457,875.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	112.47	725,319.03
HONEYWELL INTL INC	66,069	196.99	13,014,932.31
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	22.43	819,816.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	155.97	549,326.34
IDEX CORP	6,916	187.81	1,298,893.96
ILLINOIS TOOL WORKS	29,811	213.89	6,376,274.79
INGERSOLL-RAND INC	31,562	42.78	1,350,222.36
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	100.13	1,204,163.38
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	46.35	931,635.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	22.01	451,205.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	69,045	44.42	3,066,978.90
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	20,431	185.85	3,797,101.35
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	291.83	893,583.46
LOCKHEED MARTIN CORP	23,771	363.95	8,651,455.45
MASCO CORP	23,467	53.74	1,261,116.58
NORDSON CORP	4,880	201.78	984,686.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,956	301.28	4,505,943.68
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	63.50	2,382,456.50
OWENS CORNING	10,458	66.09	691,169.22
PACCAR INC	32,395	90.60	2,934,987.00
PARKER HANNIFIN CORP	12,596	252.79	3,184,142.84
PENTAIR PLC	14,533	52.83	767,778.39
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	142,554	64.99	9,264,584.46

ROCKWELL AUTOMATION INC	11,374	254.74	2,897,412.76
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,876	390.21	3,853,713.96
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	46.97	649,501.16
SMITH (A.O.) CORP	12,146	53.13	645,316.98
SNAP-ON INC	4,900	168.26	824,474.00
STANLEY BLACK&DECKER	14,654	177.41	2,599,766.14
SUNRUN INC	11,100	55.49	615,939.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	364.12	1,274,784.12
TEXTRON	21,534	42.49	914,979.66
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,896	145.67	3,189,590.32
TRANSDIGM GROUP INC	4,664	568.32	2,650,644.48
UNITED RENTALS INC	6,643	205.82	1,367,262.26
WABTEC CORP	17,764	68.61	1,218,788.04
XYLEM INC	17,545	93.53	1,640,983.85
CINTAS CORP	8,272	363.46	3,006,541.12
COPART INC	19,784	121.33	2,400,392.72
COSTAR GROUP INC	3,834	911.92	3,496,301.28
EQUIFAX INC	11,579	151.90	1,758,850.10
IHS MARKIT LTD	35,672	91.15	3,251,502.80
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	15.64	545,038.36
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	100.41	2,008,902.87
ROBERT HALF INTL INC	9,566	62.11	594,144.26
ROLLINS INC	14,566	56.94	829,388.04
TRANSUNION	17,091	95.45	1,631,335.95
VERISK ANALYTICS INC	14,560	196.31	2,858,273.60
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	106.27	2,617,323.83
WASTE MANAGEMENT INC	39,877	120.96	4,823,521.92
AMERCO	1,000	388.71	388,710.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	93.92	1,238,429.12
CSX CORP	72,242	88.20	6,371,744.40
DELTA AIR LINES INC	12,549	36.77	461,426.73
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	87.31	1,385,435.08
FEDEX CORP	23,427	263.88	6,181,916.76
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	124.31	1,034,134.89
KANSAS CITY SOUTHERN	8,711	184.31	1,605,524.41
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	38.69	413,983.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,186	230.42	5,572,938.12
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,013	199.29	1,796,200.77
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	43.89	503,198.85
UBER TECHNOLOGIES INC	87,546	48.18	4,217,966.28
UNION PACIFIC CORP	63,856	198.00	12,643,488.00
UNITED PARCEL SERVICE B	66,291	163.22	10,820,017.02

XPO LOGISTICS INC	8,001	99.30	794,499.30
APTIV PLC	24,462	106.69	2,609,850.78
AUTOLIV INC	6,776	83.83	568,032.08
BORGWARNER INC	23,790	37.99	903,782.10
FORD MOTOR COMPANY	370,912	8.20	3,041,478.40
GENERAL MOTORS CO	119,364	38.96	4,650,421.44
LEAR CORP	5,287	135.41	715,912.67
TESLA INC	69,867	421.26	29,432,172.42
DR HORTON INC	32,171	64.95	2,089,506.45
GARMIN LTD	12,854	115.27	1,481,680.58
HASBRO INC	12,468	85.40	1,064,767.20
LENNAR CORP-CL A	24,928	70.40	1,754,931.20
LULULEMON ATHLETICA INC	11,527	326.96	3,768,867.92
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	122.23	618,728.26
NEWELL BRANDS INC	37,563	19.11	717,828.93
NIKE B	116,668	128.95	15,044,338.60
NVR INC	337	3,974.91	1,339,544.67
PELOTON INTERACTIVE INC-A	18,478	100.01	1,847,984.78
PULTE GROUP INC	26,783	40.64	1,088,461.12
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	81.74	374,205.72
VF CORP	31,438	77.81	2,446,190.78
WHIRLPOOL CORP	6,079	180.69	1,098,414.51
ARAMARK	24,034	35.12	844,074.08
CARNIVAL CORPORATION	40,341	19.25	776,564.25
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,444	1,278.13	3,123,749.72
DARDEN RESTAURANTS INC	13,347	120.55	1,608,980.85
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	376.55	1,401,142.55
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,491	104.19	2,655,907.29
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	57.87	1,915,497.00
MARRIOTT INTL A	26,161	118.30	3,094,846.30
MCDONALD'S CORP	69,943	213.22	14,913,246.46
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	18.89	333,635.18
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,847	25.30	1,033,429.10
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,603	75.43	1,176,934.29
STARBUCKS CORP	110,010	95.88	10,547,758.80
VAIL RESORTS INC	3,574	269.85	964,443.90
WYNN RESORTS LTD	9,302	102.24	951,036.48
YUM BRANDS INC	29,466	101.98	3,004,942.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	72,713	75.41	5,483,287.33
ALPHABET INC-CL A	28,190	1,761.42	49,654,429.80
ALPHABET INC-CL C	28,424	1,763.00	50,111,512.00
ALTICE USA INC- A	29,505	29.42	868,037.10

CABLE ONE INC	501	1,891.99	947,886.99
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,617	613.20	8,349,944.40
COMCAST CORP-CL A	428,273	47.18	20,205,920.14
DISCOVERY INC - A	12,804	22.12	283,224.48
DISCOVERY INC-C	28,190	20.11	566,900.90
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	28.04	675,968.63
ELECTRONIC ARTS INC	26,822	116.97	3,137,369.34
FACEBOOK INC-A	226,861	278.77	63,242,040.97
FOX CORP - CLASS A	33,968	26.25	891,660.00
FOX CORP- CLASS B	15,092	26.19	395,259.48
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	136.25	1,065,611.25
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	21.09	713,559.06
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	145.15	374,341.85
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	145.55	1,484,755.55
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	40.93	765,104.49
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	39.65	684,517.60
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	39.59	252,742.56
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	64.36	895,118.88
MATCH GROUP INC	23,371	137.22	3,206,968.62
NETFLIX INC	41,353	470.50	19,456,586.50
NEWS CORP-CLASS A	33,479	15.66	524,448.53
OMNICOM GROUP	20,835	55.49	1,156,134.15
PINTEREST INC- CLASS A	40,003	57.75	2,310,173.25
ROKU INC	9,741	221.91	2,161,625.31
SIRIUS XM HOLDINGS INC	114,917	6.05	695,247.85
SNAP INC - A	84,912	41.10	3,489,883.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,751	159.99	1,720,052.49
THE WALT DISNEY CO	169,806	142.59	24,212,637.54
TWITTER INC	75,690	43.19	3,269,051.10
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	29.05	1,568,002.80
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	104.12	1,287,756.16
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	156.63	968,913.18
AMAZON.COM	39,938	3,143.74	125,554,688.12
AUTOZONE INC	2,216	1,151.39	2,551,480.24
BEST BUY COMPANY INC	22,912	111.00	2,543,232.00
BOOKING HOLDINGS INC	3,859	2,118.24	8,174,288.16
BURLINGTON STORES INC	5,808	236.40	1,373,011.20
CARMAX INC	15,563	95.97	1,493,581.11
DOLLAR GENERAL CORP	23,780	210.49	5,005,452.20
DOLLAR TREE INC	22,651	95.87	2,171,551.37
EBAY	66,540	48.32	3,215,212.80
EXPEDIA GROUP INC	13,028	128.64	1,675,921.92

GENUINE PARTS CO	13,937	98.49	1,372,655.13
HOME DEPOT	101,081	269.97	27,288,837.57
LKQ CORP	29,351	35.44	1,040,199.44
LOWES COMPANIES	71,063	153.45	10,904,617.35
MERCADOLIBRE INC	4,293	1,330.72	5,712,780.96
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,031	455.04	3,199,386.24
ROSS STORES INC	33,683	107.82	3,631,701.06
TARGET (DAYTON HUDSON)	47,144	154.91	7,303,077.04
TIFFANY & CO	10,426	131.16	1,367,474.16
TJX COMPANIES INC	112,998	60.90	6,881,578.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	129.60	1,453,075.20
ULTA BEAUTY INC	5,150	247.20	1,273,080.00
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	235.33	1,411,980.00
COSTCO WHOLESALE CORP	41,539	365.00	15,161,735.00
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	4.24	143,736.00
KROGER CO	71,185	31.01	2,207,446.85
SYSCO CORP	45,437	71.08	3,229,661.96
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,566	39.78	2,688,113.31
WALMART INC	133,237	143.54	19,124,838.98
ALTRIA GROUP INC	175,164	38.17	6,686,009.88
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	49.29	2,572,395.81
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	76.98	2,233,189.80
BUNGE LIMITED	13,606	56.85	773,501.10
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	46.12	731,878.28
COCA-COLA CO	383,648	52.57	20,168,375.36
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,884	39.30	820,741.20
CONAGRA BRANDS INC	45,992	34.38	1,581,204.96
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,911	200.75	3,194,133.25
GENERAL MILLS INC	58,696	58.36	3,425,498.56
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	149.72	2,080,509.12
HORMEL FOODS CORP	27,157	49.49	1,343,999.93
INGREDION INC	5,835	73.02	426,071.70
JM SMUCKER CO	10,802	113.26	1,223,434.52
KELLOGG CO	24,092	62.96	1,516,832.32
KEURIG DR PEPPER INC	31,200	27.73	865,176.00
KRAFT HEINZ CO/THE	66,798	30.62	2,045,354.76
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	75.87	980,543.88
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,757	178.32	2,096,508.24
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	41.16	749,235.48
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	134,530	55.92	7,522,917.60
MONSTER BEVERAGE CORP	37,118	81.35	3,019,549.30
PEPSICO INC	130,482	138.45	18,065,232.90

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146,553	71.63	10,497,591.39
TYSON FOODS INC	28,214	60.35	1,702,714.90
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	84.83	1,989,602.82
CLOROX COMPANY	11,960	194.91	2,331,123.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	76,780	81.78	6,279,068.40
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,239	246.21	5,229,254.19
KIMBERLY-CLARK CORP	32,173	132.66	4,268,070.18
PROCTER & GAMBLE CO	232,638	137.99	32,101,717.62
ABBOTT LABORATORIES	166,348	109.39	18,196,807.72
ABIOMED INC	4,421	279.61	1,236,155.81
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	476.99	3,392,829.87
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	106.26	1,551,821.04
ANTHEM INC	23,782	322.41	7,667,554.62
BAXTER INTERNATIONAL	47,484	80.97	3,844,779.48
BECTON DICKINSON & CO	27,332	240.31	6,568,152.92
BOSTON SCIENTIFIC CORP	134,860	38.21	5,153,000.60
CARDINAL HEALTH	27,968	55.41	1,549,706.88
CENTENE CORP	54,883	68.82	3,777,048.06
CERNER CORP	27,382	73.87	2,022,708.34
CIGNA CORP	34,815	211.20	7,352,928.00
CVS HEALTH CORP	123,229	67.53	8,321,654.37
DANAHER CORP	60,004	233.78	14,027,735.12
DAVITA INC	7,259	102.33	742,813.47
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	51.40	1,037,663.20
DEXCOM INC	8,490	343.84	2,919,201.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	58,536	84.00	4,917,024.00
HCA HEALTHCARE INC	25,577	147.32	3,768,003.64
HENRY SCHEIN INC	14,096	68.00	958,528.00
HOLOGIC INC	24,459	68.35	1,671,772.65
HUMANA INC	12,486	422.99	5,281,453.14
IDEXX LABORATORIES INC	8,212	436.45	3,584,127.40
INSULET CORP	5,923	255.33	1,512,319.59
INTUITIVE SURGICAL INC	10,990	773.45	8,500,215.50
LABORATORY CRP OF AMER	9,714	198.55	1,928,714.70
MASIMO CORP	4,504	242.20	1,090,868.80
MCKESSON CORP	15,393	178.51	2,747,804.43
MEDTRONIC PLC	126,184	113.22	14,286,552.48
MOLINA HEALTHCARE INC	5,724	207.10	1,185,440.40
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	120.32	1,551,406.08
RESMED INC	13,491	220.59	2,975,979.69
STERIS PLC	8,111	190.05	1,541,495.55
STRYKER CORP	31,863	234.35	7,467,094.05



TELADOC HEALTH INC	11,015	177.98	1,960,449.70
TELEFLEX INC	4,427	363.96	1,611,250.92
THE COOPER COS INC	5,096	351.74	1,792,467.04
UNITEDHEALTH GROUP INC	89,134	350.00	31,196,900.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	126.77	918,828.96
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	172.98	1,424,836.26
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	13,025	269.04	3,504,246.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,017	286.54	2,010,651.18
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,627	155.95	3,060,830.65
ABBVIE INC	166,147	95.12	15,803,902.64
AGILENT TECHNOLOGIES	29,371	112.50	3,304,237.50
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	124.88	2,588,262.88
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	127.48	1,359,574.20
AMGEN	55,348	235.00	13,006,780.00
AVANTOR INC	44,570	26.81	1,194,921.70
BEIGENE LTD-ADR	3,859	280.00	1,080,520.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	579.96	1,241,694.36
BIOGEN INC	15,428	236.26	3,645,019.28
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	75.09	1,289,370.39
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	212,929	64.08	13,644,490.32
CATALENT INC	13,739	101.91	1,400,141.49
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	31.06	1,120,054.66
EXACT SCIENCES CORP	15,478	123.16	1,906,270.48
GILEAD SCIENCES INC	118,215	59.05	6,980,595.75
ILLUMINA INC	13,885	305.69	4,244,505.65
INCYTE CORP	17,504	81.28	1,422,725.12
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	50.10	642,131.70
IQVIA HOLDINGS INC	17,736	173.66	3,080,033.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	146.18	726,660.78
JOHNSON & JOHNSON	247,547	146.08	36,161,665.76
LILLY (ELI) & CO	81,065	142.33	11,537,981.45
MERCK & CO	237,327	80.50	19,104,823.50
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	1,179.58	2,667,030.38
MODERNA INC	25,034	77.74	1,946,143.16
MYLAN NV	49,481	15.12	748,152.72
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	102.81	871,211.94
PERKINELMER INC	10,645	128.09	1,363,518.05
PERRIGO CO PLC	13,392	46.03	616,433.76
PFIZER	522,315	39.20	20,474,748.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,523	567.55	5,404,778.65
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	125.56	897,377.32
SEAGEN INC	11,471	168.46	1,932,404.66

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	9.67	1,049,040.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,148	484.99	18,016,408.52
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,454	222.85	5,449,573.90
WATERS CORP	5,957	230.44	1,372,731.08
ZOETIS INC	44,775	165.20	7,396,830.00
BANK OF AMERICA CORP	734,208	27.76	20,381,614.08
CITIGROUP	196,067	47.64	9,340,631.88
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	32.33	1,293,523.30
COMERICA INC	14,360	53.93	774,434.80
EAST WEST BANCORP INC	13,827	45.52	629,405.04
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	26.56	1,804,512.96
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	137.24	2,178,273.28
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	11.95	1,183,193.40
JPMORGAN CHASE & CO	286,357	116.90	33,475,133.30
KEY CORP	94,322	15.20	1,433,694.40
M & T BANK CORP	11,721	123.92	1,452,466.32
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	12.77	468,914.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,092	127.98	5,130,974.16
REGIONS FINL CORP	92,434	15.22	1,406,845.48
SIGNATURE BANK	5,223	97.96	511,645.08
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	332.04	1,641,273.72
TRUIST FINANCIAL CORP	127,255	48.52	6,174,412.60
US BANCORP	128,061	44.16	5,655,173.76
WELLS FARGO & CO	366,879	24.22	8,885,809.38
ZIONS BANCORPORATION	15,186	39.58	601,061.88
ALLY FINANCIAL INC	36,028	29.87	1,076,156.36
AMERICAN EXPRESS	64,516	117.37	7,572,242.92
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,676	182.94	2,136,007.44
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	44.00	666,732.00
BANK NEW YORK CO	73,913	39.16	2,894,433.08
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	130,701	221.50	28,950,271.50
BLACKROCK INC	14,366	666.02	9,568,043.32
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,438	56.04	3,499,025.52
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,052	86.95	3,656,421.40
CARLYLE GROUP INC/THE	16,087	27.66	444,966.42
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	87.20	925,366.40
CME GROUP INC	33,845	162.41	5,496,766.45
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	76.19	2,110,767.76
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	24.18	972,398.70
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	316.71	1,150,607.43
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	20.42	532,349.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,819	214.93	6,623,927.67

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	51,672	98.22	5,075,223.84
INVESCO LTD	44,943	14.84	666,954.12
KKR & CO INC	47,403	38.01	1,801,788.03
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	534.84	1,921,680.12
MOODY'S CORP	15,637	275.45	4,307,211.65
MORGAN STANLEY	127,048	56.02	7,117,228.96
MSCI INC	7,815	390.46	3,051,444.90
NASDAQ INC	10,979	129.68	1,423,756.72
NORTHERN TRUST CORP	17,625	90.80	1,600,350.00
PRICE T ROWE GROUP INC	21,597	137.03	2,959,436.91
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	85.59	1,024,341.12
S&P GLOBAL INC	22,701	346.41	7,863,853.41
SCHWAB (CHARLES) CORP	143,656	44.96	6,458,773.76
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	55.85	684,776.85
STATE STREET CORP	31,754	70.10	2,225,955.40
SYNCHRONY FINANCIAL	46,378	29.85	1,384,383.30
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	58.58	530,793.38
VOYA FINANCIAL INC	12,505	53.43	668,142.15
AFLAC	62,907	41.49	2,610,011.43
ALLEGHANY CORP	1,276	624.83	797,283.08
ALLSTATE CORP	29,185	93.89	2,740,179.65
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	84.14	531,680.66
AMERICAN INT'L GROUP	85,292	37.52	3,200,155.84
AON PLC	21,468	192.91	4,141,391.88
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	34.44	1,336,134.24
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	109.98	1,961,273.34
ASSURANT INC	5,819	131.80	766,944.20
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	40.58	414,200.06
BROWN & BROWN INC	22,945	45.92	1,053,634.40
CHUBB LTD	42,622	146.98	6,264,581.56
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	85.73	1,273,176.23
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	231.76	501,992.16
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	231.69	909,614.94
FNF GROUP	24,961	33.31	831,450.91
GLOBE LIFE INC	9,867	91.47	902,534.49
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	44.87	1,547,162.47
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	42.63	697,597.32
LOEWS CORP	25,707	42.55	1,093,832.85
MARKEL CORP	1,312	1,027.89	1,348,591.68
MARSH & MCLENNAN COS	48,155	110.58	5,324,979.90
METLIFE INC	73,194	44.94	3,289,338.36
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	47.64	1,267,938.60

PROGRESSIVE CORP	55,260	90.39	4,994,951.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,511	73.45	2,755,182.95
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	126.79	843,407.08
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	170.36	828,631.04
TRAVELERS COS INC/THE	23,997	134.28	3,222,317.16
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	196.00	2,355,136.00
MR BERKLEY CORP	14,085	69.22	974,963.70
CBRE GROUP INC-A	30,111	58.15	1,750,954.65
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.90	384,930.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	137.13	614,890.92
WEYERHAEUSER CO	69,607	28.14	1,958,740.98
ACCENTURE PLC-CL A	59,931	240.22	14,396,624.82
ADOBE INC	45,295	471.14	21,340,286.30
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	15,447	99.27	1,533,423.69
ANSYS INC	8,044	328.47	2,642,212.68
AUTODESK INC	20,707	262.61	5,437,865.27
AUTOMATIC DATA PROCESS	40,567	169.89	6,891,927.63
AVALARA INC	7,698	153.84	1,184,260.32
BLACK KNIGHT INC	14,413	86.77	1,250,616.01
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	86.46	1,161,849.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	146.88	1,611,420.48
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,500	118.57	3,142,105.00
CDK GLOBAL INC	10,687	49.06	524,304.22
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	119.52	1,253,286.72
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	114.65	1,197,404.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	51,182	73.88	3,781,326.16
COUPA SOFTWARE INC	6,059	285.56	1,730,208.04
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,009	126.55	1,772,838.95
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	105.54	327,174.00
DATADOG INC - CLASS A	13,055	94.89	1,238,788.95
DOCUSIGN INC	16,480	197.60	3,256,448.00
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	18.75	454,068.75
DYNATRACE INC	17,890	35.49	634,916.10
EPAM SYSTEMS INC	5,266	318.54	1,677,431.64
FAIR ISAAC CORP	2,615	430.50	1,125,757.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	58,208	141.69	8,247,491.52
FISERV INC	53,732	109.10	5,862,161.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,994	269.12	2,151,345.28
FORTINET INC	12,295	117.11	1,439,867.45
GARTNER INC	8,569	155.85	1,335,478.65
GLOBAL PAYMENTS INC	27,817	193.66	5,387,040.22
GODADDY INC - CLASS A	15,914	70.63	1,124,005.82

GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	109.25	865,587.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,603	115.53	9,658,654.59
INTUIT INC	24,576	360.14	8,850,800.64
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	158.83	1,168,988.80
LEIDOS HOLDINGS	12,829	94.63	1,214,008.27
MASTERCARD INC-CLASS A	83,996	344.56	28,941,661.76
MICROSOFT CORP	678,610	218.39	148,201,637.90
MONGODB INC	4,623	239.89	1,109,011.47
NORTONLIFELOCK INC	50,376	19.46	980,316.96
OKTA INC	11,056	217.39	2,403,463.84
ORACLE CORP	192,947	56.84	10,967,107.48
PALO ALTO NETWORKS INC	8,711	252.13	2,196,304.43
PAYCHEX INC	30,214	90.59	2,737,086.26
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	405.05	1,926,012.75
PAYPAL HOLDINGS INC	104,882	184.72	19,373,803.04
PTC INC	9,984	92.91	927,613.44
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,982	267.01	1,864,263.82
SALESFORCE.COM INC	84,561	259.28	21,924,976.08
SERVICENOW INC	17,969	501.96	9,019,719.24
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	37,111	25.79	957,092.69
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,750	239.84	659,560.00
SPLUNK INC	14,752	196.32	2,896,112.64
SQUARE INC - A	34,285	184.08	6,311,182.80
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	64.54	1,405,358.50
SYNOPSYS INC	14,302	233.79	3,343,664.58
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,705	761.37	2,820,875.85
TWILIO INC - A	11,282	274.00	3,091,268.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	420.42	1,561,019.46
VERISIGN INC	9,910	203.46	2,016,288.60
VISA INC-CLASS A SHARES	158,538	212.68	33,717,861.84
VMWARE INC-CLASS A	7,867	140.86	1,108,145.62
WESTERN UNION CO	38,757	21.44	830,950.08
WIX.COM LTD	5,010	254.00	1,272,540.00
WORKDAY INC-CLASS A	16,479	223.40	3,681,408.60
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	15,018	413.24	6,206,038.32
ZSCALER INC	6,234	128.77	802,752.18
AMPHENOL CORPORATION	27,456	121.59	3,338,375.04
APPLE INC	1,632,757	116.32	189,922,294.24
ARISTA NETWORKS INC	5,179	261.68	1,355,240.72
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	85.74	672,115.86
CDW CORP/DE	13,742	143.95	1,978,160.90
CISCO SYSTEMS	397,144	38.20	15,170,900.80

COGNEX CORP	16,230	70.54	1,144,864.20
CORNING	72,399	35.68	2,583,196.32
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	64.24	1,383,087.20
F5 NETWORKS INC	5,350	154.97	829,089.50
FLIR SYSTEMS INC	11,686	36.85	430,629.10
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	9.73	1,204,369.67
HP INC	135,773	19.73	2,678,801.29
IPG PHOTONICS CORP	3,207	204.34	655,318.38
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	21.42	670,531.68
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	115.56	2,036,629.44
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,158	170.26	2,751,061.08
NETAPP INC	20,586	49.65	1,022,094.90
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	54.15	1,236,569.40
TE CONNECTIVITY LTD	31,267	105.86	3,309,924.62
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	57.54	1,374,285.36
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	41.48	1,180,271.92
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	352.71	1,820,689.02
AT&T INC	669,946	28.30	18,959,471.80
CENTURYLINK INC	93,962	9.25	869,148.50
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	19.89	308,613.24
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	19.29	649,687.20
T-MOBILE US INC	53,428	122.78	6,559,889.84
VERIZON COMMUNICATIONS	388,985	59.84	23,276,862.40
AES CORP	61,761	20.97	1,295,128.17
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	56.63	1,367,954.28
AMEREN CORPORATION	23,120	83.04	1,919,884.80
AMERICAN ELECTRIC POWER	46,898	90.26	4,233,013.48
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	162.33	2,746,948.26
ATMOS ENERGY CORP	11,419	97.79	1,116,664.01
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	23.73	1,142,884.26
CMS ENERGY CORP	26,742	66.14	1,768,715.88
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	79.28	2,516,743.60
DOMINION ENERGY INC	79,161	84.02	6,651,107.22
DTE ENERGY COMPANY	18,360	128.81	2,364,951.60
DUKE ENERGY CORP	69,344	95.40	6,615,417.60
EDISON INTL	37,630	60.76	2,286,398.80
ENTERGY CORP	18,696	109.15	2,040,668.40
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	44.93	936,071.62
EVERGY INC	21,330	57.99	1,236,926.70
EVERSOURCE ENERGY	30,920	93.53	2,891,947.60
EXELON CORP	92,303	43.32	3,998,565.96
FIRSTENERGY CORP	50,559	29.52	1,492,501.68

