

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月9日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	コア投資戦略ファンド（切替型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

コア投資戦略ファンド（切替型）

愛称として、「コアラップ（切替型）」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

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

（６）【申込単位】

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

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

れるコース)で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7)【申込期間】

2021年4月10日から2021年10月12日までとします。

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

(8)【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9)【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、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8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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。

< スイッチング >

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

< 受付不可日 > に該当する場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

いう。

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

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

<ファンドの特色>

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
 - 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド^{*1}等に投資し、オルタナティブ運用^{*2}を行います。
- ※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
- ※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、パンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた機動的な調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びパンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

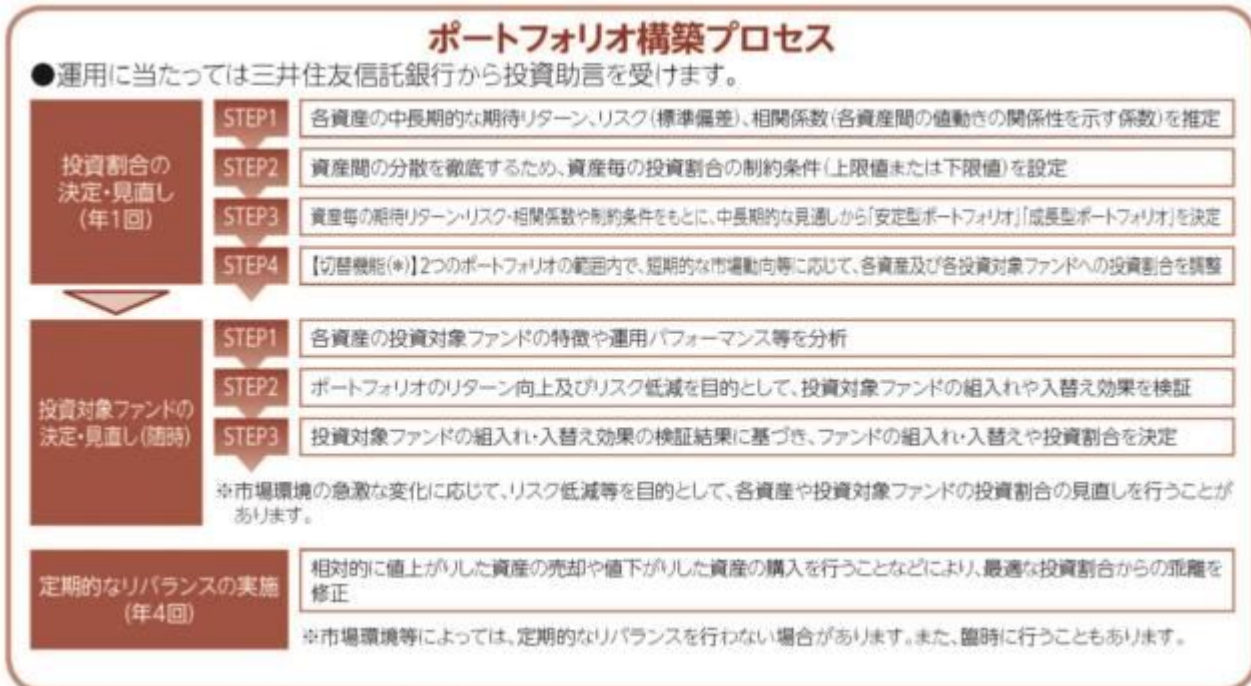
ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。

従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、75%未満とします。

当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3 投資リスク (1)ファンドのリスク ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

<(*)「コアラップ(切替型)」の切替機能のイメージ>

短期的な市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合を機動的に調整します。

安定型ポートフォリオ

債券や下値抵抗力が期待できるヘッジファンドの組入比率が高く、安定性を重視したポートフォリオ

市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で投資割合を調整

成長型ポートフォリオ

債券や高い収益が期待できる株式・新興国の資産などをバランスよく組み入れ、安定性と収益性のバランスを重視したポートフォリオ

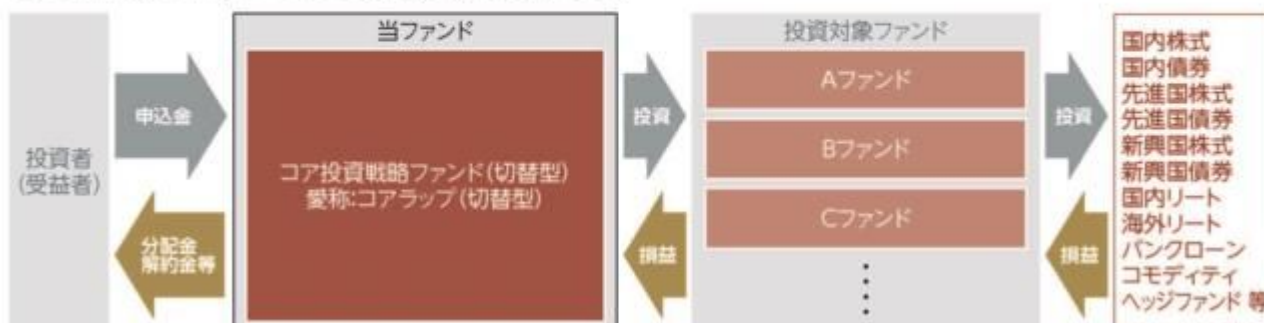
コアラップ(切替型)

市場環境の変化を捉えた機動的な運用を行います。

※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針（2）投資対象（参考）投資対象ファンドの概要」をご参照ください。



ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

〈ご参考情報〉

バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資（ローン）を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

ヘッジファンド

ヘッジとは元々「回避する」という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引（先物取引、オプション取引等）等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益（絶対収益）を追求するファンド*などがあります。