	NEXTERA ENERGY INC	184,228	75.51	13,911,056.28
	NISOURCE INC	35,781	24.11	862,679.91
	NRG ENERGY INC	23,078	31.92	736,649.76
	OGE ENERGY CORP	19,225	32.66	627,888.50
	PG&E CORP	92,713	10.42	966,069.46
	PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	87.94	947,289.68
	PPL CORPORATION	69,904	28.75	2,009,740.00
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	60.38	2,855,370.20
	SEMPRA ENERGY	27,061	130.39	3,528,483.79
	SOUTHERN CO	99,701	62.32	6,213,366.32
	UGI CORP	18,019	34.36	619,132.84
	VISTRA CORP	37,797	18.91	714,741.27
	WEC ENERGY GROUP INC	29,921	103.83	3,106,697.43
	XCEL ENERGY INC	49,733	73.43	3,651,894.19
	ADVANCED MICRO DEVICES	110,338	83.12	9,171,294.56
	ANALOG DEVICES	34,849	135.82	4,733,191.18
	APPLIED MATERIALS	88,168	71.30	6,286,378.40
	BROADCOM INC	37,616	375.54	14,126,312.64
	INTEL CORP	398,108	45.60	18,153,724.80
	KLA CORP	15,078	232.32	3,502,920.96
	LAM RESEARCH CORP	13,726	416.28	5,713,859.28
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	61,408	42.21	2,592,031.68
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,481	81.07	2,065,744.67
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	126.51	2,889,994.44
	MICRON TECHNOLOGY	105,024	55.96	5,877,143.04
	NVIDIA CORP	57,796	545.23	31,512,113.08
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,742	144.86	3,728,986.12
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	27.53	990,969.88
	QORVO INC	10,609	149.48	1,585,833.32
	QUALCOMM	105,875	142.61	15,098,833.75
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,879	144.58	2,295,785.82
	TERADYNE INC	16,048	101.53	1,629,353.44
	TEXAS INSTRUMENTS	86,379	156.22	13,494,127.38
	XILINX INC	23,457	130.35	3,057,619.95
	アメリカドル 小計	29,296,098		2,905,127,171.62 (305,648,429,726)
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	12.41	509,579.42
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,748	26.19	2,795,730.12
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	5.62	543,262.92
	ENBRIDGE	192,558	37.83	7,284,469.14
	IMPERIAL OIL	24,763	21.63	535,623.69
	INTER PIPELINE LTD	35,455	12.35	437,869.25

KEYERA CORP	18,607	19.68	366,185.76
PARKLAND CORP	17,004	39.13	665,366.52
PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	28.41	1,528,912.56
SUNCOR ENERGY	137,891	19.05	2,626,823.55
TC ENERGY CORP	86,686	53.39	4,628,165.54
AGNICO EAGLE MINES	23,423	98.87	2,315,832.01
B2GOLD CORP	90,243	8.38	756,236.34
BARRICK GOLD CORP	170,376	34.85	5,937,603.60
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	56.28	739,462.92
FRANCO-NEVADA CORP	18,443	185.26	3,416,750.18
KINROSS GOLD CORP	125,340	10.48	1,313,563.20
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	58.77	1,376,863.56
LUNDIN MINING CORP	62,243	8.86	551,472.98
NUTRIEN LTD	55,624	53.26	2,962,534.24
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	43.89	808,058.79
SSR MINING INC	21,000	25.14	527,940.00
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	19.66	898,009.82
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	43,718	60.62	2,650,185.16
YAMANA GOLD INC	81,672	7.27	593,755.44
CAE INC	25,999	27.90	725,372.10
WSP GLOBAL INC	12,471	90.06	1,123,138.26
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	11,410	90.83	1,036,370.30
THOMSON REUTERS CORP	17,691	109.67	1,940,171.97
AIR CANADA	19,591	20.35	398,676.85
CANADIAN NATL RAILWAY CO	67,468	140.46	9,476,555.28
CP RAILWAY LIMITED	12,980	423.49	5,496,900.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	78.51	2,196,552.78
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,923	30.88	646,102.24
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,357	75.56	1,915,974.92
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.11	503,272.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	22.78	1,027,081.86
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	161.96	876,041.64
DOLLARAMA INC	26,700	49.06	1,309,902.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	82,854	45.03	3,730,915.62
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	36.16	551,548.48
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	66.00	1,181,862.00
METRO INC	24,937	62.80	1,566,043.60
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	99.01	681,485.83
SAPUTO INC	24,489	33.87	829,442.43
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	24.94	693,332.00
CANOPY GROWTH CORP	25,606	31.95	818,111.70
CRONOS GROUP INC	15,900	9.42	149,778.00



	BANK MONTREAL	61,268	84.89	5,201,040.52	
	BANK NOVA SCOTIA	112,518	59.78	6,726,326.04	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	42,756	102.16	4,367,952.96	
	NATIONAL BANK OF CANADA	33,495	67.60	2,264,262.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	134,643	97.67	13,150,581.81	
	TORONTO-DOMINION BANK	171,416	62.89	10,780,352.24	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	127,786	46.70	5,967,606.20	
	CI FINANCIAL CORP	18,671	16.69	311,618.99	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	33.14	254,680.90	
	ONEX CORP	6,603	61.63	406,942.89	
	TMX GROUP LTD	4,685	129.00	604,365.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	399.57	1,064,054.91	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	28.67	682,001.96	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	55.08	453,308.40	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	138.77	1,809,977.11	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	178,574	20.89	3,730,410.86	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	27.34	1,409,404.34	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	57,771	58.96	3,406,178.16	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.43	253,342.00	
	CGI INC - CL A	20,486	90.59	1,855,826.74	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,845	1,522.72	2,809,418.40	
	OPEN TEXT CORP	24,643	52.87	1,302,875.41	
	SHOPIFY INC - CLASS A	10,174	1,173.53	11,939,494.22	
	BCE INC	15,355	54.82	841,761.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	57.00	1,996,026.00	
	TELUS CORP	32,908	24.03	790,779.24	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	20.96	1,086,105.28	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	17.43	425,204.85	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	38.44	201,464.04	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.35	323,657.40	
	EMERA INC	23,704	55.77	1,321,972.08	
	FORTIS INC	42,633	54.43	2,320,514.19	
	HYDRO ONE LTD	32,299	29.73	960,249.27	
	カナダドル 小計	3,607,275		176,664,644.28 (14,279,803,197)	
ユーロ	ENI	229,512	7.37	1,693,339.53	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.26	406,342.44	
	NESTE OIL OYJ	40,117	51.20	2,053,990.40	
	OMV AG	14,984	23.54	352,723.36	
	REPSOL SA	140,401	6.82	958,096.42	
	TENARIS SA	40,648	5.51	224,133.07	
	TOTAL SE	234,041	31.79	7,441,333.59	

VOPAK	6,360	45.80	291,288.00
AIR LIQUIDE	44,893	142.15	6,381,539.95
AKZO NOBEL	17,285	86.64	1,497,572.40
ARCELORMITTAL	66,229	13.58	899,522.27
ARKEMA	5,949	91.02	541,477.98
BASF SE	85,260	55.73	4,751,539.80
COVESTRO AG	19,098	44.22	844,513.56
CRH PLC	72,257	32.26	2,331,010.82
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	22.89	452,169.06
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	46.22	266,319.64
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	56.26	834,504.58
KONINKLIJKE DSM NV	16,650	140.30	2,335,995.00
LANXESS	7,293	48.80	355,898.40
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	35.16	687,905.40
SOLVAY SA	6,906	82.76	571,540.56
STORA ENSO OYJ R	54,792	13.53	741,609.72
SYMRISE AG	12,620	104.85	1,323,207.00
THYSSEN KRUPP	33,044	4.76	157,454.66
UMICORE	17,605	33.26	585,542.30
UPM KYMMENE OYJ	50,623	26.14	1,323,285.22
VOESTALPINE AG	12,422	25.22	313,282.84
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,394	24.73	578,533.62
AIRBUS SE	56,097	83.00	4,656,051.00
ALSTOM	18,760	42.65	800,114.00
ANDRITZ AG	5,242	32.58	170,784.36
BOUYGUES ORD	19,381	32.59	631,626.79
BRENTAG AG	15,254	58.98	899,680.92
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	8.21	764,115.56
DASSAULT AVIATION SA	213	824.00	175,512.00
EIFFAGE	7,209	79.72	574,701.48
FERROVIAL SA	46,711	22.61	1,056,135.71
FERROVIAL SA-RTS	46,711	0.22	10,509.97
GEA GROUP AG	13,382	28.84	385,936.88
HOCHTIEF AG	2,222	72.10	160,206.20
KINGSPAN GROUP PLC	15,358	79.30	1,217,889.40
KION GROUP AG	5,887	71.54	421,155.98
KNORR-BREMSE AG	7,434	104.34	775,663.56
KONE OYJ-B	32,785	74.20	2,432,647.00
LEGRAND SA	24,584	72.00	1,770,048.00
LEONARDO SPA	35,425	5.04	178,754.55
MTU AERO ENGINES AG	4,753	191.50	910,199.50
PRYSMIAN SPA	21,155	26.14	552,991.70

SAFRAN SA	29,413	113.00	3,323,669.00
SAINT-GOBAIN	51,472	38.96	2,005,349.12
SCHNEIDER ELECTRIC SE	51,910	118.80	6,166,908.00
SIEMENS	72,363	116.48	8,428,842.24
SIEMENS ENERGY AG	36,181	21.17	765,951.77
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	25.36	636,586.72
THALES SA	9,665	71.96	695,493.40
VINCI S.A.	49,191	87.40	4,299,293.40
WARTSILA OYJ	34,386	7.92	272,337.12
BUREAU VERITAS SA	25,073	20.98	526,031.54
RANDSTAD NV	12,365	49.56	612,809.40
TELEPERFORMANCE	5,757	277.50	1,597,567.50
WOLTERS KLUWER	25,709	74.86	1,924,575.74
ADP	2,382	107.90	257,017.80
AENA SME SA	6,542	141.20	923,730.40
ATLANTIA SPA	53,427	15.12	807,816.24
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.91	207,446.60
DEUTSCHE POST AG-REG	91,113	40.50	3,690,076.50
FRAPORT AG	3,561	44.10	157,040.10
GETLINK	44,101	13.98	616,531.98
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,073	67.63	2,169,096.99
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	50.90	254,041.90
CONTINENTAL AG	9,928	102.40	1,016,627.20
DAIMLER AG	78,738	50.70	3,992,016.60
FAURECIA	5,945	35.16	209,026.20
FERRARI NV	12,192	178.55	2,176,881.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	111,140	11.92	1,325,011.08
MICHELIN	16,591	100.95	1,674,861.45
PEUGEOT SA	52,883	17.71	936,557.93
PIRELLI & C SPA	39,097	4.21	164,832.95
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	52.84	741,239.52
RENAULT SA	17,362	26.14	453,842.68
VALEO SA	19,350	29.54	571,599.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,850	142.32	2,540,412.00
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	150.90	490,575.90
ADIDAS AG	17,675	298.80	5,281,290.00
ESSILORLUXOTTICA	27,274	120.50	3,286,517.00
HERMES INTERNATIONAL	3,059	838.60	2,565,277.40
KERING	7,223	601.70	4,346,079.10
LVMH	26,228	468.85	12,296,997.80
MONCLER SPA	16,489	39.68	654,283.52
PUMA SE	9,220	84.40	778,168.00

SEB SA	2,075	143.10	296,932.50
ACCOR	17,931	27.96	501,350.76
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,932	148.40	2,067,508.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	33.75	273,645.00
SODEXO	8,135	71.14	578,723.90
BOLLORE	61,805	3.28	202,720.40
JC DECAUX SA	9,522	18.76	178,632.72
PUBLICIS GROUPE	21,469	35.53	762,793.57
SCOUT24 AG	9,470	69.65	659,585.50
SES	31,369	7.69	241,353.08
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	32.48	162,335.04
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	75.90	706,704.90
VIVENDI	77,307	25.77	1,992,201.39
DELIVERY HERO SE	11,471	105.80	1,213,631.80
INDITEX	101,980	26.49	2,701,450.20
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	93.50	1,063,282.00
PROSUS	45,138	96.50	4,355,817.00
ZALANDO SE	13,985	79.38	1,110,129.30
CARREFOUR	59,235	14.16	838,767.60
COLRUYT SA	5,424	48.71	264,203.04
JERONIMO MARTINS	24,901	14.24	354,590.24
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	23.30	2,406,051.20
METRO AG	13,712	8.56	117,374.72
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,865	53.10	3,869,131.50
DANONE (GROUPE)	59,079	52.72	3,114,644.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.57	469,863.19
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	78.40	838,958.40
HEINEKEN NV	24,387	90.28	2,201,658.36
KERRY GROUP PLC-A	14,641	111.50	1,632,471.50
PERNOD-RICARD	19,514	158.45	3,091,993.30
REMY COINTREAU	2,382	151.40	360,634.80
BEIERSDORF AG	9,190	98.44	904,663.60
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	85.15	867,678.50
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,429	92.12	1,605,559.48
LOREAL	23,853	311.00	7,418,283.00
UNILEVER NV	138,370	52.22	7,225,681.40
BIOMERIEUX	4,175	118.10	493,067.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	119.60	410,228.00
DIASORIN SPA	2,070	168.00	347,760.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	73.22	1,463,301.70
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,897	37.42	1,530,365.74
KONINKLIJKE PHILIPS	84,867	44.59	3,784,643.86

ORPEA	4,336	99.84	432,906.24
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	368.20	1,195,177.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	39.18	961,712.28
ARGENX SE	3,898	217.00	845,866.00
BAYER	93,379	46.17	4,311,775.32
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	674.20	780,723.60
GALAPAGOS NV	4,368	103.80	453,398.40
GRIFOLS SA	27,685	26.30	728,115.50
IPSEN	2,722	84.75	230,689.50
MERCK KGAA	12,078	133.25	1,609,393.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	39.53	389,528.62
QIAGEN N.V.	21,801	39.07	851,765.07
RECORDATI SPA	11,220	45.92	515,222.40
SANOFI	106,863	84.93	9,075,874.59
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	320.20	774,563.80
UCB (GROUPE)	12,531	95.26	1,193,703.06
ABN AMRO BANK NV-CVA	47,345	8.35	395,330.75
BANCO BILBAO VIZCAYA	651,448	2.90	1,889,199.20
BANCO SANTANDER SA	1,595,095	2.13	3,398,349.89
BANKINTER SA	58,881	3.91	230,224.71
BNP PARIBAS	104,161	39.20	4,083,632.00
CAIXABANK	328,697	1.85	608,089.45
COMMERZBANK AG	107,299	4.60	493,682.69
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	8.45	908,062.35
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	20.44	563,326.40
FINECOBANK SPA	53,120	12.18	647,267.20
ING GROEP NV-CVA	375,036	6.92	2,598,624.44
INTESA SANPAOLO	1,588,144	1.76	2,804,344.67
KBC GROEP NV	24,002	49.96	1,199,139.92
MEDIOBANCA	53,990	7.16	386,784.36
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	14.55	181,729.50
SOCIETE GENERALE	79,076	15.48	1,224,729.08
UNICREDIT SPA	190,988	7.74	1,478,247.12
AMUNDI SA	6,226	66.45	413,717.70
DEUTSCHE BANK NAMEN	192,352	8.88	1,709,816.92
DEUTSCHE BOERSE	18,256	134.95	2,463,647.20
EURAZEO SA	3,357	46.34	155,563.38
EXOR NV	10,345	53.42	552,629.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,855	78.88	777,362.40
NATIXIS	114,996	2.25	259,660.96
SOFINA	1,238	241.50	298,977.00
WENDEL	2,023	88.05	178,125.15

AEGON	166,267	2.73	454,906.51
AGEAS	16,065	37.87	608,381.55
ALLIANZ SE-REG	39,513	186.00	7,349,418.00
ASSICURAZIONI GENERALI	98,533	13.16	1,296,694.28
AXA SA	185,254	17.36	3,216,379.94
CNP ASSURANCES	21,830	11.72	255,847.60
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	140.90	815,670.10
MAPFRE SA	90,939	1.52	138,954.79
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,412	231.80	3,108,901.60
NN GROUP NV	27,631	33.25	918,730.75
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.85	361,466.82
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	36.36	1,566,207.00
SCOR SE	13,354	28.20	376,582.80
AROUNDTOWN SA	111,346	4.74	527,780.04
DEUTSCHE WOHNEN SE	34,063	43.12	1,468,796.56
LEG IMMOBILIEN AG	6,992	116.66	815,686.72
VONOVIA SE	49,415	56.78	2,805,783.70
ADYEN NV	1,748	1,582.00	2,765,336.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	54.50	2,282,678.00
ATOS SE	9,750	65.80	641,550.00
CAPGEMINI SA	15,649	116.70	1,826,238.30
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	153.35	1,919,175.25
EDENRED	22,756	45.41	1,033,349.96
NEMETSCHKE SE	4,179	65.50	273,724.50
NEXI SPA	46,670	15.07	703,316.90
SAP SE	98,504	98.97	9,748,940.88
TEAMVIEWER AG	14,174	35.45	502,468.30
WORLDLINE SA	22,702	76.78	1,743,059.56
NOKIA OYJ	511,885	3.09	1,581,724.65
ALTICE NV -A	50,000	4.24	212,050.00
CELLNEX TELECOM SA	28,402	52.42	1,488,832.84
DEUTSCHE TELEKOM	317,072	14.69	4,657,787.68
ELISA A	14,943	45.04	673,032.72
ILIAD SA	1,253	166.75	208,937.75
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.85	299,193.75
KPN (KON.)	354,332	2.28	810,711.61
ORANGE	188,105	9.74	1,832,518.91
PROXIMUS	13,141	16.28	214,001.18
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.33	286,627.98
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.33	159,191.77
TELEFONICA	456,457	3.17	1,449,707.43
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	125,107	2.28	285,869.49

	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	29.57	281,299.41
	E.ON SE	203,050	9.32	1,894,050.40
	ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	10.94	670,829.86
	ELIA GROUP SA/NV	3,630	89.10	323,433.00
	ENAGAS	25,299	19.44	491,939.05
	ENDESA	31,750	24.17	767,397.50
	ENEL	771,969	8.05	6,215,122.41
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275,734	4.42	1,219,295.74
	ENGIE	171,054	11.76	2,011,595.04
	FORTUM OYJ	41,901	17.72	742,485.72
	IBERDROLA SA	563,697	11.06	6,237,307.30
	NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	18.20	549,517.92
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	16.21	642,434.72
	RWE STAMM	62,324	33.16	2,066,663.84
	SNAM SPA	203,694	4.55	928,029.86
	SUEZ	28,043	16.11	451,912.94
	TERNA SPA	130,230	6.26	816,281.64
	UNIPER SE	20,192	27.82	561,741.44
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	18.11	954,062.70
	VERBUND AG	7,463	54.35	405,614.05
	ASML HOLDING NV	40,167	354.70	14,247,234.90
	INFINEON TECHNOLOGIES	115,347	27.35	3,154,740.45
	STMICROELECTRONICS	56,957	30.45	1,734,340.65
	ユーロ 小計	18,026,847		375,565,304.04 (46,671,500,333)
イギリスポンド	BP PLC	1,924,816	2.29	4,426,114.39
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	390,521	11.33	4,427,727.09
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	353,674	10.90	3,857,875.99
	ANGLO AMERICAN PLC	112,174	20.49	2,299,006.13
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	10.98	393,698.88
	BHP GROUP PLC	195,828	16.31	3,194,346.33
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,371	62.22	707,503.62
	EVRAZ PLC	43,000	3.74	161,121.00
	GLENCORE PLC	901,837	1.80	1,624,929.90
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	23.55	396,770.40
	MONDI PLC	47,780	16.52	789,325.60
	RIO TINTO PLC REG	106,507	46.35	4,936,599.45
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	31.89	1,340,049.69
	BAE SYSTEMS PLC	313,092	4.41	1,383,553.54
	BUNZL PLC	33,283	24.60	818,761.80
	DCC PLC	9,127	56.02	511,294.54
	FERGUSON PLC	20,559	83.20	1,710,508.80

MELROSE INDUSTRIES PLC	508,486	1.46	743,152.28
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	889,390	1.00	889,390.00
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.58	541,588.68
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	116.30	843,756.50
EXPERIAN PLC	87,254	30.07	2,623,727.78
INTERTEK GROUP PLC	15,404	58.40	899,593.60
RELX PLC	184,573	18.36	3,389,683.14
RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	5.44	985,723.30
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.11	590,197.34
BURBERRY GROUP PLC	40,410	15.60	630,396.00
PERSIMMON PLC	31,506	27.90	879,017.40
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.46	520,553.47
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	46.25	490,203.75
COMPASS GROUP PLC	162,339	13.71	2,225,667.69
GVC HOLDINGS PLC	59,240	9.76	578,656.32
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	46.81	750,879.21
WHITBREAD PLC	17,434	26.90	468,974.60
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.86	571,079.62
INFORMA PLC	128,525	5.58	717,169.50
PEARSON	66,305	5.82	386,292.93
WPP PLC	113,065	7.21	815,198.65
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	8.10	259,456.00
KINGFISHER PLC	218,634	2.80	613,049.73
NEXT PLC	13,238	65.16	862,588.08
OCADO GROUP PLC	44,612	22.83	1,018,491.96
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.64	343,885.29
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.97	293,480.79
TESCO	919,600	2.18	2,013,004.40
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,908	19.77	611,205.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO	217,599	25.71	5,594,470.29
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.79	373,388.40
DIAGEO	221,648	29.02	6,432,224.96
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	12.61	1,152,755.76
RECKITT BENCKISER PLC	67,469	67.00	4,520,423.00
UNILEVER PLC	110,922	47.18	5,233,299.96
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	15.83	1,314,697.33
ASTRAZENECA	123,893	83.01	10,284,357.93
GLAXOSMITHKLINE	474,876	14.28	6,782,179.03
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	25.56	420,564.24
BARCLAYS	1,684,065	1.28	2,164,697.15
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,930,170	3.74	7,218,835.80
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.30	2,042,901.84



	NATWEST GROUP PLC	479,086	1.37	659,940.96
	STANDARD CHARTERED PLC	254,760	4.25	1,083,239.52
	3I GROUP PLC	88,121	10.59	933,201.39
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.66	518,182.53
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	28,781	85.64	2,464,804.84
	M&G PLC	229,107	1.76	404,144.74
	SCHRODERS PLC	11,794	29.97	353,466.18
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	10.71	479,272.50
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.58	602,216.98
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	28.10	456,765.50
	AVIVA PIC	381,270	3.04	1,161,348.42
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.91	331,365.51
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.22	1,221,395.16
	PRUDENTIAL	249,922	12.37	3,091,535.14
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.49	561,631.62
	AVEVA GROUP PLC	6,717	41.85	281,106.45
	SAGE GROUP PLC	95,210	6.83	650,284.30
	HALMA PLC	37,159	24.93	926,373.87
	BT GROUP PLC	817,227	1.05	865,852.00
	VODAFONE GROUP PLC	2,475,816	1.12	2,775,389.73
	NATIONAL GRID PLC	336,389	9.40	3,164,747.71
	SEVERN TRENT PLC	24,757	24.58	608,527.06
	SSE PLC	100,354	13.48	1,353,273.69
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.73	586,774.17
	イギリスポンド 小計	27,718,845		138,604,886.52 (19,199,548,880)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.65	307,074.70
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	820.50	667,066.50
	GIVAUDAN-REG	889	3,742.00	3,326,638.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	51,484	44.20	2,275,592.80
	SIKA AG-BR	13,625	235.10	3,203,237.50
	ABB LTD	175,888	24.82	4,365,540.16
	GEBERIT AG-REG	3,423	553.00	1,892,919.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	245.20	517,862.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	247.70	933,333.60
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	52.24	690,821.76
	SGS SA	586	2,457.00	1,439,802.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	190.85	967,036.95
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	47,970	77.02	3,694,649.40
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	229.60	570,096.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	43.92	172,956.96
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,987.00	556,360.00

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	83,200.00	832,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,565.00	786,760.00
	NESTLE SA - REGISTERED	280,020	105.46	29,530,909.20
	ALCON INC	44,953	61.28	2,754,719.84
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	248.30	1,275,765.40
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	1,084.00	1,099,176.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,876	620.00	4,263,120.00
	NOVARTIS	209,288	77.06	16,127,733.28
	ROCHE HOLDING GENUSS	66,166	310.80	20,564,392.80
	VIFOR PHARMA AG	4,486	122.50	549,535.00
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,550	95.70	339,735.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	220,884	10.28	2,270,687.52
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	48.33	1,023,484.41
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	953.60	1,747,948.80
	UBS GROUP AG	338,963	12.27	4,160,770.82
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	143.60	689,998.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	367.40	1,046,722.60
	SWISS RE LTD	28,565	76.88	2,196,077.20
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,451	333.20	4,815,073.20
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	83.45	622,370.10
	TEMENOS AG - REG	6,511	114.00	742,254.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	73.62	1,081,183.32
	SWISSCOM	2,441	477.00	1,164,357.00
	スイスフラン 小計	1,629,176		125,265,762.02 (14,425,605,154)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	197.10	3,394,456.20
	BOLIDEN AB	23,903	266.30	6,365,368.90
	SCA SV CELLULOSA B	51,834	128.25	6,647,710.50
	ALFA LAVAL AB	27,268	194.25	5,296,809.00
	ASSA ABLOY AB-B	99,383	213.40	21,208,332.20
	ATLAS COPCO A	64,653	433.70	28,040,006.10
	ATLAS COPCO B	36,538	377.50	13,793,095.00
	EPIROC AB-A	58,039	146.90	8,525,929.10
	EPIROC AB-B	37,972	140.75	5,344,559.00
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	11,162	240.00	2,678,880.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,906	246.00	6,618,876.00
	SANDVIK AB	111,932	179.40	20,080,600.80
	SKANSKA B	28,530	207.00	5,905,710.00
	SKF AB-B	35,405	201.30	7,127,026.50
	VOLVO B	143,889	197.85	28,468,438.65
	SECURITAS B	25,130	142.15	3,572,229.50
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	201.10	3,653,987.00