※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

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

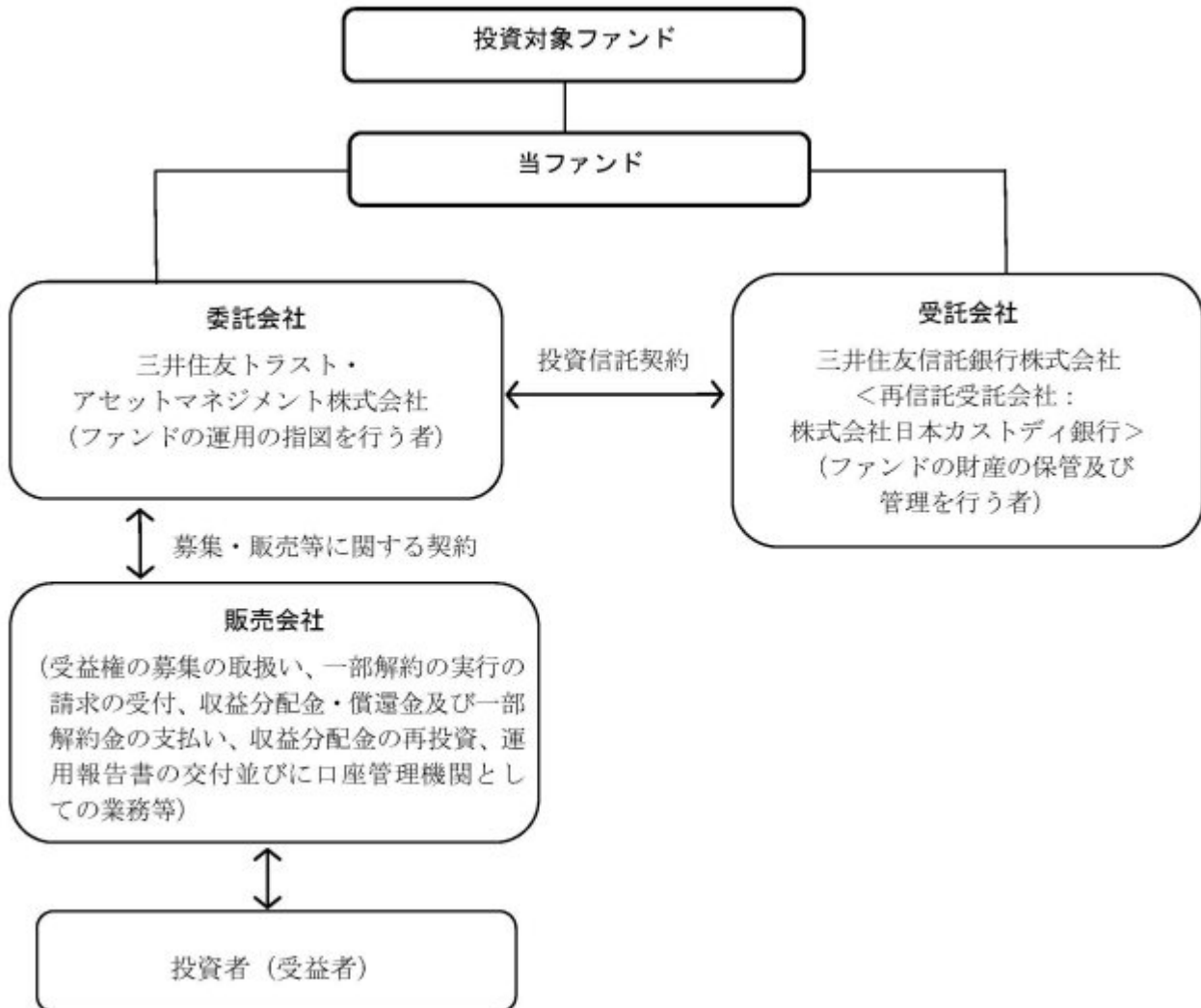
（2）【ファンドの沿革】

2013年10月17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（2021年 1月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ^{*1}、ヘッジファンド^{*2}及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

*1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

*2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて機動的に調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、75%未満とします。

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ニ．投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ヘ．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

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

（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．金銭債権
- 3．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、別に定める投資信託証券に投資するほか、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. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 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。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 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。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、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。

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

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。

当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

（参考）投資対象ファンドの概要

- ・ 全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・ 投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2021年1月29日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

1. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式
投資態度	<p>原則として東京証券取引所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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券およ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。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券およ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。</p> <p>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。</p> <p>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およ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、委託者は、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。</p> <p>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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引およ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。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。

同指数の指数値及び同指数の商標は、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・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指

数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

2. 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 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およびデリバティブ取引等エクスポージャーの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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）

決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。

3.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

<p>主な投資制限</p>	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。

4. 日本債券ツイン戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	<p>わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合（ ）を上回る投資成果を目指します。</p> <p>ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：2月21日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。

5.FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界のインフレ連動国債等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ・パークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>ブルームバーグ・パークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>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。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年3月31日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として2017年3月31日から2027年1月18日</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

「ブルームバーグ・パークレイズ世界インフレ連動国債インデックス」とは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスをあらわします。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標及びサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標及びサービスマークです。ブルームバーグ

またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

6. マニユライフF0Fs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニユライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 NOMURA-BPI総合（ ）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	債券への実質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。 有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 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およびデリバティブ等エクスポージャーの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、一般社団法人投資信託協会の規則に従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、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。 同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>								
信託報酬	<p>毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。</p> <table border="0"> <tr> <td>新発10年固定利付国債の利回り</td> <td>信託報酬</td> </tr> <tr> <td>0.5%未満の場合</td> <td>純資産総額に対し、年率0.264% (税抜 0.24%)</td> </tr> <tr> <td>0.5%以上1%未満の場合</td> <td>純資産総額に対し、年率0.297% (税抜 0.27%)</td> </tr> <tr> <td>1%以上の場合</td> <td>純資産総額に対し、年率0.33% (税抜 0.3%)</td> </tr> </table>	新発10年固定利付国債の利回り	信託報酬	0.5%未満の場合	純資産総額に対し、年率0.264% (税抜 0.24%)	0.5%以上1%未満の場合	純資産総額に対し、年率0.297% (税抜 0.27%)	1%以上の場合	純資産総額に対し、年率0.33% (税抜 0.3%)
新発10年固定利付国債の利回り	信託報酬								
0.5%未満の場合	純資産総額に対し、年率0.264% (税抜 0.24%)								
0.5%以上1%未満の場合	純資産総額に対し、年率0.297% (税抜 0.27%)								
1%以上の場合	純資産総額に対し、年率0.33% (税抜 0.3%)								
信託財産留保額	該当事項はありません。								
設定日	2019年10月10日								
信託期間	原則として無期限								
受託会社	三井住友信託銀行株式会社								

「NOMURA-BPI総合」とは、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

7. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	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

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
------	--

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。

8. グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。

主要投資対象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
主な投資制限	株式の実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 新株引受権証券並びに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20%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の新株引受権証券並びに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5%以下とします。 同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従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について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、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ないものとし、
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。 収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとし、
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

9. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。

10. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	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。）

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

11. Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

運用会社	Wellington Management Company LLP
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	<p>金融商品取引所等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。</p> <p>* この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。</p>
投資態度	<p>MSCIエマージング・マーケット・インデックス（ ）の騰落率を上回る投資成果を追求します。</p> <p>ポートフォリオは、カントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>運用会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	年率0.8%以内 なお、この報酬率には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、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年5月30日
信託期間	原則として無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社（マネージメントカンパニー） Wellington Luxembourg S.a r.l. ・ 運用会社（インベストメントマネージャー） Wellington Management Company LLP ・ 預託機関（デポジタリー） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch ・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch ・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch

「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。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。

12.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	新興国の債券

投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	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）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

13.FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を含む世界各国の債券に直接投資することもあります。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国の債券に投資します。 ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への実質投資割合を決定します。 債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>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。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2014年10月8日
信託期間	原則として、2014年10月8日から2024年9月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

14. 大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
------	----------------------

運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に世界のソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。</p> <p>世界のソブリン債券を中心とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れます。</p> <p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算）（ ）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。</p> <p>マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>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およびデリバティブ等エクスポージャーの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、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算）
決算日	年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.759%以内（税抜 0.69%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年5月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算）とは、米ドルベースのFTSE世界国債インデック

ス（除く日本）を委託者が円換算したものです。

15. LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	当ファンドは、主に「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要投資対象	<p>「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。</p> <p><マザーファンドの投資対象></p> <p>主に日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。</p>
投資態度	<p>LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（ ）をベンチマークとします。</p> <p>LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>主に、日本を除く世界の公社債に投資します。</p> <p>ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）をベンチマークとします。</p> <p>原則として、取得時において1社以上の格付機関から投資適格（BBB- / Baa3）以上の長期格付けが付与された、あるいはこれに相当する信用力をもつと運用者が判断する公社債を主要な投資対象としますが、取得時において信託財産の20%を上限としてこれを下回る信用力の公社債に投資することがあります。</p> <p>外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、通貨見通しに基づいて相対的に魅力があると判断される通貨に、為替予約取引等を通じて資産配分することがあります。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用の指図に関する権限を下記投資顧問会社に委託します。</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（在米国）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ（在ブラジル）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド（在シンガポール）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド（在オーストラリア）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント株式会社</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>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、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日。第1期決算日は2019年10月9日）
収益の分配	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>* 分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33%（税抜 0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）」は、ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックスをフランクリン・テンプレートン・ジャパン株式会社が独自に円換算したものです。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

16. J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。

主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	<p>わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうち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を行うことを指図することができます。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）

決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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」）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。

同指数の指数値及び同指数の商標は、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・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

17. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並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。
主要投資対象	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並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
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。

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、委託者は、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。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」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S&P Dow Jones Indices LLC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^(R) およびS&P^(R) 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^(R) 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（総称して「S&P Dow Jones Indices」）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ありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追隨するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にあ

る唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

18. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券

投資態度	<p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、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並びに委託者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（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、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。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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みます。）への投資割合は、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。</p> <p>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割合は、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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>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およ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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「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。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）および「ブルームバーグ（Bloomberg^(R)）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

19. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2021年1月29日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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行い、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。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>L B M A 金価格（円ヘッジベース）（ ）（2021年1月29日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年10月11日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

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

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、L B M A 金価格及びL B M A 金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

20. BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

<p>管理会社</p>	<p>BlueBay Funds Management Company S.A.</p>
<p>運用の基本方針</p>	<p>主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。</p>

主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 組入外貨建資産について対円で為替ヘッジを行うことがあります。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP ・副投資顧問会社 BlueBay Asset Management USA LLC ・管理事務代行会社 / 名義書換事務受託会社 / 保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

21.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>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。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

22. 米国株式LSマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。</p> <p>米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。</p> <p>米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

23. コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主としてブルームバーグ商品指数（ ）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」 1とといいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券 2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。</p> <p>2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値とします。</p>

投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）および「ブルームバーグ（Bloomberg^(R)）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的で

の利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

24. 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略¹に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1) この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き²を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。</p> <p>2) 当該戦略の参照対象は、S&P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含まれます。</p>
投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

25. ノムラF0Fs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。

投資態度

各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<日本成長株投資マザーファンドの投資態度>

わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。

ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度>

株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。

ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>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、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。</p> <p>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およびデリバティブ等エクスポージャーの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、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜 0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

26. MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS O'Connor LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。

投資態度	<p>公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。</p> <p>ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。</p> <p>為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p>
主な投資制限	<p>投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>投資信託証券への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	<p>運用報酬：年率0.6%</p> <p>成功報酬：15%</p> <p>月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・運用会社 UBS O'Connor LLC ・保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．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。

ト．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。

チ．外国為替予約取引の指図

委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

リ．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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(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。

ヌ．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。

<その他の投資制限>

イ．当ファンドでは直接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かかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、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、投資者の皆様は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。

金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、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。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等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。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格変動リスク

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

商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッ

ジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、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、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受け、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るリスクがより高いものになると想定されます。

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。

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。

資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額に影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があります。ファンドが大きな影響を被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>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象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。

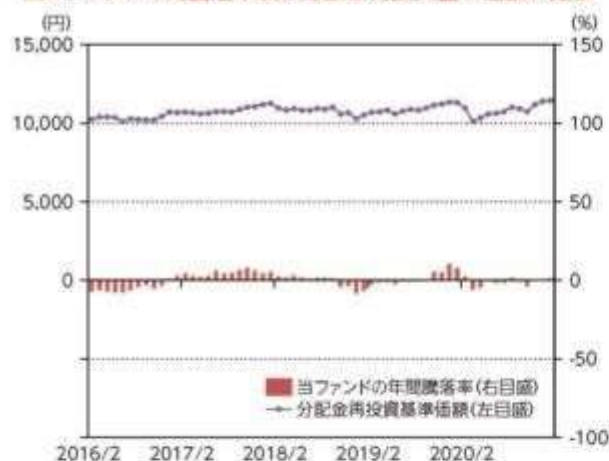
(2) リスクの管理体制

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



*2016年2月～2021年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。(配当込み)指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI(運用)	NOMURA-BPI(運用)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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのサポンサーではなく、本ファンドの権限、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、取崩または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMロンドン・ロンドン・インデックス・エマージング マーケットグローバル・デベロップメント(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌々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>