	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	91.20	3,530,534.40	
	EVOLUTION GAMING GROUP	11,183	675.80	7,557,471.40	
	HENNES & MAURITZ B	77,319	169.60	13,113,302.40	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	412.00	3,279,108.00	
	SWEDISH MATCH AB	16,014	665.20	10,652,512.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	267.90	15,293,071.50	
	NORDEA BANK ABP	313,624	76.06	23,854,241.44	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	88.22	13,736,736.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	81.00	12,181,266.00	
	SWEDBANK AB-A	86,716	153.16	13,281,422.56	
	EQT AB	20,102	189.55	3,810,334.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	251.70	4,226,546.40	
	INVESTOR AB-B SHS	43,921	593.20	26,053,937.20	
	KINNEVIK AB - B	23,604	395.45	9,334,201.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	440.00	3,203,200.00	
	ERICSSON (LM) B	280,901	106.85	30,014,271.85	
	HEXAGON AB-B SHS	26,504	700.20	18,558,100.80	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	108.90	5,446,306.80	
	TELIA CO AB	212,811	35.60	7,576,071.60	
	スウェーデンクローナ 小計	2,414,571		401,424,651.70 (4,893,366,504)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	92,158	133.20	12,275,445.60	
	NORSK HYDRO	106,150	31.30	3,322,495.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	351.60	6,494,052.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	152.40	2,913,430.80	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	338.80	2,361,774.80	
	MOWI ASA	40,968	177.90	7,288,207.20	
	ORKLA	69,804	90.34	6,306,093.36	
	DNB ASA	85,517	146.60	12,536,792.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	194.90	3,620,072.60	
	TELENOR ASA	71,821	156.00	11,204,076.00	
	ノルウェークローネ 小計	529,550		68,322,439.56 (793,906,747)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	644.80	6,671,745.60	
	NOVOZYMES A/S	19,125	378.70	7,242,637.50	
	VESTAS WIND SYSEMS	19,151	1,119.50	21,439,544.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	9,875.00	2,952,625.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	10,770.00	6,989,730.00	
	DSV PANALPINA A S	19,921	1,023.00	20,379,183.00	
	PANDORA A/S	10,731	577.20	6,193,933.20	
	CARLSBERG AS-B	9,141	917.80	8,389,609.80	
	AMBU A/S-B	13,555	206.40	2,797,752.00	

	COLOPLAST-B	11,223	960.40	10,778,569.20
	DEMANT A/S	11,604	234.30	2,718,817.20
	GN STORE NORD A/S	11,117	496.10	5,515,143.70
	GENMAB A/S	5,888	2,385.00	14,042,880.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	192.50	937,667.50
	NOVO NORDISK A/S-B	162,786	429.90	69,981,701.40
	DANSKE BANK A/S	70,121	94.54	6,629,239.34
	TRYG A/S	9,828	195.00	1,916,460.00
	ORSTED A/S	17,372	1,061.50	18,440,378.00
	デンマーククローネ 小計	407,729		214,017,616.94 (3,571,954,026)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	26.30	542,542.70
	OIL SEARCH LTD	144,170	2.84	409,442.80
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.33	717,026.35
	SANTOS	156,437	5.01	783,749.37
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	26.82	343,644.66
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	18.33	1,664,895.57
	BHP GROUP LTD	279,358	35.88	10,023,365.04
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	15.89	783,821.92
	EVOLUTION MINING LTD	169,502	6.45	1,093,287.90
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	17.61	2,725,605.36
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	38.35	1,657,793.80
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	30.99	2,296,297.02
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	64,628	16.84	1,088,335.52
	ORICA LTD	44,211	16.00	707,376.00
	RIO TINTO LTD	35,848	96.09	3,444,634.32
	SOUTH32 LTD	481,840	2.20	1,060,048.00
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	21.51	198,322.20
	BRAMBLES LTD	137,883	10.62	1,464,317.46
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.94	754,474.54
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.68	397,800.00
	TRANSURBAN GROUP	264,114	14.43	3,811,165.02
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	32.60	1,719,715.20
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.13	276,894.64
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	3.98	724,411.74
	REA GROUP LTD	5,276	139.50	736,002.00
	SEEK LTD	26,358	23.20	611,505.60
	WESFARMERS LTD	109,782	48.83	5,360,655.06
	COLES GROUP LTD	128,408	18.68	2,398,661.44
	WOOLWORTHS GROUP LTD	121,418	39.44	4,788,725.92
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	12.69	585,389.70
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	9.01	635,547.38

	COCHLEAR LIMITED	6,220	225.28	1,401,241.60
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	65.76	1,068,468.48
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	36.75	1,472,793.00
	CSL LIMITED	42,995	304.92	13,110,035.40
	AUST AND NZ BANKING GROUP	272,124	19.22	5,230,223.28
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	167,768	70.31	11,795,768.08
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	295,326	19.76	5,835,641.76
	WESTPAC BANKING	334,568	17.76	5,941,927.68
	AMP LTD	343,649	1.71	587,639.79
	ASX LTD	16,798	82.93	1,393,058.14
	MACQUARIE GROUP LIMITED	30,997	136.44	4,229,230.68
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	61.38	669,778.56
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	5.01	1,048,868.55
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.82	761,005.20
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	9.24	1,174,958.40
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	8.57	1,022,863.78
	AFTERPAY LTD	18,973	104.53	1,983,247.69
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	13.22	586,650.72
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	33.01	594,180.00
	TELSTRA CORP	403,126	2.86	1,152,940.36
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.62	239,839.50
	AGL ENERGY LTD	64,235	12.81	822,850.35
	AUSNET SERVICES	187,145	2.04	381,775.80
	オーストラリアドル 小計	6,518,741		116,310,441.03 (8,904,727,365)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	136,010	7.11	967,031.10
	A2 MILK CO LTD	66,854	15.45	1,032,894.30
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	36.95	2,014,514.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.91	541,486.47
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.64	923,044.48
	MERCURY NZ LTD	85,000	5.65	480,250.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.89	651,104.16
	ニュージーランドドル 小計	688,177		6,610,324.51 (474,687,403)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	50.40	12,927,398.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	110.80	14,902,600.00
	MTR CORP	151,000	39.70	5,994,700.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	217,000	58.85	12,770,450.00
	SANDS CHINA LTD	242,800	30.50	7,405,400.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.87	1,170,840.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	12.46	1,754,368.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	22.75	3,319,225.00

	WH GROUP LTD	936,500	6.43	6,021,695.00
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	54,000	30.00	1,620,000.00
	BANK EAST ASIA	109,160	14.62	1,595,919.20
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	22.90	8,255,450.00
	HANG SENG BANK	74,200	126.40	9,378,880.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,400	387.80	43,200,920.00
	AIA GROUP LTD	1,142,400	82.30	94,019,520.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	229,496	38.10	8,743,797.60
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.40	3,529,200.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	29.55	3,700,487.40
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	19.72	1,271,940.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	155,375	37.30	5,795,487.50
	SINO LAND CO	315,400	9.35	2,948,990.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	99.20	11,755,200.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	37.85	1,532,925.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.65	2,082,730.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	143,000	34.45	4,926,350.00
	PCCW LTD	357,000	4.66	1,663,620.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	38.40	2,592,000.00
	CLP HOLDINGS	157,000	73.00	11,461,000.00
	HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	11.52	11,872,270.08
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	40.35	5,548,125.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	79.40	1,881,780.00
	香港ドル 小計	7,443,134		305,643,268.18 (4,147,579,149)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	116,500	4.71	548,715.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	179,500	3.62	649,790.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.94	188,905.50
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	3.43	371,578.76
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.69	424,350.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	19.32	191,268.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.38	782,268.00
	DBS GROUP	162,400	22.95	3,727,080.00
	OCBC BANK	315,600	9.10	2,871,960.00
	UNITED OVERSEAS BANK	105,200	20.65	2,172,380.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.28	726,624.00
	CAPITALAND LTD	223,500	2.64	590,040.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.66	285,048.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.56	311,600.00
	VENTURE CORP LTD	25,700	20.72	532,504.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.15	1,617,322.45
		3,160,975		15,991,433.71

シンガポールドル 小計				(1,249,090,887)
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	12.78	865,921.68
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	400.10	858,614.60
	BANK HAPOLIM BM	98,310	21.57	2,120,546.70
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	17.32	2,436,144.60
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	10.46	1,040,770.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	73.55	919,595.65
	AZRIELI GROUP	4,323	195.00	842,985.00
	NICE LTD	5,312	840.20	4,463,142.40
イスラエルシェケル 小計		430,505		13,547,720.63 (423,095,315)
合 計		101,871,623		424,683,294,686 (424,683,294,686)

## (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	1,243,669.31	
		LENDLEASE GROUP	55,692	723,996.00	
		SYDNEY AIRPORT	107,308	648,140.32	
	オーストラリアドル 小計		277,413	2,615,805.63 (200,266,079)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,741,950.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,727,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,469,450.00 (74,220,436)	
	投資信託受益証券合計			872,913	274,486,515 (274,486,515)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	654,579.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,030	1,853,462.10	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	41,737	9,932,571.26	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	908,620.75	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,197,788.05	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,156,584.33	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	866,496.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	39,312	6,359,895.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,468,078.02	
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,354,646.40	
		EQUINIX INC	8,349	6,205,060.29	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	963,693.52	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,103,076.56	

ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,608,124.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,318,002.84	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	664,813.77	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	51,571	1,501,231.81	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	923,550.76	
INVITATION HOMES INC	51,458	1,419,726.22	
IRON MOUNTAIN INC	27,546	734,100.90	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	960,190.84	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,371,033.15	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	635,442.50	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	723,631.76	
PROLOGIS INC	69,633	6,936,143.13	
PUBLIC STORAGE	14,902	3,309,436.16	
REALTY INCOME CORP	32,696	2,014,073.60	
REGENCY CENTERS CORP	17,800	818,088.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	10,576	3,146,042.72	
SIMON PROPERTY GROUP	27,990	2,214,009.00	
SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,228,307.50	
UDR INC	28,059	1,070,450.85	
VENTAS INC	36,853	1,726,563.05	
VEREIT INC	105,798	760,687.62	
VICI PROPERTIES INC	44,224	1,053,415.68	
VORNADO REALTY TRUST	15,390	595,439.10	
WELLTOWER INC	41,531	2,768,456.46	
WP CAREY INC	16,500	1,100,880.00	
アメリカドル 小計	1,213,997	78,626,393.86	(8,272,282,898)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	420,443.97
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	184,482.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	254,655.60
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	137,565.33
カナダドル 小計	42,473	997,146.90	(80,599,383)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	301,441.50
	GECINA SA	4,459	576,548.70
	ICADE	2,845	158,751.00
	KLEPIERRE	17,225	258,375.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	585,598.20
ユーロ 小計	43,186	1,880,714.40	(233,716,378)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	360,539.56
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	376,710.70
	SEGRO PLC	106,999	968,340.95



	イギリスポンド 小計	244,963	1,705,591.21 (236,258,494)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	849,632.70	
	GOODMAN GROUP	147,935	2,954,261.95	
	GPT GROUP	167,884	720,222.36	
	MIRVAC GROUP	392,919	919,430.46	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,172,857.83	
	STOCKLAND	207,412	910,538.68	
	VICINITY CENTERS	291,115	420,661.17	
	オーストラリアドル 小計	1,788,018	7,947,605.15 (608,468,650)	
香港ドル	LINK REIT	199,000	12,537,000.00	
	香港ドル 小計	199,000	12,537,000.00 (170,127,090)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	874,060.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	375,260	712,994.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	426,800.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	219,085	453,505.95	
	SUNTEC REIT	173,000	245,660.00	
	シンガポールドル 小計	1,261,345	2,713,019.95 (211,913,988)	
	投資証券合計	4,792,982	9,813,366,881 (9,813,366,881)	
	合計		10,087,853,396 (10,087,853,396)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 592銘柄	97.4%			70.3%
	投資証券 38銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式 81銘柄	99.4%			3.3%
	投資証券 4銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 240銘柄	99.5%			10.7%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.1%

イギリスポンド	株式	83銘柄	98.8%			4.4%
	投資証券	3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%			3.3%
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	10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	91.7%			2.0%
	投資信託受益証券	3銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券	7銘柄			6.3%	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	94.4%			1.0%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.7%		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	85.5%			0.3%
	投資証券	5銘柄			14.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,551,080,348
コール・ローン	15,767,877
株式	79,013,034,918
投資信託受益証券	170,828,015
投資証券	52,855,672
派生商品評価勘定	252,587,115
未収入金	423,521
未収配当金	61,787,807
差入委託証拠金	1,390,385,885
流動資産合計	83,508,751,158

	2020年11月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	83,508,751,158
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,485,750
前受金	252,587,115
未払金	143,101
未払解約金	738,775,590
未払利息	22
流動負債合計	1,004,991,578
負債合計	1,004,991,578
純資産の部	
元本等	
元本	26,069,398,222
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	56,434,361,358
元本等合計	82,503,759,580
純資産合計	82,503,759,580
負債純資産合計	83,508,751,158

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年11月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p>

2020年11月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 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。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2020年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,069,398,222口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.1648円 (1万口当たり純資産額) (31,648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11月10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11月10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11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	24,915,019,168円
期中追加設定元本額	2,077,191,656円
期中一部解約元本額	922,812,602円
期末元本額	26,069,398,222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	7,527,649,401円
世界経済インデックスファンド	4,032,144,151円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,620,749,680円
DC 世界経済インデックスファンド	5,089,165,939円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	192,442,399円
分散投資コア戦略ファンドA	323,155,672円
分散投資コア戦略ファンドS	1,286,691,180円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	571,145,613円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	630,188,596円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	343,620,707円

区分	2020年11月10日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	19,028,469円
S M T インデックスバランス・オープン	105,988,335円
S M T 世界経済インデックス・オープン	103,644,788円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	326,426,791円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	60,827,041円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,570,105円
グローバル経済コア	420,561,727円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	22,536,881円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	492,755円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	609,917円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	309,225円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	531,321円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	306,692,520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）	82,225,009円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,743,854,587
投資信託受益証券	8,592,229
投資証券	38,234,155
合計	9,697,028,203

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,886,042,339	-	3,138,629,454	252,587,115
	合計	2,886,042,339	-	3,138,629,454	252,587,115

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2020年11月10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	828,114,250	-	841,600,000	13,485,750
	アメリカドル	828,114,250	-	841,600,000	13,485,750
合計		828,114,250	-	841,600,000	13,485,750

### (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	657,360	4.42	2,905,531.20	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.65	68,120.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	43,246	63.10	2,728,822.60	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,835	155.80	1,688,093.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	146,513	5.20	762,746.67	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.81	592,620.86	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	26,967	38.14	1,028,521.38	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	4.14	64,215.54	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	12.91	218,566.30	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	70,402	27.08	1,906,486.16	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	25.28	495,437.44	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	12.86	344,879.48	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	104.60	830,314.80	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	14.37	557,168.01	
	SOUTHERN COPPER CORP	11,367	54.66	621,320.22	
	51JOB INC-ADR	2,701	72.58	196,038.58	



BEST INC - ADR	14,126	2.70	38,140.20	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	38,964	30.93	1,205,156.52	
NIO INC - ADR	96,334	44.02	4,240,622.68	
GSX TECHEDU INC- ADR	7,846	69.23	543,178.58	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	44.97	626,027.37	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,167	175.28	2,658,471.76	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	40,978	71.32	2,922,550.96	
YUM CHINA HOLDINGS INC	38,070	57.37	2,184,075.90	
AUTOHOME INC-ADR	6,571	103.23	678,324.33	
BAIDU INC - SPON ADR	29,357	144.19	4,232,985.83	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12,149	46.04	559,339.96	
HUYA INC-ADR	8,211	21.02	172,595.22	
IQIYI INC-ADR	21,239	26.97	572,815.83	
JOYY INC	6,185	99.69	616,582.65	
MOMO INC-SPON ADR	15,529	15.00	232,935.00	
NETEASE INC-ADR	43,945	87.84	3,860,128.80	
SINA CORP	5,725	42.77	244,858.25	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	39,090	15.12	591,040.80	
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	45.60	239,354.40	
YANDEX NV-A	32,186	65.03	2,093,055.58	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	202,071	290.53	58,707,687.63	
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	40.64	142,565.12	
JD.COM INC-ADR	91,224	84.86	7,741,268.64	
PINDUODUO INC-ADR	28,981	106.14	3,076,043.34	
TRIP.COM GROUP LTD	52,406	36.57	1,916,487.42	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	21.40	1,016,243.20	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47,223	15.00	708,345.00	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	7,243	32.08	232,355.44	
ZAI LAB LTD-ADR	5,149	88.12	453,729.88	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	173,806	4.03	700,438.18	
CREDICORP LTD	7,332	137.50	1,008,150.00	
SBERBANK-SPONSORED ADR	296,934	12.31	3,655,257.54	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	0.86	325,111.82	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	29.39	59,397.19	
KE HOLDINGS INC	10,000	72.00	720,000.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.83	45,450.72	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	7,645	91.45	699,135.25	
GLOBANT SA	3,899	202.29	788,728.71	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.37	333,577.98	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	7.22	106,249.52	
アメリカドル 小計	3,286,976		125,957,345.44 (13,251,972,313)	

メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	8.71	13,458,352.31
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	350,392	63.43	22,225,364.56
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	313.92	4,551,840.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	38.02	3,682,313.04
	ALFA S.A.B. -A	359,900	14.74	5,304,926.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	42.77	1,603,875.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	305.80	7,126,669.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	205.21	8,963,572.80
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	154.75	2,627,655.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	31.34	7,001,042.60
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	67.69	2,125,466.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	579,880	53.31	30,913,402.80
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	92.45	4,666,413.75
	BECLE SAB DE CV	48,100	47.01	2,261,181.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	215,640	132.82	28,641,304.80
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	218.08	5,661,356.80
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	41.17	7,484,706.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	31.14	5,661,252.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	289,200	102.97	29,778,924.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	16.69	4,214,225.00
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,625,440	14.05	50,937,432.00	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	72.65	4,177,375.00	
メキシコペソ 小計		8,251,355		253,068,649.46 (1,305,834,231)
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	73.70	1,356,080.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	423,000	21.90	9,263,700.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	484,640	21.61	10,473,070.40
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	20.01	1,512,756.00
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	24.17	357,716.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	20.95	1,319,850.00
	GERDAU SA-PREF	105,000	22.00	2,310,000.00
	SUZANO SA	62,679	48.68	3,051,213.72
	VALE SA	395,778	63.19	25,009,211.82
	WEG SA	92,872	82.13	7,627,577.36
	CCR SA	125,600	12.43	1,561,208.00
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	66.10	4,095,027.20
	RUMO SA	114,200	20.45	2,335,390.00
	COGNA EDUCACAO	181,284	4.92	891,917.28
	B2W CIA DIGITAL	22,349	79.69	1,780,991.81
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	95,716	25.27	2,418,743.32
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	47.98	3,977,877.86
	MAGAZINE LUIZA SA	333,600	26.45	8,823,720.00

	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	21.87	1,662,120.00	
	VIA VAREJO SA	135,900	18.54	2,519,586.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	19.93	827,095.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	19,700	65.90	1,298,230.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	25.17	3,083,325.00	
	AMBEV SA	517,700	14.22	7,361,694.00	
	BRF SA	52,500	18.50	971,250.00	
	JBS SA	128,600	20.25	2,604,150.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	80,908	49.15	3,976,628.20	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	69.82	1,403,382.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	72.10	3,922,240.00	
	HYPERA SA	35,300	31.80	1,122,540.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	146,698	20.73	3,041,049.54	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	483,948	22.94	11,101,767.12	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	32.70	2,887,410.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	529,381	27.63	14,626,797.03	
	ITAUSA SA	505,867	10.43	5,276,192.81	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	222,703	53.85	11,992,556.55	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	26.62	1,836,780.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	93,933	6.65	624,654.45	
	PORTO SEGURO SA	7,300	51.20	373,760.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	24.52	1,113,208.00	
	CIELO SA	99,269	3.70	367,295.30	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	44.48	2,326,304.00	
	TIM SA	96,100	12.76	1,226,236.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	33,400	33.90	1,132,260.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	33.83	1,136,688.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	102,126	11.44	1,168,321.44	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	7,900	69.48	548,892.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	46.45	1,611,815.00	
	CPFL ENERGIA SA	33,800	30.67	1,036,646.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	43.90	1,284,075.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	110,400	21.95	2,423,280.00	
	ブラジルリアル 小計	6,863,860		186,054,279.21 (3,635,500,615)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,498.90	290,695,797.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,703.70	231,643,570.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,556	32,050.00	338,319,800.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,419.00	171,354,703.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,185.00	163,515,780.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,564	4,900.00	110,563,600.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,710.00	26,012,520.00	

	BANCO DE CHILE	4,862,640	70.00	340,384,800.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	27,400.00	149,494,400.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	31.35	196,872,388.35	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,249.00	51,958,400.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,199.80	96,466,689.60	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	211.86	60,641,323.38	
	COLBUN SA	1,215,680	128.00	155,607,040.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,990,008	109.88	438,422,079.04	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	54.87	140,537,323.86	
	チリペソ 小計	19,699,120		2,962,490,214.73 (412,082,388)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	1,938.00	947,641,302.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	26,780.00	786,689,280.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	26,640.00	1,019,725,920.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	21,590.00	449,503,800.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	22,800.00	1,151,650,800.00	
	コロンビアペソ 小計	627,964		4,355,211,102.00 (125,430,079)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,794	9.10	52,754.37	
	OPAP SA	17,668	8.03	141,962.38	
	JUMBO SA	14,899	14.91	222,144.09	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.10	343,311.70	
	ユーロ 小計	64,568		760,172.54 (94,466,641)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	16.59	442,953.00	
	イギリスポンド 小計	26,700		442,953.00 (61,357,849)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	82.30	954,926.90	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	11.32	1,321,666.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	17.90	1,782,231.40	
	KOC HOLDING AS	89,884	16.32	1,466,906.88	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	10.68	664,199.88	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	119.80	778,819.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	70.40	3,014,809.60	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	21,501	21.46	461,411.46	
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.38	1,486,606.98	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	7.48	1,795,140.16	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.87	1,015,580.44	
	YAPI VE KREDI BANKASI	246,063	2.47	607,775.61	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	9.49	1,085,447.22	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	16.36	2,340,968.76	
		1,643,682		18,776,491.69	

トルコリラ 小計				(243,155,567)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	527.00	3,933,001.00
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	59.30	4,076,756.40
	CEZ AS	18,145	475.00	8,618,875.00
チェココルナ 小計		94,356		16,628,632.40 (77,821,999)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	1,720.00	72,850,600.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	6,990.00	106,094,220.00
	OTP BANK NYRT	24,834	11,740.00	291,551,160.00
ハンガリーフォリント 小計		82,367		470,495,980.00 (162,744,559)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	32.42	358,467.94
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	45.14	1,386,384.82
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	259,894	4.77	1,241,513.63
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	137.45	1,804,993.40
	LPP SA	124	7,530.00	933,720.00
	CD PROJEKT SA	6,704	371.40	2,489,865.60
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	27.34	986,919.32
	ALLEGRO.EU SA	27,362	90.61	2,479,270.82
	DINO POLSKA SA	5,945	260.00	1,545,700.00
	BANK PEKAO SA	22,583	48.45	1,094,146.35
	M BANK SA	1,663	153.50	255,270.50
	PKO BANK POLSKI SA	104,297	22.79	2,376,928.63
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	160.30	579,484.50
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	24.06	1,492,778.64
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.40	356,211.20
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	5.90	375,007.37	
ポーランドズロチ 小計		704,385		19,756,662.72 (547,061,990)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	4.94	948,480.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,739,400	3.23	8,848,262.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	392,500	13.88	5,447,900.00
	CNOOC LTD-R	1,883,000	7.38	13,896,540.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	3.34	287,240.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,382,000	2.33	5,550,060.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	5.80	823,600.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.00	680,000.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	124,000	51.85	6,429,400.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	5.95	603,925.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	642,000	3.27	2,099,340.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	10.14	4,177,680.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	10.46	3,012,480.00

JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	10.24	849,920.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.26	1,039,160.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	11.36	1,465,440.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	557,000	1.51	841,070.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	11.52	1,042,560.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	6.90	5,030,100.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.20	1,155,000.00
BOC AVIATION LTD	32,500	53.20	1,729,000.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	519,000	4.23	2,195,370.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	4.67	915,320.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	36.75	5,861,625.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	13.24	1,694,720.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	5.28	1,011,120.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	3.82	1,810,680.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	5.47	929,900.00
CITIC LTD	677,000	6.12	4,143,240.00
CRRC CORP LTD-H	511,050	3.15	1,609,807.50
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	10.08	2,903,040.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	21.65	1,688,700.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.25	378,000.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	10.70	406,600.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.05	218,075.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	97,500	19.56	1,907,100.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	16.98	3,596,364.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	11.80	370,708.80
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	25.25	1,573,075.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	7.40	859,880.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	36.25	1,504,375.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.10	1,578,803.40
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	49.85	6,779,600.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	8.54	1,537,200.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.32	1,138,480.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.11	1,267,280.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	308,000	3.28	1,010,240.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.62	1,592,562.14
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.57	804,320.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	474,000	6.38	3,024,120.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.53	1,386,780.22
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.48	1,322,880.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	64,000	7.23	462,720.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	12.76	1,632,284.72
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	5.65	497,200.00

BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	3.19	373,230.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.43	2,734,240.00
BYD CO LTD-H	82,500	196.00	16,170,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	8.12	2,159,920.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	37.10	1,009,120.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	609,000	21.05	12,819,450.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	13.66	4,818,565.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	9.00	3,225,096.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	100.80	11,188,800.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	3.70	717,800.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	142,000	34.90	4,955,800.00
LI NING CO LTD	217,000	45.45	9,862,650.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	140.50	11,914,400.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	15.60	702,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	13.30	931,000.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	6.43	617,280.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	85,000	55.65	4,730,250.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	22,500	27.45	617,625.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.09	1,580,500.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	60.00	1,932,000.00
TENCENT HOLDINGS LTD	616,200	622.50	383,584,500.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	0.95	1,146,610.10
MEITUAN-CLASS B	382,700	335.20	128,281,040.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	13.60	930,240.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	11.28	1,285,920.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	59.00	4,012,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	8.40	2,175,600.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	93.90	1,427,280.00
CHINA FEIHE LTD	144,000	17.70	2,548,800.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	40.30	11,324,300.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	162,000	50.85	8,237,700.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.86	1,195,560.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.92	3,173,760.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	64.20	2,953,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.80	544,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.09	2,850,400.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	92.90	4,459,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	78,500	54.20	4,254,700.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	22.50	562,500.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	30,000	16.44	493,200.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	358,000	23.00	8,234,000.00

PING AN HEALTHCARE AND TECHN	40,100	103.40	4,146,340.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	15.00	3,660,000.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.08	1,679,472.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	18.40	2,303,680.00
3SBIO INC	119,000	7.36	875,840.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	5,800	162.20	940,760.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	8.44	844,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	8.19	7,830,950.40
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.15	653,625.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.24	537,840.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	12.58	1,031,560.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	35.75	4,361,500.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	94,000	55.40	5,207,600.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	192,500	4.49	864,325.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	32.70	1,814,850.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	8.16	9,082,080.00
SSY GROUP LTD	114,000	4.41	502,740.00
WUXI APPTec CO LTD-H	26,740	137.20	3,668,728.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	108,000	240.40	25,963,200.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,152,000	2.88	9,077,760.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,635,200	2.67	23,055,984.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.18	4,591,625.50
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.33	3,167,496.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,247,620	5.91	60,563,434.20
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	2.86	1,959,100.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	436,923	46.90	20,491,688.70
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	4.38	2,953,872.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.30	498,300.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,464,515	4.70	30,383,220.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	4.13	4,373,670.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.53	1,272,960.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	11.20	1,500,800.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.80	2,318,400.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	0.87	806,490.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	19.68	2,597,760.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	18.18	4,517,730.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	7.89	1,893,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	11.58	1,025,988.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	109,400	11.06	1,209,964.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.98	2,493,256.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	209,200	12.78	2,673,576.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	871,000	17.80	15,503,800.00



CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	26.70	7,919,220.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	0.75	179,250.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	12.52	2,303,980.48
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	32.35	3,118,540.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.42	2,272,380.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	5.76	3,970,298.88
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	632,500	83.90	53,066,750.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	42.40	1,937,680.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	11.56	1,641,520.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	8.26	1,040,760.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	16.84	3,132,240.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.10	2,369,800.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	409,040	20.25	8,283,060.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	5.43	434,400.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	347,111	35.40	12,287,729.40
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	27.20	4,852,480.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	5.85	1,614,600.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	897,964	11.02	9,895,563.28
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	10.42	1,408,784.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.82	595,920.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	11.58	1,765,950.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	12.78	1,917,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	47.85	9,426,450.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	57.65	461,200.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	6.55	1,336,200.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.48	833,280.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	30.05	3,981,625.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	1.60	845,745.60
SOHO CHINA LTD	291,500	2.16	629,640.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	31.75	7,969,250.00
WHARF HOLDINGS	100,000	16.60	1,660,000.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.59	919,020.00
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	356,619	3.20	1,141,180.80
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	4.96	649,760.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	25.00	6,050,000.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	45.25	4,163,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	17.00	1,343,000.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	46.05	3,292,575.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	38.80	3,298,000.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	2.80	660,800.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	25.75	1,725,250.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	11.62	801,780.00

	LEGEND HOLDINGS CORP-H	90,500	11.10	1,004,550.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	5.41	3,960,120.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	75,500	158.90	11,996,950.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,109,600	25.55	28,350,280.00	
	ZTE CORP-H	82,908	22.30	1,848,848.40	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	667,500	50.60	33,775,500.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	2.57	3,484,920.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.38	6,301,080.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	734,000	5.18	3,802,120.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	25.00	1,487,500.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.09	1,884,900.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.68	2,254,560.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	286,200	26.70	7,641,540.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	431,000	6.00	2,586,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.55	1,032,300.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	35.80	3,794,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	8.16	1,431,264.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	84,700	100.00	8,470,000.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	12.64	4,044,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.02	1,117,400.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	5.75	2,070,000.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	34.85	1,568,250.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	373,500	24.70	9,225,450.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,273	14.50	5,600,958.50	
	香港ドル 小計	97,981,386		1,393,132,882.52 (18,904,813,215)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.79	1,567,801.72	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	19.00	476,900.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	6.37	1,719,263.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	5.99	864,357.00	
	GAMUDA BHD	141,520	3.70	523,624.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.80	297,960.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.46	827,411.16	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	4.33	461,552.02	
	MISC BHD	125,040	6.94	867,777.60	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.99	279,300.00	
	GENTING BHD	307,200	2.99	918,528.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.12	783,764.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	13,200	19.76	260,832.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	21,300	32.30	687,990.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.90	138,600.00	

	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.47	1,208,419.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	55,646	22.78	1,267,615.88	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	141.00	972,900.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	18.96	1,393,180.80	
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.50	811,200.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	5.14	1,269,816.44	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	18.22	3,303,286.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.40	1,238,220.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	128,200	7.50	961,500.00	
	SUPERMAX CORP BHD	158,200	9.63	1,523,466.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	8.48	4,281,552.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	265,600	3.02	802,112.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	635,119	3.06	1,943,464.14	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	14.70	900,992.40	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	46,033	14.54	669,319.82	
	MALAYAN BANKING BHD	404,004	7.12	2,876,508.48	
	PUBLIC BANK BERHAD	324,420	15.30	4,963,626.00	
	RHB BANK BHD	206,419	4.38	904,115.22	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.16	901,513.24	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.11	1,281,087.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.30	1,419,870.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	4.34	306,195.68	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.10	1,215,550.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	275,175	10.26	2,823,295.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	260,777	0.77	202,102.17	
	マレーシアリングット 小計	7,865,960		50,116,569.07 (1,281,981,836)	
タイパーツ	IRPC PCL - NVDR	829,500	2.24	1,858,080.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	84.00	11,289,600.00	
	PTT PCL-NVDR	1,253,200	34.75	43,548,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	38.50	4,623,850.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	25.75	5,314,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	46.25	10,403,197.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	361.00	29,241,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	57.25	24,508,725.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.85	7,230,450.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	9.70	7,852,150.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.40	2,755,020.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	18.30	6,638,105.40	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	28.50	5,192,700.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	743,535	14.40	10,706,904.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	33.00	5,860,800.00	

	CP ALL PCL-NVDR	657,100	60.25	39,590,275.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	458,200	27.50	12,600,500.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	36.00	2,376,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	449,700	15.90	7,150,230.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,083,700	18.50	20,048,450.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	96.25	3,157,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	107.00	5,553,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	80.75	10,206,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	80.50	6,303,150.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	9.30	4,079,445.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127,400	71.00	9,045,400.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,147,300	0.93	2,926,989.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	22.50	3,714,750.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	42.25	4,288,375.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	56.00	5,028,800.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	52.75	4,024,825.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	44.00	9,957,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	6.95	6,060,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	179.00	21,426,300.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	54.00	13,159,800.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	33.50	2,211,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	2.96	2,845,770.64	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	48.00	2,563,200.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	36,000	186.50	6,714,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	44.00	8,162,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	64.50	4,398,900.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	33.75	9,726,750.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	52.00	2,823,600.00	
	タイパーツ 小計	17,505,366		407,167,291.54 (1,408,798,828)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	47.95	11,409,223.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	789.00	22,312,920.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	510.00	3,497,580.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	70.40	21,367,315.20	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	990.00	22,576,950.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	125.00	18,062,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	198.90	12,134,889.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	87,300	40.85	3,566,205.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	143.90	13,751,084.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	78.00	4,667,910.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	92.65	20,374,754.15	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	41.90	6,757,925.30	

	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.20	9,893,940.00	
	AYALA LAND INC	942,900	34.70	32,718,630.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	3.25	2,073,500.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	16.28	1,514,040.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,156,150	35.85	41,447,977.50	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,100.00	9,849,000.00	
	PLDT INC	10,460	1,398.00	14,623,080.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	28.40	2,541,800.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	313.00	9,111,430.00	
	フィリピンペソ 小計	6,748,319		284,252,653.15 (622,513,310)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,130.00	1,626,409,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	20,875.00	4,193,787,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	930.00	2,680,725,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	9,675.00	2,362,635,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	13,175.00	2,503,250,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	10,225.00	3,533,760,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	5,600.00	12,055,120,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,630.00	1,476,291,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	6,400.00	5,070,720,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	41,400.00	2,467,440,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	1,430.00	1,312,597,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,750.00	1,569,750,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,200.00	3,089,520,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	7,950.00	5,933,880,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,480.00	4,078,732,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,051,000	31,425.00	33,027,675,000.00	
	BANK MANDIRI	2,047,596	6,150.00	12,592,715,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	5,100.00	4,132,020,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,899,600	3,690.00	21,769,524,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	5,349,700	2,880.00	15,407,136,000.00	
XL AXIATA TBK PT	387,000	2,130.00	824,310,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	1,125.00	890,437,500.00		
	インドネシアルピア 小計	30,559,696		142,598,434,400.00 (1,069,488,258)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	34,500.00	227,458,500.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	57,900.00	257,481,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	157,000.00	877,002,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	52,200.00	558,853,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	30,550.00	221,243,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	394,000.00	308,502,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,512	153,000.00	384,336,000.00	

LG CHEM LTD	4,819	734,000.00	3,537,146,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,129	358,000.00	404,182,000.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	273,000.00	526,890,000.00
POSCO	7,998	234,000.00	1,871,532,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	81,800.00	278,038,200.00
CJ CORP	1,230	79,500.00	97,785,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,217	81,500.00	262,185,500.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	30,450.00	131,178,600.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	29,550.00	199,758,000.00
HANWHA CORPORATION	2,825	26,200.00	74,015,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	31,750.00	293,338,250.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,348	233,000.00	314,084,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10,619	23,000.00	244,237,000.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	90,100.00	392,295,400.00
LG CORP	9,902	72,900.00	721,855,800.00
LOTTE CORP	2,370	30,300.00	71,811,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	13,600.00	81,436,800.00
SAMSUNG C&T CORP	8,727	115,000.00	1,003,605,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	11,450.00	212,008,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	5,600.00	332,113,600.00
SK HOLDINGS CO LTD	3,991	193,500.00	772,258,500.00
S-1 CORPORATION	2,394	83,600.00	200,138,400.00
CJ LOGISTICS	862	162,000.00	139,644,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,307	184,000.00	424,488,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	9,145	21,800.00	199,361,000.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,220.00	125,485,920.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	32,350.00	228,585,100.00
HANON SYSTEMS	19,000	12,400.00	235,600,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,916	232,500.00	1,607,970,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	15,682	172,500.00	2,705,145,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,286	83,200.00	356,595,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	83,000.00	249,249,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	29,450	52,300.00	1,540,235,000.00
COWAY CO LTD	5,058	74,200.00	375,303,600.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	43,100.00	175,848,000.00
HLB INC	5,006	94,400.00	472,566,400.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	87,300.00	961,958,700.00
KANGWON LAND INC	13,208	21,500.00	283,972,000.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	21,200.00	107,484,000.00
KAKAO CORP	6,081	371,500.00	2,259,091,500.00
NAVER CORP	13,049	298,000.00	3,888,602,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,789	844,000.00	1,509,916,000.00

NETMARBLE CORP	2,465	129,000.00	317,985,000.00
PEARL ABYSS CORP	921	202,900.00	186,870,900.00
CJ ENM CO LTD	830	134,300.00	111,469,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	75,700.00	230,960,700.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	90,000.00	93,060,000.00
SHINSEGAE CO LTD	881	216,000.00	190,296,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	130,000.00	71,370,000.00
EMART	1,864	149,500.00	278,668,000.00
GS RETAIL CO LTD	4,060	33,400.00	135,604,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	395,000.00	306,125,000.00
KT&G CORP	13,229	83,300.00	1,101,975,700.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,968	120,000.00	356,160,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	550,000.00	37,400,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	165,000.00	474,045,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	2,100	53,300.00	111,930,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,527,000.00	1,459,812,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	278	703,000.00	195,434,000.00
PACIFIC CORP	3,393	46,800.00	158,792,400.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,528	92,300.00	694,834,400.00
ALTEOGEN INC	1,894	168,900.00	319,896,600.00
CELLTRION INC	10,296	285,000.00	2,934,360,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,242	115,200.00	143,078,400.00
HANMI PHARM CO LTD	490	286,000.00	140,140,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,803	761,000.00	1,372,083,000.00
SEEGENE INC	1,919	275,100.00	527,916,900.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	134,000.00	408,566,000.00
YUHAN CORPORATION	5,540	65,000.00	360,100,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,153	5,910.00	284,584,230.00
HANA FINANCIAL GROUP	32,598	33,000.00	1,075,734,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	8,630.00	244,487,900.00
KB FINANCIAL GROUP INC	44,103	42,950.00	1,894,223,850.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	51,899	31,750.00	1,647,793,250.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	9,610.00	570,891,660.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	72,400.00	333,184,800.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,485.00	166,945,440.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,015	9,100.00	282,236,500.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,200.00	123,491,400.00
SAMSUNG CARD CO	1,899	31,850.00	60,483,150.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	33,450.00	193,207,200.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	46,000.00	193,614,000.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	24,400.00	222,064,400.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	184,500.00	573,426,000.00

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	64,400.00	477,654,800.00
	DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	108,500.00	157,433,500.00
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	175,000.00	651,875,000.00
	KMW CO LTD	1,901	69,400.00	131,929,400.00
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	15,200.00	365,879,200.00
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	153,500.00	217,202,500.00
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	139,500.00	781,618,500.00
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	513,828	60,200.00	30,932,445,600.00
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	88,980	55,000.00	4,893,900,000.00
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,008	533,000.00	3,202,264,000.00
	LG UPLUS CORP	22,125	11,800.00	261,075,000.00
	SK TELECOM	4,243	225,500.00	956,796,500.00
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	30,309	20,450.00	619,819,050.00
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	29,200.00	132,509,600.00
	SK HYNIX INC	59,004	86,000.00	5,074,344,000.00
	韓国ウォン 小計	1,638,935		102,145,916,200.00 (9,622,145,306)
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	81.90	9,192,456.00
	ASIA CEMENT CORP	234,176	42.00	9,835,392.00
	CHINA STEEL	1,266,261	20.70	26,211,602.70
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	396,061	71.90	28,476,785.90
	FORMOSA PLASTICS CORP	413,824	81.80	33,850,803.20
	NAN YA PLASTICS CORP	548,752	62.10	34,077,499.20
	TAIWAN CEMENT	567,511	41.15	23,353,077.65
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	780.00	9,360,000.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	26.60	9,257,544.80
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,874	273.50	5,982,539.00
	EVA AIRWAYS CORP	164,159	11.05	1,813,956.95
	EVERGREEN MARINE	359,039	21.70	7,791,146.30
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	264,000	30.80	8,131,200.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	38.60	6,834,554.60
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	409.50	8,164,201.50
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	180.00	7,820,640.00
	FORMOSA TAFFETA CO.	121,000	31.10	3,763,100.00
	GIANT MANUFACTURING	34,464	292.50	10,080,720.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	354.00	5,664,000.00
	POU CHEN	273,780	26.15	7,159,347.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	649.00	19,470,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	259.00	15,421,896.00
	STANDARD FOODS CORP	35,756	62.70	2,241,901.20
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	526,395	63.30	33,320,803.50
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	17.80	10,356,858.80



CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,899,237	18.65	35,420,770.05
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,260,970	25.45	32,091,686.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,166,216	21.05	24,548,846.80
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	964,097	17.95	17,305,541.15
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,173,339	28.75	33,733,496.25
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	11.05	12,783,623.45
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,229,570	13.05	16,045,888.50
TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	9.76	4,884,401.76
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,087,289	20.00	21,745,780.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	38.85	12,853,949.85
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,302	154.50	21,213,159.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,170,159	18.35	21,472,417.65
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	894,123	39.60	35,407,270.80
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	8.62	10,833,443.60
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	326,258	19.50	6,362,031.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	710,082	42.70	30,320,501.40
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	8.18	9,779,492.66
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	113,432	42.00	4,764,144.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	40.20	5,935,932.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	217.50	10,440,000.00
ACER INC	255,803	23.55	6,024,160.65
ADVANTECH CO LTD	43,336	295.00	12,784,120.00
ASUSTEK COMPUTER INC	76,092	251.00	19,099,092.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	11.55	10,915,789.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	185.50	12,929,350.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	86.60	5,351,187.20
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	10.00	7,750,000.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	18.95	8,181,852.00
DELTA ELECTRONICS INC	209,903	197.50	41,455,842.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	51.70	4,800,345.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,333,248	81.20	108,259,737.60
INVENTEC CO LTD	280,511	22.25	6,241,369.75
LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	3,265.00	36,045,600.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	47.40	10,686,424.80
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	120.00	7,200,000.00
PEGATRON CORP	200,474	60.90	12,208,866.60
QUANTA COMPUTER INC	286,270	74.00	21,183,980.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	42.90	5,495,490.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	182.50	4,927,500.00
WISTRON CORP	355,695	29.50	10,493,002.50
WIWYNN CORP	8,000	780.00	6,240,000.00
WPG HOLDINGS LTD	143,692	39.80	5,718,941.60

	YAGEO CORPORATION	38,764	388.00	15,040,432.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	127.00	7,610,094.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	397,315	110.00	43,704,650.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	60.90	9,561,300.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	178,200	100.50	17,909,100.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	349,315	70.20	24,521,913.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,610.00	4,830,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	426.50	10,236,000.00	
	MEDIATEK INC	160,804	702.00	112,884,408.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	154,000	60.40	9,301,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	293.00	17,007,185.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	320.00	3,711,680.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	99,770	87.00	8,679,990.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	362.00	18,441,728.00	
	SILERGY CORP	7,000	2,255.00	15,785,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,652,389	458.50	1,216,120,356.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	31.80	38,478,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	103.00	9,167,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	321.00	10,272,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	17.40	6,072,600.00	
	新台湾ドル 小計	35,498,283		2,668,902,090.92 (9,848,248,715)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	375.55	24,831,366.00	
	COAL INDIA LTD	147,331	121.75	17,937,549.25	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	208.05	12,363,371.25	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	81.20	15,733,718.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	68.45	17,297,931.05	
	PETRONET LNG LTD	83,779	238.15	19,951,968.85	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	306,633	2,050.70	628,812,293.10	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	249.30	18,331,776.90	
	ASIAN PAINTS LTD	32,211	2,225.20	71,675,917.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	653.50	19,244,921.50	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	41,773	792.15	33,090,481.95	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	194.70	23,628,207.90	
	JSW STEEL LTD	80,284	333.10	26,742,600.40	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,595.25	19,570,527.00	
	SHREE CEMENT LTD	901	22,604.70	20,366,834.70	
	TATA STEEL LTD	39,709	438.30	17,404,454.70	
	ULTRATECH CEMENT LTD	12,469	4,625.25	57,672,242.25	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	426.75	23,131,557.00	
	VEDANTA LTD	198,772	98.80	19,638,673.60	
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	824.00	19,344,224.00	

LARSEN & TOUBRO LTD	49,730	965.85	48,031,720.50
SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,349.30	7,995,951.80
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	367.05	22,950,168.30
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	380.40	10,063,482.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,491.05	12,465,178.00
BAJAJ AUTO LTD	8,362	3,001.95	25,102,305.90
BHARAT FORGE LTD	30,322	493.75	14,971,487.50
BOSCH LTD	965	11,699.05	11,289,583.25
EICHER MOTORS LTD	12,540	2,192.85	27,498,339.00
HERO MOTOCORP LTD	10,359	2,954.25	30,603,075.75
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	616.35	46,638,588.15
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,187	6,872.15	90,623,042.05
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	123.05	9,454,792.85
TATA MOTORS LTD	190,082	141.00	26,801,562.00
PAGE INDUSTRIES LTD	601	21,943.10	13,187,803.10
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	1,285.05	42,265,294.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	2,335.60	20,520,581.60
INFO EDGE INDIA LTD	6,428	3,632.30	23,348,424.40
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	191.65	15,231,000.45
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	2,325.85	40,758,195.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	3,548.30	18,124,716.40
ITC LTD	388,437	172.80	67,121,913.60
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	17,332.00	41,510,140.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	43,895	509.85	22,379,865.75
UNITED SPIRITS LTD	32,483	555.80	18,054,051.40
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	5,255	1,508.15	7,925,328.25
DABUR INDIA LTD	58,111	527.55	30,656,458.05
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	688.35	26,476,694.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	87,189	2,132.55	185,934,901.95
MARICO LTD	42,465	380.45	16,155,809.25
AUROBINDO PHARMA LTD	28,844	786.60	22,688,690.40
BIOCON LTD	17,686	416.00	7,357,376.00
CIPLA LTD	37,891	763.20	28,918,411.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	3,423.75	31,012,327.50
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,879.65	61,698,294.60
LUPIN LTD	26,552	917.95	24,373,408.40
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,382.45	16,205,078.90
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	510.15	42,316,942.50
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,552.10	15,593,331.00
AXIS BANK LTD	244,732	565.05	138,285,816.60
BANDHAN BANK LTD	74,811	340.10	25,443,221.10
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	177,443	2,152.10	381,875,080.30

	ICICI BANK LTD	541,702	462.70	250,645,515.40	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	304.30	8,511,575.30	
	STATE BANK OF INDIA	187,504	219.50	41,157,128.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	18,080	3,865.00	69,879,200.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,508.70	10,273,126.50	
	REC LTD	48,168	109.25	5,262,354.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	835.30	17,721,724.80	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	6,283.35	24,429,664.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	74,097	592.85	43,928,406.45	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,550	1,271.30	29,939,115.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	422.05	13,392,490.60	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	41,424	808.15	33,476,805.60	
	DLF LTD	56,420	172.80	9,749,376.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	122,073	855.00	104,372,415.00	
	INFOSYS LTD	365,523	1,136.55	415,435,165.65	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	96,664	2,726.60	263,564,062.40	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	872.75	41,940,001.25	
	WIPRO LTD	118,712	351.95	41,780,688.40	
	BHARTI AIRTEL LTD	153,214	471.80	72,286,365.20	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	178.70	6,398,174.80	
	GAIL INDIA LTD	174,768	86.50	15,117,432.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	13,220	423.20	5,594,704.00	
	NTPC LTD	260,019	89.45	23,258,699.55	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	184.05	37,061,228.25	
	インドルピー 小計	6,650,699		4,461,854,469.60 (6,380,451,891)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	93.96	6,859,080.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	130.21	8,658,965.00	
	MCB BANK LTD	53,300	170.82	9,104,706.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		24,622,751.00 (16,497,243)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	57,358	17.55	1,006,632.90	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.05	910,934.10	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	10.29	2,024,948.52	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.29	875,117.10	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.31	1,752,593.94	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	8.50	837,751.50	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	16.80	1,919,064.00	
	QATAR NATIONAL BANK	489,714	18.20	8,912,794.80	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.41	708,578.35	
	OOREDOO QSC	72,800	6.80	495,040.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	17.20	1,073,641.20	

	カタールリアル 小計	2,353,815		20,517,096.41 (584,121,734)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,900	128.82	4,495,818.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	7,385	1,138.64	8,408,856.40	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,716	374.12	16,729,149.92	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	168.65	16,376,252.30	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	77.55	4,366,142.55	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	88,269	162.03	14,302,226.07	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	537.64	2,888,202.08	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	173.85	5,902,207.50	
	SASOL LTD	57,207	112.59	6,440,936.13	
	SIBANYE STILLWATER LTD	252,042	52.52	13,237,245.84	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	150.01	4,155,577.02	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	134.44	5,448,718.76	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	149.92	4,274,219.20	
	NASPERS LTD-N SHS	46,871	3,367.08	157,818,406.68	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	83,044	13.97	1,160,124.68	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	38.46	4,249,637.70	
	BID CORP LTD	39,208	268.84	10,540,678.72	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	259.00	6,972,539.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	58,453	142.61	8,335,982.33	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	186.34	4,336,877.16	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	213.38	2,778,847.74	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	17.88	2,798,988.84	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	126.50	4,711,366.00	
	ABSA GROUP LTD	73,296	98.73	7,236,514.08	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,974	1,309.40	9,131,755.60	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	118.00	4,488,366.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	142,629	120.00	17,115,480.00	
	FIRSTRAND LTD	525,813	44.75	23,530,131.75	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	271.72	4,670,051.64	
	REMGRO LTD	55,441	96.72	5,362,253.52	
DISCOVERY LIMITED	48,488	125.59	6,089,607.92		
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	14.42	981,684.76		
OLD MUTUAL LTD	489,612	11.68	5,718,668.16		
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	31.97	3,237,537.96		
SANLAM LTD	221,098	55.03	12,167,022.94		
NEPI ROCKCASTLE PLC	33,499	69.10	2,314,780.90		
MTN GROUP LTD	173,000	66.43	11,492,390.00		
VODACOM GROUP	62,331	129.41	8,066,254.71		
	南アフリカランド 小計	3,425,812		432,331,500.56 (2,952,824,148)	

アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	331,172	6.00	1,987,032.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	215,945	4.16	898,331.20	
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	9.90	2,626,430.40	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	11.76	3,331,161.12	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	509,421	2.69	1,370,342.49	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.46	262,278.78	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	2.82	1,085,812.80	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	200,413	17.00	3,407,021.00	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		2,370,192		14,968,409.79	(429,443,676)
香港・オフショア 人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	6.19	562,671.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	17.92	358,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	4.18	418,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	9.88	378,404.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	6.06	532,068.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	9.44	577,728.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	3.29	540,547.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	55.33	1,628,915.20	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.54	253,098.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	33,750	38.08	1,285,200.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	11.47	612,498.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	76.48	611,840.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5,000	45.12	225,600.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	22.83	846,993.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	25.25	252,500.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.17	539,370.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	6.36	381,600.00	
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	14.56	561,579.20	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.00	245,400.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.09	460,009.00	
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	32,300	22.90	739,670.00	
	SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	69,000	6.93	478,170.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	25.90	187,826.80	
	SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	23,600	40.28	950,608.00	
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,000	114.07	456,280.00	
	TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	15.89	65,149.00	
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	43,200	16.22	700,704.00	
	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.46	503,412.00	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	87.40	1,529,500.00	
	WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	73.82	680,620.40	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	103.10	1,072,240.00		
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15,600	46.26	721,656.00		

ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	13.95	329,220.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	10.00	340,000.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	38.22	435,708.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	25.00	425,000.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	11,100	53.41	592,851.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	25,000	37.15	928,750.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	81,600	7.64	623,424.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	7.05	681,030.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	63,200	8.48	535,936.00
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	110,200	4.33	477,166.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	16,100	32.89	529,529.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.31	1,119,879.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	266.43	3,570,162.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	2.83	1,060,118.00
CRRC CORP LTD-A	79,000	5.60	442,400.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	26,400	28.70	757,680.00
GUOCHENG MINING CO LTD-A	31,100	11.09	344,899.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	48.80	663,680.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	18,056	87.58	1,581,344.48
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	23.15	1,125,090.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	3.98	649,536.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	27.54	1,153,926.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	82.66	1,686,264.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	10.48	236,848.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	16.84	727,488.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.13	243,946.43
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	32.20	1,017,520.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	97.89	808,571.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	26.80	1,264,692.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	18.20	806,260.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.60	608,760.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	8.33	671,398.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	37,300	26.98	1,006,354.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	84.37	928,070.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.20	186,480.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	5.72	610,324.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.78	191,200.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.52	797,396.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	13.20	409,200.00
S F HOLDING CO LTD-A	13,700	83.38	1,142,306.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	70.21	373,446.99
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.89	217,116.00

SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	45.92	381,136.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	18.94	413,649.60
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	104,734	7.21	755,132.14
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	42.00	1,566,600.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	34.90	1,197,070.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	26.06	763,558.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	28.40	1,209,840.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	67.55	1,249,675.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	15.55	516,260.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	131.61	1,013,397.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	28.41	738,660.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	30,100	30.62	921,662.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	6.80	693,600.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	73.82	590,560.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.04	558,272.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	17.13	573,512.40
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	12.18	652,848.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	12.83	218,110.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	9.83	1,370,302.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	78.80	1,284,440.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	18.81	310,365.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	9.48	780,772.80
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	30.09	686,052.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	34,100	17.19	586,179.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	29.66	726,670.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	22,800	16.89	385,092.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	8.40	516,600.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	14,800	199.50	2,952,600.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	23.69	402,730.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	9.82	449,756.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	71.91	618,426.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,800	104.21	812,838.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	8.10	328,050.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	4,800	225.10	1,080,480.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	60.40	132,880.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	8.38	498,610.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	54.66	562,998.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	54.35	543,500.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	105.58	834,082.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	21,100	42.62	899,282.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	14,160	168.87	2,391,199.20
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	23.89	654,586.00



GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	60.86	1,034,620.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	50.00	60,000.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	39.51	1,355,272.02
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	49.53	856,869.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	178.99	1,628,809.00
JIANGXI ZHENGBO TECH -A	27,700	17.26	478,102.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	66.42	763,830.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,742.57	13,243,532.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	185.95	1,822,310.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	23,970	71.65	1,717,450.50
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	27.16	727,888.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	235.49	1,577,783.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	32.20	1,017,520.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.94	722,750.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	270.00	5,724,000.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	17.37	92,061.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	26.52	787,644.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,914	68.67	1,230,154.38
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	164.53	822,650.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	101.39	287,744.82
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	32.24	313,372.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	70.86	875,121.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	18.48	192,192.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	29.53	437,044.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	12.47	309,754.80
OVCTEK CHINA INC-A	13,950	68.60	956,970.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	379.99	2,013,947.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	4,700	235.98	1,109,106.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	19.19	725,957.70
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,800	288.26	1,095,388.00
BEIJING TIANAN BIOLOGICAL-A	23,400	35.60	833,040.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	143.82	791,010.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	354.26	779,372.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	44.40	679,320.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	27.73	282,846.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	151.98	1,504,602.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	41.82	928,111.26
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.18	498,880.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	128.00	1,024,000.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	46.27	872,189.50
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	31,752	89.37	2,837,676.24
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	16,380	40.23	658,967.40

SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	8.52	546,132.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	171.24	1,164,432.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	29.28	204,960.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	23.58	264,850.56
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	103,300	5.50	568,150.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	15.06	293,670.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	50.50	858,500.00
WUXI APPTec CO LTD-A	8,820	119.45	1,053,549.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	23.03	601,083.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	102.91	730,661.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	231.32	902,148.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	33.84	305,236.80
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	30.13	729,146.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	60.66	588,402.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.21	1,135,056.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.80	278,400.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.60	454,940.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	6.08	351,424.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	8.15	411,575.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	34.60	830,400.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.95	361,725.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.40	799,360.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	4.08	525,912.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	43.03	4,513,847.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.22	1,428,192.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.26	747,444.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.98	1,300,776.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	17.99	1,712,648.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	17.84	2,130,096.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.76	673,540.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	9.43	1,304,169.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	4.60	563,500.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	13.33	587,853.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	8.47	168,553.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	13.23	617,841.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	73,060	22.23	1,624,123.80
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	30.27	1,307,664.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	45.52	1,097,032.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	15,200	26.92	409,184.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	19.74	71,064.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	10.74	646,548.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	9.53	789,084.00

GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	17.67	1,070,802.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	148.13	799,902.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	8.44	366,296.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	19.96	628,740.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	8.81	774,399.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	13.23	564,921.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	11.75	372,475.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	45,800	14.93	683,794.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.38	1,114,736.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	5.36	611,040.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	6.20	586,520.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	16.28	711,436.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	33.45	608,790.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	82.98	5,543,064.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	14.21	258,622.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	14.72	805,184.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	29.57	1,587,909.00
GEMDALE CORP-A	45,500	14.37	653,835.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	6.40	752,640.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	9.11	640,979.60
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.19	1,324,342.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	34.15	437,120.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	19.43	165,155.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	140,000	3.28	459,200.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	15.87	426,903.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	36.22	488,970.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	20.19	581,472.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	75.56	506,252.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	9.46	526,922.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	94.10	856,310.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	41.70	450,360.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	201.49	604,470.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	4,700	65.23	306,581.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	38,870	48.40	1,881,308.00
ADDSINO CO LTD -A	34,700	20.67	717,249.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	59.23	793,682.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	5.35	613,110.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	34.18	957,040.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	16.67	580,116.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	5,640	37.23	209,977.20
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	26.32	547,456.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	14.40	649,440.00

FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	15,400	26.59	409,486.00
GOERTEK INC -A	26,900	46.75	1,257,575.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	14.08	704,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	103.73	726,110.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	58,500	48.40	2,831,400.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	30.84	607,918.08
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	59,450	59.60	3,543,220.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,800	571.12	1,028,016.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	204.49	633,919.00
NINESTAR CORP-A	18,543	30.51	565,746.93
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	16.98	531,474.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	27.93	678,699.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	124.90	594,524.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	22.94	539,090.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	52.76	706,984.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	29.34	836,190.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	15.23	715,810.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	24.49	449,146.60
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	23.31	65,268.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	115.82	486,444.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	21,080	37.74	795,559.20
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	67.51	759,487.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	23.85	722,655.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	54.38	473,106.00
ZTE CORP-A	12,600	38.07	479,682.00
CHINA UNITED NETWORK-A	166,400	4.93	820,352.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.70	816,860.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	20.36	2,728,240.00
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	4.00	1,193,200.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	9.50	642,200.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.46	819,000.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.75	309,375.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,480	225.09	1,008,403.20
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	35,600	16.48	586,688.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	72.17	1,176,371.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	25.17	1,021,902.00
SG MICRO CORP-A	1,400	338.18	473,452.00
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	192.65	500,890.00
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	24.30	716,850.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	28.09	631,069.94
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	43,600	14.17	617,812.00
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,900	239.45	694,405.00

	香港・オフショア人民元 小計	13,189,774		245,922,087.27 (3,910,161,187)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	13.40	315,690.60
	SAUDI ARABIAN OIL CO	239,846	35.50	8,514,533.00
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	60.50	593,142.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	12.28	392,075.84
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	15.48	499,740.84
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	23,917	79.50	1,901,401.50
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	38.60	1,736,382.40
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	97,593	96.00	9,368,928.00
	SAUDI CEMENT	7,489	56.60	423,877.40
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	22.62	476,354.58
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	10.70	707,419.80
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	57.90	1,537,592.40
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	76.10	337,275.20
	JARIR MARKETING CO	7,199	186.00	1,339,014.00
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	131.40	489,465.00
	ALMARAI CO	30,130	54.90	1,654,137.00
	SAVOLA	25,336	46.00	1,165,456.00
	AL RAJHI BANK	135,049	70.00	9,453,430.00
	ALINMA BANK	109,956	15.96	1,754,897.76
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	20.00	1,152,760.00
	BANK AL-JAZIRA	35,813	13.52	484,191.76
	BANK ALBILAD	45,859	24.58	1,127,214.22
	BANQUE SAUDI FRANSI	69,061	31.30	2,161,609.30
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	159,303	41.00	6,531,423.00
	RIYAD BANK	138,943	18.68	2,595,455.24
	SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	30.60	3,111,499.80
	SAUDI BRITISH BANK	71,793	23.80	1,708,673.40
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	122.80	744,536.40
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	86.10	569,379.30
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	8.46	398,398.32	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.59	442,933.33	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	29.20	1,004,888.80	
SAUDI TELECOM CO	65,268	105.80	6,905,354.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	20.42	1,883,152.82	
	サウジアラビアリアル 小計	1,918,910		73,482,283.41 (2,064,117,340)
	合 計	269,245,280		79,013,034,918 (79,013,034,918)

## (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	5,074,960.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	5,074,960.00 (26,186,793)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,993,900.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	58,600	2,005,292.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	763,785.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,520,684.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	26,962	1,118,653.38	
ブラジルリアル 小計		192,062	7,402,314.38 (144,641,222)		
投資信託受益証券合計			250,462	170,828,015 (170,828,015)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	5,353,824.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	5,353,824.00 (27,625,731)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	3,693,988.44	
	南アフリカランド 小計		295,047	3,693,988.44 (25,229,941)	
投資証券合計			603,447	52,855,672 (52,855,672)	
合計				223,683,687 (223,683,687)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 56銘柄	100.0%			16.7%
メキシコペソ	株式 22銘柄	96.0%			1.6%
	投資信託受益証券 1銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.0%	0.0%
ブラジルリアル	株式 51銘柄	96.2%			4.6%

	投資信託受 益証券	5銘柄		3.8%		0.2%
チリペソ	株式	16銘柄	100.0%			0.5%
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	14銘柄	100.0%			0.3%
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	16銘柄	100.0%			0.7%
香港ドル	株式	206銘柄	100.0%			23.9%
マレーシアリンギット	株式	40銘柄	100.0%			1.6%
タイバーツ	株式	43銘柄	100.0%			1.8%
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%			1.3%
韓国ウォン	株式	106銘柄	100.0%			12.1%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			12.4%
インドルピー	株式	86銘柄	100.0%			8.1%
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%			0.7%
南アフリカランド	株式	38銘柄	99.2%			3.7%
	投資証券	1銘柄			0.8%	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	284銘柄	100.0%			4.9%
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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	443,075,857
国債証券	495,958,715,400
地方債証券	32,376,906,724
特殊債券	39,514,368,324
社債券	24,772,795,430
未収入金	1,299,535,600
未収利息	1,004,901,950
前払費用	47,882,154
流動資産合計	595,418,181,439
資産合計	595,418,181,439
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,480,106,979
未払利息	629
流動負債合計	1,480,107,608
負債合計	1,480,107,608
純資産の部	
元本等	
元本	421,545,977,936
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	172,392,095,895
元本等合計	593,938,073,831
純資産合計	593,938,073,831
負債純資産合計	595,418,181,439

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年11月10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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		421,545,977,936口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	有価証券	101,331,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4090円 (14,090円)

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

### (金融商品に関する注記)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

#### 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券

	2020年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	378,873,649,929円
期中追加設定元本額	50,954,150,402円
期中一部解約元本額	8,281,822,395円
期末元本額	421,545,977,936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）	3,687,080,498円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,370,181円
S M T 国内債券インデックス・オープン	18,756,707,125円
世界経済インデックスファンド	2,136,897,628円
D C マイセレクション25	22,384,652,070円

区分	2020年11月10日現在
DCマイセレクション50	24,043,966,195円
DCマイセレクション75	6,393,033,989円
DC日本債券インデックス・オープン	434,067,116円
DC日本債券インデックス・オープンS	91,643,824,477円
DC日本債券インデックス・オープンP	68,881,853,446円
DCマイセレクションS25	9,623,504,061円
DCマイセレクションS50	10,229,550,651円
DCマイセレクションS75	2,018,758,173円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,022,357,766円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,590,934,388円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	557,224,888円
DC世界経済インデックスファンド	2,714,745,656円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,097,213円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	5,240,824円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	40,748,080円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	11,325,153円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	894,939円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	140,336,216円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	195,199,739円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	48,736,578円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	62,086,002円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,669,700,871円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	828,126,818円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,341,223,042円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	761,504,395円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	81,747,612円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,112,331,726円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,260,226,654円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,573,012,266円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	149,877,130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	11,798,402,381円
分散投資コア戦略ファンドA	24,144,902,698円
分散投資コア戦略ファンドS	24,093,323,329円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,668,925円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,037,753,177円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	47,045,381円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,587,126円
SMT インデックスバランス・オープン	54,165,471円
SMT 世界経済インデックス・オープン	18,034,469円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	31,044,702円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	46,646,588円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,400,682円

区分	2020年11月10日現在
グローバル経済コア	208,948,315円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,484,409円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,110,528円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	453,032円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	404,052円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	140,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	107,307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）	74,545,306,828円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	31,998,726円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,410,942,950
地方債証券	72,999,306
特殊債証券	129,951,018
社債証券	20,669,380
合計	3,593,223,894

(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408回利付国債(2年)	690,000,000	691,925,100	
	第409回利付国債(2年)	2,260,000,000	2,266,780,000	
	第410回利付国債(2年)	80,000,000	80,286,400	

第4 1 2 回利付国債(2年)	780,000,000	783,096,600	
第4 1 3 回利付国債(2年)	1,640,000,000	1,646,756,800	
第4 1 4 回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,410,224,000	
第4 1 5 回利付国債(2年)	100,000,000	100,439,000	
第4 1 6 回利付国債(2年)	3,990,000,000	4,008,393,900	
第4 1 7 回利付国債(2年)	4,300,000,000	4,320,339,000	
第1 3 0 回利付国債(5年)	3,160,000,000	3,168,026,400	
第1 3 1 回利付国債(5年)	4,990,000,000	5,005,868,200	
第1 3 2 回利付国債(5年)	4,770,000,000	4,788,412,200	
第1 3 3 回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,400,367,000	
第1 3 4 回利付国債(5年)	5,850,000,000	5,880,888,000	
第1 3 5 回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,103,582,400	
第1 3 6 回利付国債(5年)	2,840,000,000	2,857,806,800	
第1 3 7 回利付国債(5年)	6,860,000,000	6,907,196,800	
第1 3 8 回利付国債(5年)	9,420,000,000	9,489,048,600	
第1 3 9 回利付国債(5年)	4,760,000,000	4,796,842,400	
第1 4 0 回利付国債(5年)	7,300,000,000	7,360,809,000	
第1 4 1 回利付国債(5年)	7,420,000,000	7,486,112,200	
第1 4 2 回利付国債(5年)	5,630,000,000	5,682,246,400	
第1 4 3 回利付国債(5年)	3,530,000,000	3,563,958,600	
第1 4 4 回利付国債(5年)	6,820,000,000	6,887,859,000	
第1 4 5 回利付国債(5年)	2,860,000,000	2,888,600,000	
第1 回利付国債(40年)	400,000,000	584,280,000	
第2 回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,601,074,400	
第3 回利付国債(40年)	550,000,000	782,320,000	
第4 回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,715,016,000	
第5 回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,480,933,500	
第6 回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,720,101,600	
第7 回利付国債(40年)	1,040,000,000	1,367,433,600	
第8 回利付国債(40年)	1,030,000,000	1,266,498,300	
第9 回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,038,334,400	
第10 回利付国債(40年)	2,370,000,000	2,551,707,900	
第11 回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,870,693,200	
第12 回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,616,360,400	
第13 回利付国債(40年)	870,000,000	821,375,700	
第3 1 9 回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,733,307,300	
第3 2 0 回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,627,216,400	
第3 2 1 回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,639,988,000	
第3 2 2 回利付国債(10年)	750,000,000	760,522,500	
第3 2 3 回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,962,288,900	
第3 2 4 回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,781,428,800	
第3 2 5 回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,971,100,000	

第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,175,348,800	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,253,353,400	
第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,458,990,000	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,304,990,000	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,950,958,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	918,972,000	
第332回利付国債(10年)	4,250,000,000	4,346,772,500	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,103,962,300	
第334回利付国債(10年)	1,790,000,000	1,836,987,500	
第335回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,509,339,000	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	523,045,800	
第337回利付国債(10年)	2,850,000,000	2,899,390,500	
第338回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,129,615,000	
第339回利付国債(10年)	5,050,000,000	5,170,392,000	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,475,788,000	
第341回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,204,906,400	
第342回利付国債(10年)	6,380,000,000	6,448,648,800	
第343回利付国債(10年)	4,050,000,000	4,095,643,500	
第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,718,219,200	
第345回利付国債(10年)	2,640,000,000	2,672,419,200	
第346回利付国債(10年)	5,200,000,000	5,266,456,000	
第347回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,930,284,800	
第348回利付国債(10年)	4,840,000,000	4,903,452,400	
第349回利付国債(10年)	3,630,000,000	3,677,988,600	
第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	5,867,064,900	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,850,000,000	4,913,001,500	
第352回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,313,803,800	
第353回利付国債(10年)	4,470,000,000	4,524,534,000	
第354回利付国債(10年)	5,030,000,000	5,089,001,900	
第355回利付国債(10年)	4,870,000,000	4,924,592,700	
第356回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,144,157,600	
第357回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,695,525,200	
第358回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,652,145,600	
第359回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,093,516,200	
第360回利付国債(10年)	1,770,000,000	1,782,159,900	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	137,341,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	195,622,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	146,067,600	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	141,482,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	61,218,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	438,735,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	225,100,800	

第8回利付国債(30年)	140,000,000	167,892,200
第9回利付国債(30年)	240,000,000	276,494,400
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,760,000
第11回利付国債(30年)	260,000,000	310,047,400
第12回利付国債(30年)	190,000,000	236,734,300
第13回利付国債(30年)	290,000,000	358,500,900
第14回利付国債(30年)	300,000,000	387,351,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	445,049,800
第16回利付国債(30年)	200,000,000	262,556,000
第17回利付国債(30年)	770,000,000	1,003,094,400
第18回利付国債(30年)	345,000,000	445,774,500
第19回利付国債(30年)	380,000,000	492,195,000
第20回利付国債(30年)	480,000,000	637,449,600
第21回利付国債(30年)	500,000,000	651,105,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	534,256,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	575,744,200
第24回利付国債(30年)	380,000,000	510,408,400
第25回利付国債(30年)	350,000,000	460,379,500
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,521,489,600
第27回利付国債(30年)	1,510,000,000	2,049,613,600
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,921,378,200
第29回利付国債(30年)	1,520,000,000	2,057,532,800
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,375,463,900
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,463,869,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,113,285,200
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,373,152,600
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,419,031,750
第35回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,796,839,100
第36回利付国債(30年)	2,030,000,000	2,674,240,800
第37回利付国債(30年)	2,230,000,000	2,899,423,700
第38回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,835,133,300
第39回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,566,660,000
第40回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,503,590,400
第41回利付国債(30年)	590,000,000	746,704,000
第42回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,925,581,600
第43回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,597,780,800
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,548,546,000
第45回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,348,248,000
第46回利付国債(30年)	1,750,000,000	2,146,217,500
第47回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,688,296,500
第48回利付国債(30年)	1,990,000,000	2,396,576,900
第49回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,385,508,500
第50回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,615,334,400

第5 1 回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,706,522,300	
第5 2 回利付国債(30年)	1,980,000,000	1,957,586,400	
第5 3 回利付国債(30年)	690,000,000	697,872,900	
第5 4 回利付国債(30年)	2,200,000,000	2,329,272,000	
第5 5 回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,100,340,800	
第5 6 回利付国債(30年)	1,940,000,000	2,051,084,400	
第5 7 回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,637,544,000	
第5 8 回利付国債(30年)	1,890,000,000	1,995,216,300	
第5 9 回利付国債(30年)	340,000,000	350,121,800	
第6 0 回利付国債(30年)	2,560,000,000	2,763,084,800	
第6 1 回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,704,006,600	
第6 2 回利付国債(30年)	20,000,000	19,468,200	
第6 3 回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,021,021,200	
第6 4 回利付国債(30年)	2,100,000,000	1,982,043,000	
第6 5 回利付国債(30年)	860,000,000	810,343,600	
第6 6 回利付国債(30年)	1,030,000,000	968,910,700	
第6 7 回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,546,381,200	
第6 8 回利付国債(30年)	580,000,000	573,463,400	
第5 3 回利付国債(20年)	80,000,000	81,976,800	
第5 4 回利付国債(20年)	200,000,000	205,164,000	
第5 5 回利付国債(20年)	140,000,000	144,060,000	
第5 6 回利付国債(20年)	150,000,000	155,164,500	
第5 7 回利付国債(20年)	240,000,000	247,876,800	
第5 8 回利付国債(20年)	300,000,000	311,397,000	
第5 9 回利付国債(20年)	200,000,000	207,776,000	
第6 0 回利付国債(20年)	350,000,000	361,389,000	
第6 1 回利付国債(20年)	240,000,000	246,458,400	
第6 2 回利付国債(20年)	320,000,000	327,820,800	
第6 3 回利付国債(20年)	200,000,000	210,118,000	
第6 4 回利付国債(20年)	320,000,000	338,630,400	
第6 5 回利付国債(20年)	220,000,000	233,893,000	
第6 6 回利付国債(20年)	330,000,000	349,813,200	
第6 7 回利付国債(20年)	130,000,000	138,864,700	
第6 8 回利付国債(20年)	190,000,000	204,875,100	
第6 9 回利付国債(20年)	390,000,000	419,218,800	
第7 0 回利付国債(20年)	400,000,000	436,580,000	
第7 1 回利付国債(20年)	200,000,000	216,840,000	
第7 2 回利付国債(20年)	630,000,000	684,198,900	
第7 3 回利付国債(20年)	360,000,000	391,417,200	
第7 4 回利付国債(20年)	200,000,000	218,278,000	
第7 5 回利付国債(20年)	130,000,000	142,598,300	
第7 6 回利付国債(20年)	270,000,000	293,803,200	



第77回利付国債(20年)	290,000,000	316,833,700
第78回利付国債(20年)	170,000,000	185,816,800
第79回利付国債(20年)	270,000,000	296,370,900
第80回利付国債(20年)	220,000,000	242,503,800
第81回利付国債(20年)	390,000,000	429,975,000
第82回利付国債(20年)	600,000,000	664,428,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	322,746,800
第84回利付国債(20年)	470,000,000	520,661,300
第85回利付国債(20年)	290,000,000	324,336,000
第86回利付国債(20年)	210,000,000	237,125,700
第87回利付国債(20年)	550,000,000	618,084,500
第88回利付国債(20年)	420,000,000	476,817,600
第89回利付国債(20年)	350,000,000	395,377,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	715,371,300
第91回利付国債(20年)	450,000,000	513,630,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	998,949,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	465,050,700
第94回利付国債(20年)	610,000,000	695,802,600
第95回利付国債(20年)	610,000,000	706,874,100
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,821,376,800
第97回利付国債(20年)	400,000,000	463,204,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	506,488,400
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,329,181,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	560,740,800
第101回利付国債(20年)	715,000,000	845,845,000
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,497,963,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	472,484,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	186,547,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,380,670,800
第106回利付国債(20年)	380,000,000	447,621,000
第107回利付国債(20年)	260,000,000	305,500,000
第108回利付国債(20年)	660,000,000	764,755,200
第109回利付国債(20年)	520,000,000	604,546,800
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,120,392,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,156,618,300
第112回利付国債(20年)	790,000,000	935,178,300
第113回利付国債(20年)	1,720,000,000	2,043,549,200
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,776,847,400
第115回利付国債(20年)	700,000,000	840,623,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,795,762,900
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,291,528,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	785,281,200
第119回利付国債(20年)	530,000,000	620,439,200

第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,807,807,900	
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,775,685,000	
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,103,522,400	
第123回利付国債(20年)	2,030,000,000	2,450,940,800	
第124回利付国債(20年)	610,000,000	730,346,900	
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,001,589,000	
第126回利付国債(20年)	730,000,000	876,620,500	
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,214,361,000	
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,158,083,000	
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,053,190,400	
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,523,714,450	
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,175,000,000	
第132回利付国債(20年)	950,000,000	1,118,805,500	
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,462,101,000	
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,346,406,300	
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,215,678,100	
第136回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,718,488,800	
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,289,328,300	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	719,162,800	
第139回利付国債(20年)	670,000,000	784,844,700	
第140回利付国債(20年)	2,060,000,000	2,441,944,600	
第141回利付国債(20年)	1,780,000,000	2,114,355,200	
第142回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,247,750,400	
第143回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,331,140,000	
第144回利付国債(20年)	1,740,000,000	2,028,579,000	
第145回利付国債(20年)	2,075,000,000	2,474,416,750	
第146回利付国債(20年)	2,780,000,000	3,321,432,800	
第147回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,486,610,000	
第148回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,923,539,600	
第149回利付国債(20年)	3,010,000,000	3,535,275,100	
第150回利付国債(20年)	3,370,000,000	3,917,894,600	
第151回利付国債(20年)	1,255,000,000	1,426,194,550	
第152回利付国債(20年)	3,260,000,000	3,707,076,400	
第153回利付国債(20年)	2,570,000,000	2,960,665,700	
第154回利付国債(20年)	2,920,000,000	3,324,507,600	
第155回利付国債(20年)	2,550,000,000	2,830,449,000	
第156回利付国債(20年)	2,560,000,000	2,610,969,600	
第157回利付国債(20年)	2,820,000,000	2,786,244,600	
第158回利付国債(20年)	2,320,000,000	2,397,488,000	
第159回利付国債(20年)	2,920,000,000	3,061,620,000	
第160回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,574,904,200	
第161回利付国債(20年)	1,740,000,000	1,822,563,000	

	第162回利付国債(20年)	450,000,000	470,902,500
	第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,728,520,100
	第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,829,662,000
	第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,683,574,800
	第166回利付国債(20年)	900,000,000	953,739,000
	第167回利付国債(20年)	2,770,000,000	2,835,898,300
	第168回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,397,158,500
	第169回利付国債(20年)	760,000,000	749,428,400
	第170回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,324,718,000
	第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,269,347,100
	第172回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,361,210,400
	第173回利付国債(20年)	2,970,000,000	2,970,000,000
	第174回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,378,730,400
	国債証券合計	461,170,000,000	495,958,715,400
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,454,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,544,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	133,857,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,389,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,452,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,869,000
	第16回東京都公募公債(20年)	300,000,000	346,404,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,113,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,436,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,792,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,440,000
	第702回東京都公募公債	100,000,000	101,125,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	101,560,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	101,412,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	102,189,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	101,910,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,522,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,885,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,723,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	301,812,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	199,438,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,747,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,684,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,972,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,938,000
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	201,370,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	273,672,000
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,119,000

第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,010,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,759,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,414,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,631,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,790,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,723,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	199,348,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	235,030,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,450,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,338,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,227,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,044,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,942,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,657,600	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,342,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,079,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,084,240	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,100,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	500,000,000	503,745,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,815,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	118,314,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,134,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	102,184,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,382,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	99,204,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	103,772,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,837,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	115,579,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,300,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	438,436,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,224,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,294,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	202,538,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,163,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,801,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	102,492,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	300,666,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	119,607,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	103,390,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,214,000	

第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,620,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,529,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,788,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,920,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,955,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,023,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	118,718,000	
平成24年度第18回愛知県公募公債(10年)	150,000,000	152,659,500	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,447,000	
平成25年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,340,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,182,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,607,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,999,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,976,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	309,840,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,778,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	102,128,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,440,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	117,671,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,600,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,788,448	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,683,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	115,454,000	
第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	116,592,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,092,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	106,620,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	237,630,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	235,416,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	198,460,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,493,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,810,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,088,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,032,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,087,000	

平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,121,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,789,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,562,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,791,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	108,028,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,074,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	108,560,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	131,393,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	112,840,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,007,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	102,128,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,560,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	300,996,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	234,092,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	118,208,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,214,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	102,247,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,689,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,326,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,087,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,816,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	298,887,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,901,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,170,000	
第107回共同発行市場公募地方債	800,000,000	810,184,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,348,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,490,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,329,000	
第112回共同発行市場公募地方債	220,000,000	223,053,600	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,664,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,573,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,916,000	
第119回共同発行市場公募地方債	400,000,000	407,048,000	
第121回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,324,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,191,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,905,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,897,000	

第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,646,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,312,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,131,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,006,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,897,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,300,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,688,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,450,982	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,144,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,160,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,054,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,998,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,772,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,768,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,879,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,680,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,096,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,512,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,228,754	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,969,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,223,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	203,026,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	99,974,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,944,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	237,420,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	298,746,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	104,335,000	
平成29年度第1回大阪市公募公債（5年）	100,000,000	99,976,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	130,792,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	135,914,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	115,952,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	124,868,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,505,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,983,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	300,996,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,161,000	
平成24年度第2回京都市公募公債	122,500,000	124,315,450	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,505,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	101,832,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,360,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	136,557,600	

平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	234,498,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	119,382,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	117,574,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	99,222,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,825,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	352,872,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,198,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,648,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,121,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,849,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,296,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	228,942,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	300,993,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	108,870,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,623,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,621,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	116,840,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,547,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,670,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,998,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,945,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	117,864,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	115,897,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	203,990,000	
平成28年度第10回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	99,993,000	
平成30年度第5回福岡市公募公債(5年)	200,000,000	199,982,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債(10年)	100,000,000	101,655,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,127,500	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,733,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,607,950	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	171,832,600	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	549,730,500	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	199,258,000	
平成24年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	101,537,000	
平成24年度第1回岡山市公募公債(10年)	200,000,000	203,620,000	
	200,000,000	202,486,000	



	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）			
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,220,000	
	地方債証券合計	30,759,430,000	32,376,906,724	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,375,580	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	416,457,500	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	317,226,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,334,000	
	第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,724,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	96,527,000	
	第14回道路債券	100,000,000	103,942,000	
	第17回道路債券	100,000,000	103,162,000	
	第21回道路債券	100,000,000	130,327,000	
	第28回道路債券	200,000,000	264,346,000	
	第33回道路債券	200,000,000	268,272,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,373,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,391,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,175,000	
	第42回道路債券	100,000,000	109,417,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,016,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,125,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,425,000	
	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	144,291,000	
	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	235,858,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,169,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,598,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	914,301,000	
	第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,349,000	
	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	132,807,000	
	第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,330,000	
	第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,980,000	

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	119,816,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,665,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,726,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,367,000	
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	304,425,380	
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	202,420,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,648,000	
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	202,892,000	
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	101,513,000	
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	101,501,000	
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	304,722,000	
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	117,292,000	
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	101,865,000	
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	305,661,000	
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	203,160,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	617,808,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	306,058,880	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	637,777,960	
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	204,670,000	
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	151,409,920	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,841,000	
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	102,112,000	
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	231,880,000	
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	104,295,000	
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	102,264,000	
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	102,160,000	
	200,000,000	230,286,000	

第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	102,060,000	
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	101,840,000	
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	303,798,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,171,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,028,000	
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	203,018,000	
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	100,607,000	
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	94,591,000	
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	106,837,360	
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	317,061,760	
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	206,080,350	
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	100,733,000	
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	201,420,000	
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	100,822,000	
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	121,344,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,582,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,992,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	216,959,620	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,595,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	380,064,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,633,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	214,956,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,459,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	396,414,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,271,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,622,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	42,975,600	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	130,476,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	235,738,000	

第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	195,244,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	235,186,000	
第21回地方公共団体金融機構債券(5年)	400,000,000	399,968,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,889,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,369,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,020,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,581,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,680,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,366,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,861,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,160,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,334,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,532,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,309,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,182,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,375,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,817,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,386,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,771,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,946,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,882,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,334,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,525,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,772,060	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,857,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,823,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,221,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,040,480	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,416,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,161,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,921,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,766,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,023,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,261,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	109,100,000	
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	199,834,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,295,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	203,754,000	

第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,931,960	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,857,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,791,700	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,472,140	
第85回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,925,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	212,388,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	171,136,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	93,630,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	108,831,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	103,698,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,568,000	
第59回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	506,370,000	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,917,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,239,000	12,635,176	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,676,000	13,093,293	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,927,000	13,402,972	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	192,492,000	192,453,501	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	136,760,000	136,825,644	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,816,000	13,248,924	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,801,000	14,334,132	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	246,843,000	246,275,261	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,136,000	11,299,365	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,208,000	23,753,852	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,510,000	14,025,271	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	264,678,000	263,756,920	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	93,929,000	93,906,457	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,200,000	12,558,802	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,284,000	14,893,783	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,832,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,173,000	12,532,712	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,300,000	14,928,771	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,187,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,391,000	10,447,527	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,634,000	10,692,274	

第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,789,000	19,989,617	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,124,000	20,433,037	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,339,000	22,956,282	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,093,000	24,681,105	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,467,000	27,363,018	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,371,000	28,273,931	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,436,000	60,483,589	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,390,000	12,732,707	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,988,000	27,527,009	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,561,000	12,913,838	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,310,000	12,739,988	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,198,000	31,047,985	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,610,000	11,888,175	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,916,000	31,890,456	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,945,000	29,733,480	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,604,000	14,239,306	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,084,000	60,389,163	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,759,000	32,566,706	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,175,000	13,650,749	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,062,000	43,453,040	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,824,000	41,016,391	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,868,000	41,093,193	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,230,000	87,765,202	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,884,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,412,000	94,563,719	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,103,000	48,167,953	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,044,000	48,498,145	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,838,000	49,398,165	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,672,000	42,722,275	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,581,000	42,322,330	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,100,000	48,654,862	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,203,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,062,000	129,368,131	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,976,000	174,112,554	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,131,000	49,086,465	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,728,000	50,786,270	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,514,000	51,461,880	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,741,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,275,000	163,419,734	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,585,000	55,458,331	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	112,482,000	115,660,741	
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,159,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,700,000	64,686,336	

第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,225,000	68,119,697	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,796,000	68,010,693	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	203,202,000	210,876,939	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,302,000	141,302,920	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,618,000	68,941,635	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,770,000	74,335,059	
第107回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	405,368,000	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,515,000	77,879,320	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,286,000	82,823,327	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,340,000	82,700,649	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,634,000	83,351,263	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,039,000	84,184,938	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,550,000	84,578,500	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,589,000	86,533,902	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,070,000	87,124,357	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,024,000	86,840,367	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,107,000	86,922,433	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,669,000	87,540,023	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,898,000	176,277,945	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,917,000	87,728,804	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,300,000	178,397,970	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,117,000	88,954,111	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,912,000	178,309,604	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,036,000	89,863,144	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,272,000	181,519,482	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,166,000	181,401,938	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,554,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,013,000	92,217,101	
	91,425,000	92,830,202	

第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,558,000	92,161,367	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,666,000	186,031,762	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,206,000	93,299,206	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,283,000	93,512,476	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,640,000	187,776,977	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,807,000	94,144,299	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,906,000	282,437,960	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,424,000	189,069,484	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,270,000	97,550,137	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,634,000	97,597,875	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,948,000	199,853,213	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,280,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,132,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,458,000	
第294回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,927,000	
第58回日本学生支援債券	100,000,000	99,981,000	
第59回日本学生支援債券	200,000,000	199,954,000	
第60回日本学生支援債券	200,000,000	199,946,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	109,127,000	
い第800号商工債	200,000,000	200,046,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,020,000	
い第804号商工債	300,000,000	300,045,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,324,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,806,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,802,000	
第337回信金中金債(5年)	100,000,000	100,138,000	
第338回信金中金債(5年)	100,000,000	100,143,000	
第339回信金中金債(5年)	200,000,000	200,298,000	
第342回信金中金債(5年)	100,000,000	100,152,000	
第350回信金中金債(5年)	100,000,000	100,064,000	
第360回信金中金債(5年)	200,000,000	199,554,000	
第236号商工債(3年)	300,000,000	299,799,000	
第2回信金中金債(10年)	100,000,000	102,210,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,887,000	



	第39回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,008,000	
	第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,630,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,502,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,350,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,280,000	
	第42回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,217,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	401,256,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,372,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,828,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,770,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	198,720,000	
	特殊債券合計	37,968,477,000	39,514,368,324	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,695,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	295,110,000	
	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	100,280,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,362,000	
	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	99,553,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,269,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,583,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,579,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,800,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,578,000	
	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	203,814,000	
	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	400,908,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,675,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,037,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,971,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,815,000	
	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	99,952,000	
	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	99,957,000	

第13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	200,000,000	200,124,000	
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	101,594,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,930,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,406,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,230,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,878,000	
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	102,034,000	
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	99,967,000	
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	99,764,000	
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	100,575,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,022,000	
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	100,745,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,153,000	
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	100,397,000	
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	199,162,000	
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	200,234,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,040,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,936,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,072,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,128,000	
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	99,917,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,907,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,903,000	
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	199,778,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,709,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,116,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,949,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,115,000	
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	98,805,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,144,000	
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	100,352,000	

第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,185,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,989,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,246,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,442,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,298,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,782,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,614,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,675,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,959,000	
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	100,126,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,132,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,364,000	
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	100,100,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,081,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	95,820,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,808,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,273,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,652,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,706,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,250,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,239,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,728,000	
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	97,799,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	118,432,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	113,327,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,537,000	
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	101,152,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,397,000	
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	303,864,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,910,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,358,000	
	200,000,000	200,122,000	

第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債			
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,073,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,014,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,157,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,540,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,895,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,169,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,333,000	
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	200,272,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,059,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,132,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,025,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,998,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,154,000	
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	199,584,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,834,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,178,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,181,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,254,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,072,000	
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	102,103,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,238,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,993,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,812,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,982,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,086,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,948,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,922,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,019,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,512,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	234,660,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,602,000	
	100,000,000	107,924,000	

第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,017,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,586,720	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,346,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,957,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,806,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,675,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,650,400	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,558,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,211,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,968,000	
第83回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,720,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,778,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	94,139,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,981,000	
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	192,860,000	
第62回名古屋鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	199,650,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,315,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,078,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,988,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,313,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	101,436,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,017,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,319,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,168,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,387,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,089,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,044,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	202,470,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,603,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,111,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,748,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,341,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,743,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,492,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,308,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,465,000	

第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,725,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,976,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	200,890,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,189,500	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,026,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,243,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,776,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,308,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,442,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,925,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,108,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,412,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,715,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,142,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,684,000	
第317回北海道電力株式会社社債	200,000,000	206,202,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	101,586,810	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,930,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,363,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,581,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,705,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,182,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,096,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,530,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	403,224,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,817,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	302,028,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,400,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,045,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	199,708,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,975,000	
第6回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	99,837,000	
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	100,845,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	201,338,000	
社債券合計	24,466,000,000	24,772,795,430	
合計		592,622,785,878	

(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。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	97,719,781
コール・ローン	2,317,308,466
国債証券	272,910,198,619
派生商品評価勘定	10,580,673
未収入金	127,667
未収利息	1,704,929,199
前払金	18,203,046
前払費用	73,619,450
差入委託証拠金	493,516,770
流動資産合計	277,626,203,671
資産合計	277,626,203,671
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,758,679
未払金	10,853,803
未払解約金	244,679,879
未払利息	3,291
流動負債合計	274,295,652
負債合計	274,295,652
純資産の部	
元本等	
元本	93,613,991,047
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	183,737,916,972
元本等合計	277,351,908,019
純資産合計	277,351,908,019
負債純資産合計	277,626,203,671

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2020年11月10日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,613,991,047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 2.9627円 (1万口当たり純資産額) (29,627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11月10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11月10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11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	94,868,892,209円
期中追加設定元本額	7,228,366,738円
期中一部解約元本額	8,483,267,900円
期末元本額	93,613,991,047円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,538,673,190円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	610,778,341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）	2,054,295,353円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,005,429円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,713,835,810円
世界経済インデックスファンド	7,341,104,381円
D C マイセレクション 2 5	1,798,272,627円
D C マイセレクション 5 0	1,443,535,477円
D C マイセレクション 7 5	888,075,363円

区分	2020年11月10日現在
D C外国債券インデックス・オープン	2,085,187,692円
D CマイセクションS 2 5	766,592,493円
D CマイセクションS 5 0	615,197,217円
D CマイセクションS 7 5	282,479,833円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	39,980,703円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	71,413,406円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	35,018,969円
D C世界経済インデックスファンド	9,268,721,652円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	686,693,494円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	8,512,230円
マイセクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	2,415,114円
マイセクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	1,584,618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)	36,723,712円
バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	75,787,804円
バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	112,041,485円
バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	116,531,300円
バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	169,665,107円
バランスA(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	1,708,696,058円
バランスB(3 7. 5)V A 1(適格機関投資家専用)	501,420,198円
バランスC(5 0)V A 1(適格機関投資家専用)	1,889,998,929円
世界バランスV A 1(適格機関投資家専用)	758,708,982円
世界バランスV A 2(適格機関投資家専用)	62,185,884円
バランスD(3 5)V A 1(適格機関投資家専用)	524,132,281円
バランスE(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	198,073,395円
バランスF(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	245,660,755円
F O F s用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	841,333,761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)	932,613,327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	591,489,976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	1,090,641,754円
分散投資コア戦略ファンドS	2,150,936,306円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	339,459,654円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,124,250,729円
コア投資戦略ファンド(切替型)	784,171,448円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	199,302,251円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	96,562,684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)	1,138,955,778円
S M T インデックスバランス・オープン	187,417,104円
外国債券S M T Bセクション(SMA専用)	20,988,038,191円
S M T 世界経済インデックス・オープン	128,759,924円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	123,657,984円

区分	2020年11月10日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	217,728,075円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,299,901円
グローバル経済コア	772,565,569円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,382,808円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	325,998円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	232,161,402円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,200,031円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	294,833円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	429,692円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	235,401円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	456,664円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	603,041,327円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,361,889,976円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	340,471,811円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	367,608,121円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	135,780,326円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	262,795,427円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		543,857,976
合計		543,857,976

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,376,011,895	-	2,357,808,849	18,203,046
	合計	2,376,011,895	-	2,357,808,849	18,203,046

## (注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,986,871,460	-	1,996,896,500	10,025,040
	アメリカドル	835,093,289	-	837,392,000	2,298,711
	カナダドル	115,672,755	-	117,189,000	1,516,245
	ユーロ	872,300,360	-	876,103,500	3,803,140
	イギリスポンド	163,805,056	-	166,212,000	2,406,944
	合計	1,986,871,460	-	1,996,896,500	10,025,040

### (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 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,484,179.72	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,162,291.04	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,006,875.04	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	993,281.25	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,927,734.40	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,998,750.00	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,327,070.36	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,824,936.30	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,260,894.51	

T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,917,031.25	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,469,648.45	
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	7,033,437.50	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,741,992.25	
T 0.625% 08/15/30	10,950,000.00	10,642,886.77	
T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,591,512.50	
T 1.125% 08/15/40	4,800,000.00	4,505,249.99	
T 1.25% 05/15/50	6,850,000.00	6,112,019.55	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,676,902.36	
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,108,984.40	
T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,385,664.04	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,152,734.40	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	9,118,054.73	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,580,273.45	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,132,187.52	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,114,843.75	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,574,267.59	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,828,882.81	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,033,390.66	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,123,593.76	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,234,179.70	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,862,000.00	
T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,731,376.96	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,888,144.51	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,587,265.62	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,622,636.71	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,777,183.63	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,036,054.69	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,563,964.85	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	7,202,988.31	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,130,468.75	
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,603,125.00	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,757,105.48	
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,313,878.10	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,332,179.73	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,811,005.84	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,552,050.77	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,760,584.94	
T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,628,261.70	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,891,214.85	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,832,843.36	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,784,086.92	

T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,180,468.75
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,526,375.00
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,540,187.46
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,302,588.88
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,235,078.14
T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,152,920.90
T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,147,246.12
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,555,859.37
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,630,732.41
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,561,945.31
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,262,792.98
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,585,737.50
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,122,187.52
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,354,140.64
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,744,995.32
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,698,672.87
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,498,929.67
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,412,175.79
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,862,210.95
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,901,923.43
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,586,656.25
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,365,265.66
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,191,601.54
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,124,375.02
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,558,125.04
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,833,890.63
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,578,750.00
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,539,657.79
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,255,937.52
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,865,277.38
T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,119,218.76
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,476,601.58
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,457,101.56
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	8,230,865.62
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	6,209,843.75
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,777,914.09
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,925,919.89
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,795,140.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,475,960.93
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,781,250.00
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,058,875.00
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,242,187.50
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,160,050.02

T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,374,250.00	
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,959,375.00	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	9,036,281.25	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,387,695.30	
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	8,692,968.75	
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,679,892.57	
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,753,550.79	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,450,000.00	
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,030,953.16	
T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,202,766.42	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,726,875.00	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,271,958.99	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,511,941.42	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,969,652.36	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,836,330.08	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,214,693.75	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,451,037.50	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,478,148.43	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,960,839.88	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,210,652.35	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,760,039.08	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,463,382.84	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,243,515.64	
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,580,625.00	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,825,984.38	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,130,532.80	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,095,117.21	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,068,632.81	
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,598,289.06	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,140,707.05	
T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	8,029,394.55	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,666,546.87	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,581,868.75	
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,463,973.45	
T 2.75% 11/15/47	6,050,000.00	7,510,507.80	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,442,812.52	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,402,315.62	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,456,410.18	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,100,879.68	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,248,705.45	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,090,885.96	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,349,290.66	



T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,414,304.70
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,111,445.31
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,695,410.15
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,581,582.07
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,341,914.08
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,558,642.57
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,203,515.65
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,046,582.05
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,355,078.15
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,600,392.99
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,510,410.17
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,840,097.67
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,093,867.18
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,405,942.56
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,358,203.10
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,445,375.00
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,089,498.48
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,074,531.26
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,246,449.21
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,058,121.10
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,556,015.62
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,240,351.58
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,253,535.16
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,936,937.50
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,271,992.18
T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,115,982.81
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	7,364,101.58
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,041,906.25
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,371,437.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,802,656.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,823,437.50
T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	7,853,828.12
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,066,363.28
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,623,812.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,777,003.92
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,121,328.16
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,067,778.12
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,494,218.75
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,397,572.68
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,089,683.62
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,723,523.44
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,631,445.30
T 3% 11/15/44	4,050,000.00	5,193,492.18

	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,331,437.50	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,513,617.18	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,484,843.75	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,873,453.12	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,972,226.56	
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,897,973.44	
	T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,328,107.81	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	829,296.87	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,592,234.37	
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,694,950.00	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,191,679.68	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,721,671.87	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,698,730.47	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,756,117.19	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,806,628.91	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,633,031.25	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,188,816.40	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,995,902.35	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,569,011.72	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,924,570.31	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,835,435.54	
	アメリカドル 小計	1,033,570,000.00	1,126,759,590.06 (118,546,376,470)	
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	1,210,000.00	1,208,330.20	
	CAN 0.25% 03/01/26	1,200,000.00	1,182,564.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	700,000.00	697,445.00	
	CAN 0.5% 03/01/22	3,600,000.00	3,612,564.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	3,995,266.80	
	CAN 0.5% 12/01/30	1,360,000.00	1,319,540.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	5,190,000.00	5,428,532.40	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,898,743.60	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,228,718.70	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,103,587.30	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,436,200.80	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	625,320.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,742,066.40	
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	514,935.00	
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,534,150.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,444,486.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,949,742.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,425,387.60	
	CAN 2.5% 06/01/24	3,300,000.00	3,551,493.00	

	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,813,240.10	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,523,824.80	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	832,585.60	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,445,886.30	
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,513,475.10	
	CAN 2% 12/01/51	2,770,000.00	3,250,207.20	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,700,000.00	2,529,430.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,420,000.00	2,164,775.80	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,661,400.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,350,000.00	2,129,760.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,130,000.00	1,819,175.70	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,130,000.00	1,671,586.40	
	カナダドル 小計	61,050,000.00	68,254,419.80 (5,517,004,752)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,425,450.50	
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	35,305,781.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,337,644.30	
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,099,524.50	
	MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,111,855.00	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,130,368.20	
	MBONO 7.5% 06/03/27	34,220,000.00	38,115,947.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	19,009,558.60	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,527,721.60	
	MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,848,964.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,676,996.70	
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,279,472.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,378,898.00	
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	24,000,033.60	
	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,623,209.60	
	メキシコペソ 小計	387,480,000.00	430,871,424.60 (2,223,296,550)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,424,279.40	
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	1,005,940.60	
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	715,095.30	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,695,718.80	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,326,757.60	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,838,314.40	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,710,477.60	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,623,730.00	
	BGB 0% 10/22/27	1,520,000.00	1,570,844.00	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,001,036.50	
	BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	884,145.60	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,320,000.00	1,723,893.60	

BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,352,870.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,378,303.50
BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,593,605.00
BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,688,587.20
BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,436,056.80
BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,994,318.50
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,223,707.10
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,396,778.60
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,169,492.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,465,308.90
BGB 4.25% 03/28/41	2,190,000.00	3,943,533.00
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,297,967.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,457,353.20
BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,299,531.80
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,604,394.00
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,026,524.20
BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,659,752.50
BKO 0% 03/11/22	6,580,000.00	6,642,904.80
BKO 0% 06/10/22	600,000.00	606,918.00
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,046,037.00
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	588,694.20
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,600,253.00
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,226,051.10
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,325,285.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,249,864.60
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,057,380.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,654,742.60
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,287,890.80
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,468,107.60
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,054,722.50
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,065,713.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	1,064,650.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,972,384.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,250,000.00	1,312,012.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,444,164.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,056,963.50
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,545,176.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,569,084.10
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,425,782.20
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,281,351.50
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,768,777.80
BTPS 1.7% 09/01/51	620,000.00	630,341.60
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,414,464.00