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンド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1.518%（税抜1.38%）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 0.968% (税抜 0.88%)	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 0.495% (税抜 0.45%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517% (税抜 0.47%)
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
日本債券ツイン戦略マザーファンド	ありません。
F0Fs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.066% (税抜 0.06%)
マニユライフF0Fs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り 信託報酬 0.5%未満の場合・・・年率 0.264% (税抜 0.24%) 0.5%以上1%未満の場合・・・年率 0.297% (税抜 0.27%) 1%以上の場合・・・年率 0.33% (税抜 0.3%)
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.814% (税抜 0.74%)
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	年率 0.8%以内
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
F0Fs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.066% (税抜 0.06%)
大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	年率 0.759%以内 (税抜 0.69%以内)
LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.33% (税抜 0.3%)
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%
FOfs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）
米国株式LSマザーファンド	ありません。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。
ノムラFOfs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.506% （税抜 0.46%）
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率 0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

実質的な信託報酬率：年率1.518%～2.00946%程度（税抜 1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））

（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（投資対象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（ ）、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（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（ ）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

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。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとし、

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。

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・ FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・ 米国株式LSマザーファンド

主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
- ・ マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
- ・ 米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

八．損益通算について

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

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込
手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たりま
す。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行
うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異な
る場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

二．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、2021年1月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更
される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年1月29日現在の状況について記載してあります。

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	7,722,858,425	26.83
	ルクセンブルク	459,611,600	1.60
	小計	8,182,470,025	28.42
投資証券	ルクセンブルク	492,264,111	1.71
	ケイマン	206,076,972	0.72
	小計	698,341,083	2.43
親投資信託受益証券	日本	19,670,053,115	68.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		238,062,974	0.83
合計(純資産総額)		28,788,927,197	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,256,451,103	2.7321	3,432,750,059	3.2066	4,028,936,106	13.99
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	2,229,709,142	1.4648	3,266,077,952	1.7277	3,852,268,484	13.38
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	824,670,942	2.9599	2,440,990,652	2.9924	2,467,745,326	8.57
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	973,312,135	1.6801	1,635,261,719	1.9107	1,859,707,496	6.46
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	990,409,491	1.5742	1,559,102,621	1.7850	1,767,880,941	6.14
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	1,326,235,613	1.2833	1,701,958,163	1.2975	1,720,790,707	5.98
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリュウファンド（適格機関投資家専用）	1,571,054,596	0.8892	1,397,061,870	1.0554	1,658,091,020	5.76
日本	投資信託受益証券	ノムラF O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,317,293,773	1.0775	1,419,384,040	1.0608	1,397,385,234	4.85

日本	投資信託受益証券	F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	999,067,597	1.052	1,051,019,112	1.1113	1,110,263,820	3.86
日本	親投資信託受益証券	米国株式LSマザーファンド	1,173,686,209	1.0100	1,185,524,733	0.9165	1,075,683,410	3.74
日本	親投資信託受益証券	日本債券ツイン戦略マザーファンド	1,028,369,374	0.9846	1,012,532,486	0.9891	1,017,160,147	3.53
日本	投資信託受益証券	F O F s用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	896,905,303	1.0993	986,050,514	1.0912	978,703,066	3.40
日本	投資信託受益証券	マニユライフ F O F s用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	974,145,475	0.9792	953,883,249	0.9878	962,260,900	3.34
日本	親投資信託受益証券	コモディティLSアルファ・マザーファンド	756,907,863	1.1215	848,872,169	1.1121	841,757,234	2.92
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	2,038,753,933	0.2632	536,600,035	0.3081	628,140,086	2.18
日本	投資信託受益証券	LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	449,700,818	1.1122	500,174,788	1.1542	519,044,684	1.80
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	45,801,128	10,113.57	463,212,914	10,747.86	492,264,111	1.71
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	379,222,331	1.2079	458,076,395	1.2317	467,088,145	1.62
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	37,778,366	9,699.14	366,417,660	12,166	459,611,600	1.60
日本	投資信託受益証券	大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	340,658,133	0.9858	335,844,292	0.9882	336,638,367	1.17
日本	投資信託受益証券	F O F s用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	262,911,721	1.097	288,414,157	1.1159	293,383,189	1.02
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	280,000,000	1.0000	280,000,000	0.9315	260,820,000	0.91
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	20,000	9,919.69	198,393,822	10,303.84	206,076,972	0.72
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	86,647,214	1.6506	143,019,891	1.7215	149,163,178	0.52