BTPS 1.8% 03/01/41	1,340,000.00	1,433,223.80	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,138,400.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,921,319.00	
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,209,680.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,047,071.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,536,896.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,572,225.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,554,557.60	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,617,126.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,790,000.00	2,111,358.70	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,470,000.00	1,763,338.50	
BTPS 2.45% 10/01/23	910,000.00	980,752.50	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,301,315.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,253,348.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,142,494.90	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,697,942.40	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,230,729.20	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,606,513.50	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,834,932.00	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,288,508.20	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,843,983.60	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,668,029.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,896,278.60	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	3,012,944.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,986,986.40	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,462,631.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,293,568.00	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,052,932.80	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,173,087.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,554,323.20	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,006,127.40	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,631,664.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,809,132.90	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,641,528.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	5,014,410.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,340,852.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	5,004,826.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,382,562.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,848,302.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,803,537.20	
BTPS 5% 03/01/22	650,000.00	696,299.50	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,447,156.20	

BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	5,161,087.80
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,206,462.80
BTPS 6.5% 11/01/27	5,240,000.00	7,428,014.40
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	6,014,094.80
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,980,328.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,020,040.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,392,871.20
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,172,997.50
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,333,690.00
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,163,530.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,198,780.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,596,352.60
DBR 0.5% 08/15/27	4,690,000.00	5,074,580.00
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,755,140.20
DBR 0% 05/15/35	2,010,000.00	2,102,862.00
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,533,831.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,682,140.00
DBR 0% 08/15/30	3,620,000.00	3,805,525.00
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	706,032.60
DBR 0% 08/15/50	2,180,000.00	2,229,442.40
DBR 1.25% 08/15/48	3,270,000.00	4,510,409.10
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,113,180.00
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,305,437.20
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,474,940.40
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,915,108.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,787,709.00
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,176,317.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,134,940.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,950,492.80
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,843,619.60
DBR 2.5% 08/15/46	3,800,000.00	6,430,360.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,404,940.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,081,793.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,581,486.60
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,043,877.80
DBR 4.25% 07/04/39	2,550,000.00	4,772,707.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,634,897.50
DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,428,866.80
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,708,194.90
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,632,153.60
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,378,680.00
DBR 6.25% 01/04/24	4,450,000.00	5,449,381.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,056,825.00

DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,461,258.40	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,908,430.80	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,881,853.90	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,397,741.40	
FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,305,320.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	1,310,000.00	1,391,992.90	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,500,322.50	
FRTR 0.75% 05/25/52	2,280,000.00	2,477,812.80	
FRTR 0.75% 11/25/28	4,500,000.00	4,929,120.00	
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,017,660.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,081,652.00	
FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,205,134.90	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,377,073.40	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,086,612.00	
FRTR 0% 03/25/25	8,090,000.00	8,315,872.80	
FRTR 0% 05/25/22	2,800,000.00	2,829,848.00	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,420,324.80	
FRTR 0% 11/25/30	2,560,000.00	2,626,867.20	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	6,039,866.70	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,285,344.40	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,431,588.80	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,690,000.00	4,813,014.60	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,877,884.80	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,530,000.00	2,283,632.10	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,516,684.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,570,051.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,118,627.00	
FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,931,058.80	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,530,418.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,073,838.40	
FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000.00	7,893,034.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,784,008.00	
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,953,509.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,703,777.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,793,609.00	
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	8,947,950.60	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,762,106.60	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,490,000.00	8,420,725.60	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,271,934.40	
FRTR 4% 04/25/55	2,170,000.00	4,615,590.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,910,995.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,747,332.80	

FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,800,599.40
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,476,301.00
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,535,246.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,227,930.00
IRISH 0.2% 05/15/27	760,000.00	791,296.80
IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	861,232.90
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	504,523.20
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	835,850.60
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,172,334.80
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,614.40
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,343,220.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	784,174.70
IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	996,034.80
IRISH 1.5% 05/15/50	650,000.00	837,466.50
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	1,031,387.80
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,539,862.20
IRISH 2.4% 05/15/30	1,270,000.00	1,590,941.70
IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,517,552.50
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,101,376.80
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,119,221.40
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,906,586.40
NETHER 0.25% 07/15/25	1,870,000.00	1,952,747.50
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,821,321.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,100,000.00	1,236,092.00
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,473,769.60
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,302,579.70
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,784,332.80
NETHER 0% 01/15/22	1,490,000.00	1,502,560.70
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,892,402.00
NETHER 0% 01/15/27	1,160,000.00	1,203,616.00
NETHER 0% 01/15/52	710,000.00	708,210.80
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,676,686.20
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,265,601.40
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	693,171.60
NETHER 2.5% 01/15/33	1,640,000.00	2,219,723.60
NETHER 2.75% 01/15/47	2,100,000.00	3,671,535.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,191,288.50
NETHER 3.75% 01/15/23	2,430,000.00	2,669,233.50
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,789,184.60
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,582,104.80
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,499,746.20
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	236,322.00
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,976,328.00



OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,677,374.50	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,874,462.50	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,261,602.80	
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,219,155.20	
OBL 0% 10/10/25	2,240,000.00	2,321,468.80	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,544,563.90	
OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,420,077.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,263,471.30	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	952,335.60	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,770,708.60	
RAGB 0.75% 03/20/51	460,000.00	535,955.20	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,313,939.20	
RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,168,860.70	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,528,875.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,240,000.00	1,271,210.80	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,339.20	
RAGB 0% 10/20/40	290,000.00	286,911.50	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,563,719.30	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,259,675.70	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	532,270.20	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,082,446.20	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,427,888.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,610,561.60	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,394,661.20	
RAGB 3.15% 06/20/44	960,000.00	1,657,756.80	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,559,774.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,233,462.80	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,118,036.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,094,964.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,702,528.40	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,728,900.60	
RFGB 0.125% 04/15/36	520,000.00	536,328.00	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	417,452.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	658,254.00	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,403,494.70	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	721,998.70	
RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	703,072.50	
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	556,735.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	741,646.50	
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	393,997.50	
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	550,929.60	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	431,050.20	

RFGB 0% 09/15/30	250,000.00	258,345.00
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	751,884.80
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	656,090.40
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	685,353.50
RFGB 1.625% 09/15/22	1,130,000.00	1,179,426.20
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	924,128.80
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	526,243.20
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	798,481.30
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	1,012,865.60
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,941,387.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,350,387.30
SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,469,529.40
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,423,914.10
SPGB 0.45% 10/31/22	2,360,000.00	2,407,672.00
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	3,002,689.00
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,909,659.20
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,125,500.00
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,387,623.50
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,410,464.00
SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,844,024.00
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,371,012.50
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,771,160.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,120,000.00	2,352,860.80
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,669,864.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,202,427.80
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,883,868.00
SPGB 1.5% 04/30/27	2,330,000.00	2,586,742.70
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,321,877.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,110,000.00	2,516,934.60
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,157,063.10
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,453,941.40
SPGB 1% 10/31/50	1,600,000.00	1,598,000.00
SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,653,702.00
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	3,041,679.60
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,642,281.00
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,058,280.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,070,000.00	3,026,133.00
SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	3,414,691.00
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,896,664.40
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,976,274.50
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	3,085,618.30
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,515,920.00
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,650,360.00

	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,811,552.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,350,000.00	4,182,365.50	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,539,273.10	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,581,489.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,379,468.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,258,195.60	
	SPGB 5.85% 01/31/22	3,760,000.00	4,055,573.60	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,717,000.80	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,567,282.50	
	ユーロ 小計	747,560,000.00	908,226,978.60 (112,865,366,630)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,700,000.00	1,703,315.00	
	UKT 0.125% 01/31/23	2,790,000.00	2,797,337.70	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,250,000.00	1,240,887.50	
	UKT 0.375% 10/22/30	3,960,000.00	3,952,396.80	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,177,058.50	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,156,071.60	
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,493,942.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,000,000.00	985,460.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	2,000,000.00	1,825,400.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,972,215.80	
	UKT 0.875% 10/22/29	2,550,000.00	2,675,409.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,210,183.60	
	UKT 1.25% 10/22/41	1,650,000.00	1,758,091.50	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,164,620.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,875,227.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,444,046.00	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,600,000.00	1,910,512.00	
	UKT 1.625% 10/22/71	800,000.00	1,069,528.00	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,555,437.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,180,000.00	2,735,420.40	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,220,370.40	
	UKT 1.75% 09/07/37	3,100,000.00	3,567,945.00	
	UKT 1% 04/22/24	2,620,000.00	2,712,538.40	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,661,775.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	3,046,060.80	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,791,639.00	
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,950,435.00		
UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,315,762.80		
UKT 3.5% 01/22/45	2,800,000.00	4,348,400.00		
UKT 3.5% 07/22/68	2,000,000.00	4,027,940.00		
UKT 3.75% 07/22/52	1,850,000.00	3,271,022.00		

	UKT 4.25% 03/07/36	2,490,000.00	3,773,370.90	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,773,309.50	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,006,815.60	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,766,067.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,070,000.00	3,364,888.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,840,702.20	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,490,000.00	2,739,037.20	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,391,955.10	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,680,222.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	4,028,099.40	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,600,000.00	3,723,876.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,756,077.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,700,000.00	3,426,877.00	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,053,369.50	
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,408,472.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,822,825.00	
	イギリスポンド 小計	100,420,000.00	129,172,412.70	(17,892,962,607)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,570,000.00	3,609,841.20	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,570,844.50	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,979,745.70	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,209,125.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,682,956.90	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,170,000.00	10,347,978.20	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	9,124,840.40	
	SGB 3.5% 06/01/22	12,650,000.00	13,421,397.00	
	スウェーデンクローナ 小計	66,340,000.00	73,946,728.90	(901,410,625)
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,340,000.00	4,583,647.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,166,252.90	
	NGB 1.75% 02/17/27	3,250,000.00	3,497,910.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,300,000.00	4,545,788.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,170,425.00	
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,381,278.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,753,638.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	8,011,433.60	
	ノルウェークローネ 小計	47,820,000.00	51,110,373.50	(593,902,540)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	4,120,000.00	4,195,890.40	
	DGB 0.25% 11/15/52	2,830,000.00	3,015,166.90	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,502,667.30	
	DGB 0.5% 11/15/29	13,020,000.00	14,095,191.60	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,908,161.80	

	DGB 1.75% 11/15/25	8,030,000.00	8,998,819.50	
	DGB 3% 11/15/21	10,860,000.00	11,259,322.20	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,430,000.00	31,249,860.00	
	デンマーククローネ 小計	73,440,000.00	92,225,079.70 (1,539,236,580)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	960,000.00	976,694.40	
	POLGB 1.25% 10/25/30	210,000.00	210,184.80	
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,647,829.70	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,248,565.80	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,178,491.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,230,000.00	6,746,716.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,710,904.60	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,560,768.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,824,814.30	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,433,386.80	
	POLGB 3.25% 07/25/25	5,210,000.00	5,908,973.60	
	POLGB 4% 10/25/23	3,430,000.00	3,829,972.30	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	837,156.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,487,081.50	
	ポーランドズロチ 小計	56,860,000.00	62,601,539.00 (1,733,436,614)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,382,498.20	
	ACGB 0.25% 11/21/25	3,590,000.00	3,586,338.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,410,000.00	3,432,437.80	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,993,873.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,850,000.00	3,015,528.00	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	2,028,679.40	
	ACGB 1% 11/21/31	2,830,000.00	2,841,235.10	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,364,409.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	4,160,000.00	4,661,945.60	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,297,428.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,366,648.50	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,577,790.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	954,560.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,484,118.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,840,089.40	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,605,638.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,442,918.00	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,971,572.20	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,947,781.60	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,946,281.00	
ACGB 3.25% 06/21/39	830,000.00	1,060,864.50		
ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,187,259.20		

	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,105,913.60
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,483,919.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,684,963.40
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,120,000.00	5,242,205.60
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,200,000.00	4,752,426.00
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,668,618.50
	オーストラリアドル 小計	85,600,000.00	95,927,941.00 (7,344,243,162)
シンガポールドル	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	826,688.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	296,124.80
	SIGB 1.875% 03/01/50	80,000.00	98,347.20
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	805,379.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	855,859.30
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	533,335.60
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	522,854.20
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,196,002.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,709,327.60
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	801,082.50
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,139,924.50
	SIGB 2.875% 07/01/29	310,000.00	364,436.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	909,469.20
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	432,377.80
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,210,000.00	1,272,859.50
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,422,388.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,037,740.00
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,342,695.40
	シンガポールドル 小計	13,420,000.00	15,566,891.10 (1,215,929,863)
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,544,010.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	736,092.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,421,499.10
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,622,042.00
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,265,668.00
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,098,199.50
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,139,289.80
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	587,125.00
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,557,060.00
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,746,950.80
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,545,426.00
	MGS 3.882% 03/10/22	960,000.00	988,320.00
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,108,259.40
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	803,518.30

	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,233,304.60	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,160,439.90	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,572,393.60	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	653,850.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,220,000.00	2,417,091.60	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,046,433.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	804,422.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,379,660.80	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,266,320.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	902,121.30	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,713,548.40	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,738,332.80	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,317,835.40	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,694,333.60	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,671,749.60	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,610,000.00	1,919,345.40	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,227,943.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,820,910.00	
	マレーシアリングット 小計	48,820,000.00	53,703,495.40 (1,373,735,412)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 04/30/25	1,910,000.00	1,920,395.17	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,828,327.67	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,100,000.00	1,087,461.54	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,158,241.56	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,770,000.00	1,784,271.51	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,110,000.00	2,352,803.18	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,556,896.10	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,520,000.00	3,444,301.46	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,251,276.10	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,347,959.19	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,517,404.16	
	イスラエルシェケル 小計	31,630,000.00	37,249,337.64 (1,163,296,814)	
	合計		272,910,198,619 (272,910,198,619)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 200銘柄	100.0%	43.4%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
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 47銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 8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 8銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.7%
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git	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 11銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	1,308,756,768
コール・ローン	229,238,324
国債証券	59,928,600,984
派生商品評価勘定	229,500
未収入金	45,107,386
未収利息	880,175,773
前払費用	57,854,742
流動資産合計	62,449,963,477
資産合計	62,449,963,477
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	94,502
未払金	686,685,207
未払解約金	96,112,220
未払利息	325



	2020年11月10日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	782,892,254
負債合計	782,892,254
純資産の部	
元本等	
元本	36,424,298,034
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,242,773,189
元本等合計	61,667,071,223
純資産合計	61,667,071,223
負債純資産合計	62,449,963,477

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年11月10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> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	36,424,298,034口

		2020年11月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6930円 (16,930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11月10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11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。		

	2020年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2020年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	34,488,541,260円
期中追加設定元本額	3,257,514,689円
期中一部解約元本額	1,321,757,915円
期末元本額	36,424,298,034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	4,289,994,117円
世界経済インデックスファンド	6,455,802,300円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,706,190,913円
DC世界経済インデックスファンド	8,171,516,227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）	1,812,756,551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

区分	2020年11月10日現在
新興国債券インデックス・オープン( S M A 専用)	84,097,021円
分散投資コア戦略ファンドA	251,578,523円
分散投資コア戦略ファンドS	592,208,542円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	305,373,086円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,804,193,380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)	189,767,663円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	87,578,065円
S M T インデックスバランス・オープン	163,144,126円
外国債券S M T B セレクション( S M A 専用)	3,345,935,872円
S M T 世界経済インデックス・オープン	168,625,526円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	169,236,557円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	286,557,897円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	4,101,480円
グローバル経済コア	672,487,025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)	2,598,606円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	445,927円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	520,047円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	243,175円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	414,883円
F O F s 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)	89,126,174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)	181,716,909円
S M T A M 海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	307,965,962円
S M T A M 海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	316,039,597円
S M T A M 海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	303,324,436円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	882,660,420
合計	882,660,420

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 通貨関連

(2020年11月10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	141,751,031	-	141,616,033	134,998
	トルコリラ	39,019,500	-	38,790,000	229,500
	マレーシアリン ギット	102,731,531	-	102,826,033	94,502
合計		141,751,031	-	141,616,033	134,998

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	41,158,348.00	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	97,906,287.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	61,800,000.00	63,506,298.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	111,786,830.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	51,950,000.00	54,608,281.50	
		MBONO 7.25% 12/09/21	72,300,000.00	74,576,727.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	121,019,802.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	46,200,000.00	52,338,594.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	67,443,360.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	29,200,000.00	32,821,968.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	93,600,000.00	111,010,536.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	57,450,000.00	68,007,012.00	
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	82,280,260.00	
		MBONO 8% 11/07/47	63,700,000.00	71,173,284.00	
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	107,556,936.00	
			メキシコペソ 小計		1,039,450,000.00

ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	27,502,015.15	
	BLTN 0% 01/01/24	61,500,000.00	51,130,072.94	
	BLTN 0% 07/01/22	22,300,000.00	20,818,595.39	
	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	44,303,477.75	
	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000.00	41,530,528.86	
	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000.00	39,902,980.96	
	BNTNF 10% 01/01/27	26,850,000.00	30,827,745.87	
	BNTNF 10% 01/01/29	13,200,000.00	15,437,340.07	
	BNTNF 10% 01/01/31	3,200,000.00	3,765,052.67	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,677,375.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	500,906.25	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,092,375.00	
	ブラジルレアル 小計		283,550,000.00	279,488,465.91
チリペソ	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,662,270,891.80	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,949,617,568.47	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,480,000,000.00	1,751,515,325.48	
	BTPCL 4% 03/01/23	945,000,000.00	1,021,364,284.81	
	BTPCL 5% 03/01/35	1,930,000,000.00	2,309,381,950.87	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,565,000,000.00	2,155,758,344.05	
チリペソ 小計		10,145,000,000.00	11,849,908,365.48	(1,648,322,253)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	90,300,000,000.00	116,813,886,000.00	
コロンビアペソ 小計		90,300,000,000.00	116,813,886,000.00	(3,364,239,916)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,962,008.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,400,000.00	5,799,870.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,650,000.00	4,298,568.50	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,670,590.50	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,050,000.00	7,100,945.50	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,450,000.00	7,983,874.50	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	8,347,506.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,750,000.00	8,503,717.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,622,923.50	
ペルーヌエボソル 小計		52,000,000.00	62,290,004.00	(1,828,211,617)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	16,368,612.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	18,022,486.00	
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	34,391,098.00	(84,946,012)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,714,364.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	26,248,500.00	

ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	46,962,864.00 (84,533,155)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,595,013.50
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	7,755,503.50
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,950,000.00	9,113,503.50
	TURKGB 10.7% 08/17/22	8,150,000.00	7,661,000.00
	TURKGB 11% 02/24/27	9,150,000.00	8,363,557.50
	TURKGB 11% 03/02/22	6,550,000.00	6,264,682.00
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,547,164.00
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	4,558,812.00
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,249,000.00
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,346,384.00
	TURKGB 8.5% 09/14/22	3,750,000.00	3,420,900.00
	TURKGB 8% 03/12/25	7,100,000.00	5,748,799.00
	TURKGB 9.5% 01/12/22	5,800,000.00	5,479,202.00
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,344,692.50
トルコリラ 小計		97,100,000.00	89,448,213.50 (1,158,354,364)
チェココ ルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	47,032,512.00
	CZGB 0.45% 10/25/23	50,000,000.00	50,226,000.00
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,900,000.00	46,501,819.00
	CZGB 1.2% 03/13/31	30,900,000.00	31,257,513.00
	CZGB 1% 06/26/26	67,200,000.00	68,382,048.00
	CZGB 2.4% 09/17/25	39,500,000.00	42,921,095.00
	CZGB 2.5% 08/25/28	47,800,000.00	53,661,714.00
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	56,160,353.00
	CZGB 2% 10/13/33	49,200,000.00	54,234,636.00
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	38,932,142.00
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	44,959,512.00
チェココルナ 小計		502,400,000.00	534,269,344.00 (2,500,380,529)
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	325,660,500.00
	HGB 1.75% 10/26/22	462,000,000.00	470,246,700.00
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	467,039,000.00
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	575,361,640.00
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	503,547,920.00
	HGB 3.25% 10/22/31	452,000,000.00	501,453,320.00
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	428,328,425.00
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	602,702,250.00
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	643,344,160.00
	HGB 3% 10/27/38	186,000,000.00	204,797,160.00
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	785,089,800.00
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	607,671,090.00

	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	454,328,720.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	308,848,400.00	
ハンガリーフォリント 小計		6,268,500,000.00	6,878,419,085.00	(2,379,245,161)
ポーランドズロチ	POLGB 1.25% 10/25/30	4,350,000.00	4,353,828.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,390,120.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	10,850,000.00	11,729,501.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,981,565.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,850,000.00	21,496,359.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	19,400,000.00	21,483,754.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,950,000.00	16,635,463.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000.00	16,071,702.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000.00	17,158,354.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	15,027,620.00	
	POLGB 4% 10/25/23	14,050,000.00	15,688,370.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,011,058.50	
	ポーランドズロチ 小計		168,700,000.00	185,027,695.50
ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	82,500,000.00	80,642,925.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	171,401,790.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	171,257,780.00	
	RFLB 6% 10/06/27	213,500,000.00	220,210,305.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	146,000,000.00	159,296,220.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	176,620,830.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	229,100,352.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	177,418,305.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	219,178,734.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	174,698,914.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	198,700,000.00	208,879,401.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	226,500,000.00	257,795,505.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	146,500,000.00	171,286,335.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	180,034,680.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	202,898,245.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	205,424,140.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	74,893,856.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	113,522,656.00	
	RFLB 7% 12/15/21	132,500,000.00	136,198,075.00	
RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	179,025,600.00		
RFLB 8.5% 09/17/31	132,150,000.00	159,351,756.00		
ロシアルーブル 小計		3,355,650,000.00	3,669,136,404.00	(5,026,716,873)
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,415,534.00	



	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,747,319.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	9,450,000.00	10,151,190.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,555,692.50	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,069,317.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	9,103,087.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	7,500,000.00	8,239,950.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	24,350,000.00	26,802,288.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,805,045.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,790,117.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	9,153,900.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	9,400,000.00	10,234,532.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	13,800,000.00	14,863,566.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	10,185,777.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	5,850,000.00	6,855,147.00	
	マレーシアリングット 小計	158,200,000.00	170,972,462.50 (4,373,475,590)	
タイパーツ	THAIGB 1.45% 12/17/24	86,000,000.00	88,333,180.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	37,400,000.00	37,638,238.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	80,200,000.00	82,253,922.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	67,300,000.00	68,724,068.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	96,100,000.00	102,495,455.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	101,000,000.00	106,389,360.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	73,644,324.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	53,500,000.00	55,076,110.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	157,100,000.00	192,412,938.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	126,700,000.00	156,980,033.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,499,920.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	139,499,721.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	63,100,000.00	65,257,389.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	100,293,372.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	82,400,000.00	94,544,936.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	93,500,000.00	120,409,300.00	
	タイパーツ 小計	1,388,400,000.00	1,574,452,266.00 (5,447,604,840)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,326,400.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	38,873,100.00	
	フィリピンペソ 小計	45,000,000.00	54,199,500.00 (118,696,905)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,353,052,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,959,534,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	47,700,000,000.00	48,980,745,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	25,000,000,000.00	24,837,500,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	7,000,000,000.00	7,133,140,000.00	

	INDOGB 6.5% 06/15/25	44,100,000,000.00	46,323,963,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	23,660,640,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	13,000,000,000.00	13,534,560,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	19,966,815,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	20,200,000,000.00	21,633,998,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,133,846,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,534,168,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	38,770,272,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	57,208,140,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	39,168,900,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,839,069,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	36,785,600,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	30,400,000,000.00	33,697,488,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	51,435,216,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	59,043,920,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,633,548,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	44,100,000,000.00	49,806,099,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	18,700,000,000.00	21,711,448,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,739,394,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	33,700,000,000.00	39,371,710,000.00	
	インドネシアルピア 小計	731,000,000,000.00	796,262,765,000.00	(5,971,970,737)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	115,000,000.00	135,855,250.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	24,283,060.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,507,023.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	45,000,000.00	48,770,550.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	35,598,970.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	49,200,000.00	44,117,640.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	57,054,663.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	55,728,266.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	72,358,897.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	54,646,456.00	
	SAGB 8% 01/31/30	93,900,000.00	89,529,894.00	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	29,787,100.00	
	南アフリカランド 小計	736,600,000.00	670,237,769.00	(4,577,723,962)
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,102,000.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	24,500,000.00	24,121,230.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	28,900,000.00	27,616,551.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	24,500,000.00	23,909,305.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000.00	43,006,880.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	19,987,600.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,535,435.00	

	CGB 3.19% 04/11/24	14,000,000.00	14,116,200.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,126,960.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000.00	35,345,800.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	20,200,000.00	20,224,240.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,134,940.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,190,080.00	
	香港・オフショア人民元 小計	304,800,000.00	302,417,221.00 (4,808,433,813)	
	合計		59,928,600,984 (59,928,600,984)	

## 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%	10.0%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	9.1%
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 1銘柄	100.0%	5.6%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	3.1%
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 14銘柄	100.0%	1.9%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	4.2%
ハンガリーフォリント	国債証券 14銘柄	100.0%	4.0%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	8.5%
ロシアルーブル	国債証券 21銘柄	100.0%	8.4%
マレーシアリンギット	国債証券 15銘柄	100.0%	7.3%
タイバーツ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.1%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券 25銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	7.6%
香港・オフショア人民元	国債証券 13銘柄	100.0%	8.0%

(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。

## J-REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2020年11月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,623,239,422
投資証券	94,277,687,970
未収入金	270,717,896
未収配当金	1,171,592,742
前払金	12,474,160
差入委託証拠金	627,564,000
流動資産合計	97,983,276,190
資産合計	97,983,276,190
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,474,160
未払解約金	372,405,712
未払利息	2,305
流動負債合計	384,882,177
負債合計	384,882,177
純資産の部	
元本等	
元本	55,613,724,754
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	41,984,669,259
元本等合計	97,598,394,013
純資産合計	97,598,394,013
負債純資産合計	97,983,276,190

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年11月10日現在
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法

2020年11月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</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 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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	55,613,724,754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 1.7549円 (1万口当たり純資産額) (17,549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11月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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>

	2020年11月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	66,810,950,533円
期中追加設定元本額	4,017,398,279円
期中一部解約元本額	15,214,624,058円
期末元本額	55,613,724,754円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,636,726,739円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,312,618円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,396,534,493円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	26,740,638,748円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,915,131,391円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,736,524,900円
分散投資コア戦略ファンドA	527,813,690円
分散投資コア戦略ファンドS	1,039,209,557円
コア投資戦略ファンド（切替型）	997,686,526円
SMT インデックスバランス・オープン	29,961,470円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	409,944,935円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,971,619円
グローバル経済コア	264,618,020円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	8,571,010円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	468,709,116円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	42,599,327円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	772,093,017円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,644,645円
J-REITパッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	311,375円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	910,045,907円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	385,378,937円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	313,296,714円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

2020年11月10日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	17,779,078,159
合計	17,779,078,159

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 投資証券関連

(2020年11月10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	不動産投信指数先物 取引 買建	3,304,534,160	-	3,292,060,000	12,474,160
	合計	3,304,534,160	-	3,292,060,000	12,474,160

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,692	191,872,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,534	248,078,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,307	304,524,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,441	2,019,867,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	12,671	1,066,898,200	
	森ヒルズリート投資法人	12,164	1,605,648,000	
	産業ファンド投資法人	14,638	2,583,607,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,836	2,995,062,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,756	1,173,517,200	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	5,189	2,091,167,000	



G L P 投資法人	29,775	4,579,395,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,519	1,364,738,000	
日本プロロジスリート投資法人	15,669	5,178,604,500	
星野リゾート・リート投資法人	1,576	817,944,000	
O n e リート投資法人	1,614	399,949,200	
イオンリート投資法人	10,503	1,302,372,000	
ヒューリックリート投資法人	8,337	1,196,359,500	
日本リート投資法人	3,364	1,204,312,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	66,528	937,379,520	
積水ハウス・リート投資法人	30,458	2,287,395,800	
トーセイ・リート投資法人	2,291	247,886,200	
ケネディクス商業リート投資法人	3,808	817,577,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,209	279,217,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,993	204,880,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	33,487	4,567,626,800	
いちごホテルリート投資法人	1,811	136,006,100	
ラサールロジポート投資法人	11,540	1,863,710,000	
スターアジア不動産投資法人	10,640	502,208,000	
マリモ地方創生リート投資法人	970	109,028,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,614	1,783,509,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,671	122,818,500	
投資法人みらい	11,184	429,465,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,243	264,674,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,330	971,610,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	2,826	437,182,200	
ザイマックス・リート投資法人	1,587	145,686,600	
タカラレーベン不動産投資法人	3,112	270,744,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,270	444,066,000	
日本ビルファンド投資法人	11,654	6,701,050,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,355	5,705,605,000	
日本リテールファンド投資法人	19,455	3,295,677,000	
オリックス不動産投資法人	20,633	3,295,090,100	
日本プライムリアルティ投資法人	6,447	2,017,911,000	
プレミアム投資法人	9,353	1,134,518,900	
東急リアル・エステート投資法人	6,943	1,056,030,300	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,191	719,819,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人	22,146	2,803,683,600	
森トラスト総合リート投資法人	7,401	982,852,800	
インヴィンシブル投資法人	43,299	1,656,186,750	
フロンティア不動産投資法人	3,436	1,298,808,000	
平和不動産リート投資法人	6,354	756,761,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,766	1,964,846,400	

福岡リート投資法人	5,356	743,948,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,203	2,027,499,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,591	619,411,100	
大和証券オフィス投資法人	2,206	1,389,780,000	
阪急阪神リート投資法人	4,677	580,883,400	
スターツプロシード投資法人	1,613	322,922,600	
大和ハウスリート投資法人	14,775	3,612,487,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,359	1,924,814,300	
大和証券リビング投資法人	13,064	1,315,544,800	
ジャパンエクセレント投資法人	9,609	1,204,968,600	
合計	622,043	94,277,687,970	

(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11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	483,037,253
コール・ローン	73,950,606
投資証券	79,860,114,571
派生商品評価勘定	105
未収入金	2,309,998
未収配当金	167,944,060
流動資産合計	80,587,356,593
資産合計	80,587,356,593
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	178
未払金	303,178,740
未払株式払込金	4,810,523
未払解約金	66,212,376
未払利息	105
流動負債合計	374,201,922
負債合計	374,201,922
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	47,638,239,657

	2020年11月10日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,574,915,014
元本等合計	80,213,154,671
純資産合計	80,213,154,671
負債純資産合計	80,587,356,593

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年11月10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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,638,239,657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 1.6838円 (1万口当たり純資産額) (16,838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11月10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11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2020年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月12日
期首元本額	56,493,313,438円
期中追加設定元本額	4,906,339,590円
期中一部解約元本額	13,761,413,371円
期末元本額	47,638,239,657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）	1,664,464,366円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,501,529円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,341,799,220円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	23,397,867,868円

区分	2020年11月10日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,407,724,679円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,990,280,342円
分散投資コア戦略ファンドA	523,397,906円
分散投資コア戦略ファンドS	1,071,882,269円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,015,767,319円
SMT インデックスバランス・オープン	179,628,173円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	437,112,171円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,344,999円
グローバル経済コア	270,139,777円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	8,887,820円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	469,998,388円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	48,565,023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）	1,305,493,065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）	707,568,892円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	83,533,855円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	151,919,427円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	157,579,732円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	155,685,640円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	8,781,553,195
合計	8,781,553,195

(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11月10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	8,990,127	-	8,990,200	73
	アメリカドル	4,207,960	-	4,208,000	40
	ユーロ	2,485,262	-	2,485,400	138
	オーストラリアドル	2,296,905	-	2,296,800	105

合計	8,990,127	-	8,990,200	73
----	-----------	---	-----------	----

## (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	53,940	681,801.60	
		AGREE REALTY CORP	34,169	2,169,048.12	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	47,000	703,590.00	
		ALEXANDER'S INC	1,490	401,450.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,111	11,572,351.77	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,595	768,852.35	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	88,380	3,536,967.60	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	67,590	492,731.10	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	170,668	4,963,025.44	
		AMERICOLD REALTY TRUST	130,640	4,571,093.60	
		APARTMENT INVEST & MGMT	94,622	2,723,221.16	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	138,263	1,667,451.78	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,000	394,820.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	90,976	14,982,837.44	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	134,986.50	
		BOSTON PROPERTIES	91,098	8,086,769.46	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	105,620	1,024,514.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	188,767	2,686,154.41	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	35,200	542,080.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	65,350.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	62,413	6,153,921.80	
		CARETRUST REIT INC	65,477	1,238,170.07	
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	238,637.60			

CIM COMMERCIAL TRUST CORP	6,500	60,125.00	
CITY OFFICE REIT INC	37,050	270,465.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	45,041.00	
COLONY CAPITAL INC	325,506	1,220,647.50	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	73,383	904,078.56	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,300	652,652.00	
CORECIVIC INC	84,463	525,359.86	
COREPOINT LODGING INC	22,000	132,660.00	
CORESITE REALTY CORP	27,185	3,276,879.90	
CORPORATE OFFICE PPTYS	74,559	1,795,380.72	
COUSINS PROPERTIES INC	94,418	2,821,209.84	
CUBESMART	123,373	3,854,172.52	
CYRUSONE INC	75,076	5,201,265.28	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	125,540	864,970.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	173,526	23,984,763.72	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	142,800	561,204.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	108,820	3,078,517.80	
DUKE REALTY CORP	239,972	9,277,317.52	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	53,268	1,118,095.32	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	25,236	3,404,336.40	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	90,335	682,029.25	
EPR PROPERTIES	47,882	1,584,415.38	
EQUINIX INC	57,071	42,415,737.91	
EQUITY COMMONWEALTH	76,912	2,027,400.32	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,782	6,328,936.76	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	220,306	13,059,739.68	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	1,152,455.36	
ESSEX PROPERTY TRUST	42,232	10,745,932.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	83,586	8,937,015.12	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	132,240.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,928	4,024,244.08	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	80,762	3,290,243.88	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,250	1,204,042.50	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	368,014.18	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	30,230	403,570.50	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,903	5,294,855.52	
GEO GROUP INC/THE	76,306	640,970.40	
GETTY REALTY CORP	21,985	603,048.55	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	448,105.50	
GLADSTONE LAND CORP	11,500	159,735.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	370,278.50	



GLOBAL NET LEASE INC	58,892	915,770.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	87,029	2,679,622.91	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	138,931	3,701,121.84	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	348,571	10,146,901.81	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	162,591.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	65,752	2,209,924.72	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	451,304	6,155,786.56	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	96,900	2,188,971.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	65,538	852,649.38	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	43,270	861,938.40	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,638	1,978,328.28	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,899	617,501.61	
INVITATION HOMES INC	360,577	9,948,319.43	
IRON MOUNTAIN INC	184,472	4,916,178.80	
JBG SMITH PROPERTIES	71,542	2,009,614.78	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	329,000.00	
KILROY REALTY CORPORATION	67,166	3,734,429.60	
KIMCO REALTY CORP	277,299	3,762,947.43	
KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	777,394.80	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	174,408	1,738,847.76	
LIFE STORAGE INC	29,766	3,160,553.88	
LTC PROPERTIES INC	26,976	949,015.68	
MACERICH CO/THE	67,797	611,528.94	
MACK-CALI REALTY CORP	61,336	764,859.92	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	886,564	642,758.90	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	338,528	6,496,352.32	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	73,128	9,185,608.08	
MONMOUTH REIT -CL A	62,052	890,446.20	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	111,205	4,281,392.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,124	1,322,888.28	
NATL HEALTH INVESTORS INC	28,244	1,782,761.28	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	196,650.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	15,100	662,739.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	31,830	655,379.70	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	144,943	4,997,634.64	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,199	207,356.29	
PARAMOUNT GROUP INC	102,726	775,581.30	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	155,994	2,254,113.30	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	89,335	1,456,160.50	
PHYSICIANS REALTY TRUST	131,899	2,350,440.18	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	81,079	1,098,620.45	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	204,474.00	

PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	176,944.83	
PRIME US REIT	295,000	225,675.00	
PROLOGIS INC	476,036	47,417,945.96	
PS BUSINESS PARKS INC	12,689	1,647,285.98	
PUBLIC STORAGE	98,128	21,792,266.24	
QTS REALTY TRUST INC	38,937	2,379,440.07	
REALTY INCOME CORP	221,064	13,617,542.40	
REGENCY CENTERS CORP	100,891	4,636,950.36	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	79,115	1,010,298.55	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	145,774	1,033,537.66	
RETAIL VALUE	8,969	123,772.20	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	79,195	3,750,675.20	
RLJ LODGING TRUST	112,691	1,290,311.95	
RPT REALTY	58,950	373,743.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,566	2,007,345.04	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	136,456	2,183,296.00	
SAFEHOLD INC	9,940	637,054.60	
SAUL CENTERS INC	8,800	248,512.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	22,900	324,493.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	103,744	1,082,049.92	
SIMON PROPERTY GROUP	195,908	15,496,322.80	
SITE CENTERS CORP	94,320	855,482.40	
SL GREEN REALTY CORP	46,455	2,787,300.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	65,819	2,271,413.69	
STAG INDUSTRIAL INC	97,831	2,983,845.50	
STORE CAPITAL CORP	145,678	4,336,834.06	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	76,470	613,289.40	
SUN COMMUNITIES INC	63,122	8,553,031.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	147,497	1,454,320.42	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	69,270	579,097.20	
TAUBMAN CENTERS INC	40,750	1,467,815.00	
TERRENO REALTY CORP	43,364	2,488,659.96	
UDR INC	189,351	7,223,740.65	
UMH PROPERTIES INC	27,000	382,590.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	8,473	491,772.92	
URBAN EDGE PROPERTIES	76,680	930,128.40	
URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	250,875.00	
VENTAS INC	239,651	11,227,649.35	
VEREIT INC	688,743	4,952,062.17	
VICI PROPERTIES INC	342,155	8,150,132.10	
VORNADO REALTY TRUST	100,291	3,880,258.79	

	WASHINGTON PRIME GROUP INC	90,250	58,662.50	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	56,070	1,139,342.40	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	77,345	1,513,641.65	
	WELLTOWER INC	269,631	17,973,602.46	
	WHITESTONE REIT	38,340	273,364.20	
	WP CAREY INC	111,658	7,449,821.76	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	69,830	829,580.40	
	アメリカドル 小計	16,356,888	557,971,327.52 (58,704,163,368)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	36,942	1,414,139.76	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	422,521.20	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	124,680.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	429,111.20	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	52,420	2,479,990.20	
	CHOICE PROPERTIES REIT	108,670	1,409,449.90	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	473,882.40	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,577	448,259.52	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	400,698.50	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	42,950	538,163.50	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	386,562.80	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	74,815	1,107,262.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,620	1,419,216.40	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	92,539	1,088,258.64	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	43,490	579,286.80	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,850	625,582.50	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	273,461.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	189,998.60	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,170	691,641.30	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	87,500.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	95,631	1,572,173.64	
	SLATE GROCERY REIT	10,300	115,875.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	64,430.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	48,076	1,174,496.68	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	652,360.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	150,156.00	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	410,075.00	
	カナダドル 小計	1,089,400	18,729,232.54	

			(1,513,883,866)	
ユーロ	AEDIFICA	21,260	1,964,424.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	110,000	1,413,500.00	
	ALTAREA	2,730	348,894.00	
	BEFIMMO S.C.A.	16,110	579,154.50	
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	411,750.00	
	CARMILA	30,000	265,500.00	
	COFINIMMO	17,017	2,144,142.00	
	COVIVIO(FP)	30,792	1,870,614.00	
	CROMWELL EUROPEAN REIT	910,000	404,950.00	
	EUROCOMMERCIAL	19,690	232,342.00	
	GECINA SA	34,685	4,484,770.50	
	HAMBORNER REIT AG	45,000	395,190.00	
	HIBERNIA REIT PLC	482,550	586,780.80	
	ICADE	19,880	1,109,304.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	96,132.55	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	161,062	1,262,726.08	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	15,300	354,195.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	381,680.00	
	KLEPIERRE	130,130	1,951,950.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	54,000	196,020.00	
	MERCIALYS	26,000	132,080.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,418	1,497,896.53	
	MONTEA	6,900	687,240.00	
	NSI NV	12,300	370,845.00	
	RETAIL ESTATES	7,600	418,000.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	88,146	3,769,122.96	
VASTNED RETAIL	13,750	333,437.50		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	83,470	2,547,504.40		
WERELDHAVE NV	28,770	262,382.40		
XIOR STUDENT HOUSING NV	8,700	465,450.00		
	ユーロ 小計	2,896,050	30,937,978.22	(3,844,662,553)
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	87,320.00	
	ASSURA PLC	1,707,040	1,287,108.16	
	BIG YELLOW GROUP PLC	101,146	1,160,144.62	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	495,000	361,350.00	
	BRITISH LAND CO PLC	594,850	2,700,619.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	545,297	661,990.55	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	380,067	415,793.29	
	CUSTODIAN REIT PLC	292,276	259,541.08	
	DERWENT LONDON PLC	70,541	2,353,247.76	

	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	376,000	235,000.00
	GCP STUDENT LIVING PLC	300,000	387,000.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	169,580	1,153,483.16
	HAMMERSON PLC	2,536,320	595,527.93
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	219,355	235,806.62
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	477,505	3,072,267.17
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	567,660	1,351,030.80
	LXI REIT PLC	330,000	382,800.00
	NEWRIVER REIT PL	186,000	128,340.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	231,990.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	840,537	1,255,762.27
	RDI REIT PLC	154,400	149,150.40
	REGIONAL REIT LTD	292,000	206,736.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	135,537	1,097,172.01
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	121,100.00
	SEGRO PLC	761,570	6,892,208.50
	SHAFTESBURY PLC	160,293	859,971.94
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	159,061.16
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	431,000	453,627.50
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	273,286	310,179.61
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,092,658	1,807,256.33
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	552,000	422,832.00
	UNITE GROUP PLC	260,682	2,579,448.39
	WORKSPACE GROUP PLC	78,047	545,938.76
	イギリス債券 小計	15,961,363	33,930,075.01 (4,699,993,990)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	192,593	602,816.09
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	211,500.00
	ARENA REIT	241,053	672,537.87
	AVENTUS GROUP	230,000	575,000.00
	BWP TRUST	328,160	1,374,990.40
	CENTURIA CAPITAL GROUP	304,000	723,520.00
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	285,000	906,300.00
	CENTURIA OFFICE REIT	249,000	525,390.00
	CHARTER HALL GROUP	295,694	4,074,663.32
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,112	1,508,794.56
	CHARTER HALL RETAIL REIT	324,160	1,183,184.00
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	242,250	729,172.50
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,222,633	1,149,275.02
	DEXUS	696,940	6,293,368.20
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	353,705.00
	GOODMAN GROUP	1,069,018	21,348,289.46

	GPT GROUP	1,237,517	5,308,947.93	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	198,760	713,548.40	
	HOME CONSORTIUM	91,000	343,070.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	114,885	366,483.15	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	202,588	994,707.08	
	INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	340,000	408,000.00	
	MIRVAC GROUP	2,507,500	5,867,550.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	626,340	1,164,992.40	
	RURAL FUNDS GROUP	212,766	521,276.70	
	SCENTRE GROUP	3,310,393	7,978,047.13	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	689,060	1,626,181.60	
	STOCKLAND	1,530,344	6,718,210.16	
	VICINITY CENTERS	2,435,040	3,518,632.80	
	WAYPOINT REIT LTD	495,796	1,378,312.88	
	オーストラリアドル 小計	20,366,102	79,140,466.65 (6,058,994,126)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	562,278	826,548.66	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	680,300	1,673,538.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,098,490	1,362,127.60	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	650,000	1,144,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	239,460	708,801.60	
	ニュージーランドドル 小計	3,230,528	5,715,015.86 (410,395,288)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,303,000	5,329,270.00	
	FORTUNE REIT	982,000	6,441,920.00	
	LINK REIT	1,337,800	84,281,400.00	
	PROSPERITY REIT	952,000	2,161,040.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,952,280.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	968,000	3,552,560.00	
	香港ドル 小計	6,103,800	103,718,470.00 (1,407,459,637)	
シンガポールドドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	446,250.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	701,000	410,085.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,792,400	5,717,756.00	
	ASCOTT TRUST	1,116,877	971,682.99	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,929,844	5,566,703.60	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	467,729	584,661.25	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	450,576.00	
	EC WORLD REIT	180,000	126,900.00	
	ESR REIT	1,404,065	512,483.72	

	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	321,300.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	226,002.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	661,162	1,514,060.98	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	193,200.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,662,696	2,228,012.64	
	IREIT GLOBAL	334,420	202,324.10	
	KEPPEL DC REIT	794,803	2,344,668.85	
	KEPPEL REIT	1,146,400	1,169,328.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	355,200.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	80,136.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,450,173	2,813,335.62	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,052,060	3,366,592.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,659,800	3,435,786.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,372,100	1,221,169.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,523,644	510,420.74	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	258,000	1,068,120.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	478,540	169,881.70	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	229,245.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	324,072.52	
	SPH REIT	726,800	563,270.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	488,136.00	
	SUNTEC REIT	1,382,700	1,963,434.00	
	シンガポールドル 小計	29,029,229	39,574,793.71	(3,091,187,136)
韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	69,030	372,071,700.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	175,236,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	137,278,670.00	
	韓国ウォン 小計	131,073	684,586,370.00	(64,488,036)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	131,500	2,077,700.00	
	イスラエルシェケル 小計	131,500	2,077,700.00	(64,886,571)
	合計	95,295,933	79,860,114,571	(79,860,114,571)

(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。

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 155銘柄	100.0%	73.5%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	4.8%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.9%
オーストラリアドル	投資証券 30銘柄	100.0%	7.6%
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 31銘柄	100.0%	3.9%
韓国ウォン	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。



## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2020年11月30日現在)

資産総額	61,023,296円
負債総額	130,286円
純資産総額( - )	60,893,010円
発行済口数	54,432,779口
1口当たり純資産額( / )	1.1187円
(1万口当たり純資産額)	(11,187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11月30日現在)

資産総額	371,185,366,113円
負債総額	3,636,283,203円
純資産総額( - )	367,549,082,910円
発行済口数	219,562,648,561口
1口当たり純資産額( / )	1.6740円
(1万口当たり純資産額)	(16,740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11月30日現在)

資産総額	461,286,383,640円
負債総額	2,362,535,379円
純資産総額( - )	458,923,848,261円
発行済口数	150,285,392,963口
1口当たり純資産額( / )	3.0537円
(1万口当たり純資産額)	(30,537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11月30日現在)

資産総額	84,476,492,114円
負債総額	1,091,670,882円
純資産総額（ - ）	83,384,821,232円
発行済口数	25,849,669,601口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2258円
（1万口当たり純資産額）	（32,258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11月30日現在)

資産総額	618,650,464,047円
負債総額	16,591,283,477円
純資産総額（ - ）	602,059,180,570円
発行済口数	426,953,435,473口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4101円
（1万口当たり純資産額）	（14,101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11月30日現在)

資産総額	279,526,320,941円
負債総額	189,673,143円
純資産総額（ - ）	279,336,647,798円
発行済口数	93,978,809,229口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9723円
（1万口当たり純資産額）	（29,723円）

## 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11月30日現在）

資産総額	61,750,693,106円
負債総額	26,898,913円
純資産総額（ - ）	61,723,794,193円
発行済口数	36,524,097,861口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6899円
（1万口当たり純資産額）	（16,899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11月30日現在）

資産総額	96,534,671,399円
負債総額	469,108,658円
純資産総額（ - ）	96,065,562,741円
発行済口数	55,376,063,867口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7348円
（1万口当たり純資産額）	（17,348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11月30日現在）

資産総額	80,626,218,068円
負債総額	92,956,947円
純資産総額（ - ）	80,533,261,121円
発行済口数	46,676,080,105口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7254円
（1万口当たり純資産額）	（17,254円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

#### 受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとしします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとしします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとしします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2020年11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。

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2021年 2月10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11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	525	13,162,532
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	82	300,502
単位型公社債投資信託	40	274,217
合計	647	13,737,251

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（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。

また、第35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729



## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

（単位：百万円）

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

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	株主資本				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. その他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位: 百万円)

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

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2019年3月31日)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	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(株)	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(株)	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

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745

## 固定資産

有形固定資産	1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473



賞与引当金		289
その他	2	612
流動負債合計		8,740
固定負債		
退職給付引当金		614
資産除去債務		132
その他		6
固定負債合計		752
負債合計		9,493

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		35,114
利益剰余金合計		37,714
株主資本合計		56,953
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		251
繰延ヘッジ損益		299
評価・換算差額等合計		551
純資産合計		57,504
負債・純資産合計		66,997

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	2	1,933

営業外費用	3	1,484
経常利益		5,714
特別損失		110
税引前中間純利益		5,603
法人税、住民税及び事業税		1,692
法人税等調整額		62
法人税等合計		1,754
中間純利益		3,848

## 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				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	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	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	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	838	15	854	854
当中間期変動額合計	838	15	854	1,040
当中間期末残高	251	299	551	57,504

## 重要な会計方針

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
子会社株式	移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券	
時価のあるもの	中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)
時価のないもの	移動平均法による原価法によっております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
4. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定額法によっております。
(2) 無形固定資産	定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. 引当金の計上基準	
(1) 賞与引当金	従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。
(2) 退職給付引当金	従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。
7. ヘッジ会計の会計処理	
(1) ヘッジ会計の方法	繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象	

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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

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

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間末 (2020年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 431百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 64百万円
	無形固定資産 255百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 1,775百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,335百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

2020年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金及び預金	22,768	22,768	-
(2)金銭の信託	8,094	8,094	-
(3)未収委託者報酬	7,732	7,732	-
(4)未収運用受託報酬	5,430	5,430	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	9,175	9,175	-
(6)未払金	(7,364)	(7,364)	-
(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	(80)	(80)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(9)	(9)	-
デリバティブ取引計	(89)	(89)	-

(\*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)投資有価証券

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

## (6)未払金

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

## (7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式5,636百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

## (有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

## 1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	8,605	8,201	403
小計	8,605	8,201	403
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	570	610	40
小計	570	610	40
合計	9,175	8,812	362

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

## (デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建			
	米ドル	1,861	-	2
	英ポンド	105	-	0
	カナダドル	19	-	0
	スイスフラン	50	-	0
	香港ドル	178	-	0
	ユーロ	306	-	3
合計	2,521	-	1	1

(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	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,535	-	4
	英ポンド		2,791	-	5
	カナダドル		8	-	0
	スイスフラン		55	-	0
	香港ドル		98	-	0
	ユーロ		84	-	0
合計			6,574	-	9

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

(関連情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1)営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2)有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,593百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	2,993百万円

(\*1)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載して  
おります。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1株当たり純資産額	19,168,213円23銭
1株当たり中間純利益	1,282,957円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
中間純利益	3,848百万円
普通株式に係る中間純利益	3,848百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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



## (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

## (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

## (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

## (1)定款の変更

委託会社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

2021年 2月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2020年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三重銀行	15,295	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社第三銀行	37,461	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 8月11日	有価証券届出書
2020年 8月11日	有価証券報告書

**独立監査人の監査報告書**

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 8資産インデックスバランス・オープンの2020年5月12日から2020年11月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2020年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2020年12月1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

**中間監査意見**

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間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中間財務諸表の作成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。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、継続企業的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。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。