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	28.42
投資証券	2.43
親投資信託受益証券	68.33
合計	99.17

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（ 3 ） 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2014年 7月10日)	8,047,177,409	8,047,177,409	10,389	10,389
第2期計算期間末 (2015年 7月10日)	27,366,014,831	27,366,014,831	10,787	10,787
第3期計算期間末 (2016年 7月11日)	30,311,407,780	30,311,407,780	10,121	10,121
第4期計算期間末 (2017年 7月10日)	27,946,158,080	27,946,158,080	10,720	10,720
第5期計算期間末 (2018年 7月10日)	31,588,404,244	31,588,404,244	10,895	10,895
第6期計算期間末 (2019年 7月10日)	31,612,123,675	31,612,123,675	10,862	10,862
第7期計算期間末 (2020年 7月10日)	28,489,916,074	28,489,916,074	10,680	10,680
2020年 1月末日	29,701,061,054		11,318	
2月末日	28,756,681,176		10,960	
3月末日	26,595,479,976		10,109	
4月末日	27,316,842,680		10,347	
5月末日	28,094,420,810		10,588	
6月末日	28,331,694,175		10,635	
7月末日	28,714,901,483		10,738	
8月末日	29,373,664,071		11,016	
9月末日	29,115,173,187		10,922	
10月末日	28,362,114,587		10,732	
11月末日	29,187,269,136		11,188	
12月末日	29,193,409,525		11,401	
2021年 1月末日	28,788,927,197		11,455	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2013年10月17日～2014年 7月10日	0
第2期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第3期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第4期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第5期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第6期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第7期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2013年10月17日～2014年 7月10日	3.9
第2期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.8
第3期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.2
第4期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	5.9
第5期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.6
第6期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.3
第7期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.7
第8期中間計算期間	2020年 7月11日～2021年 1月10日	7.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2013年10月17日～2014年 7月10日	7,756,133,400	10,141,270	7,745,992,130
第2期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	17,904,927,940	280,776,696	25,370,143,374
第3期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	5,892,656,977	1,314,548,833	29,948,251,518
第4期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	1,610,441,134	5,489,774,092	26,068,918,560
第5期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	10,500,659,721	7,576,138,726	28,993,439,555
第6期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	7,219,577,787	7,109,737,294	29,103,280,048
第7期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	4,135,234,340	6,562,751,288	26,675,763,100
第8期中間計算期間	2020年 7月11日～2021年 1月10日	975,907,239	2,118,172,930	25,533,497,409

(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	361,075,182,680	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,514,107,263	0.96
合計(純資産総額)		364,589,289,943	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	2,886,400,000	0.79

(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	1,478,000	6,793.64	10,040,999,920	7,300.00	10,789,400,000	2.96
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,136,000	5,057.34	5,745,138,240	8,108.00	9,210,688,000	2.53
日本	株式	ソニー	電気機器	914,000	7,090.51	6,480,726,140	10,050.00	9,185,700,000	2.52
日本	株式	キーエンス	電気機器	143,200	45,651.47	6,537,290,504	56,140.00	8,039,248,000	2.21
日本	株式	任天堂	その他製品	83,500	45,116.59	3,767,235,265	60,580.00	5,058,430,000	1.39
日本	株式	日本電産	電気機器	351,200	7,033.84	2,470,284,608	13,850.00	4,864,120,000	1.33
日本	株式	信越化学工業	化学	264,200	13,251.70	3,501,099,140	18,175.00	4,801,835,000	1.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,843,500	444.93	4,379,668,455	469.30	4,619,554,550	1.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	998,700	3,769.93	3,765,029,091	4,542.00	4,536,095,400	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,213,900	4,144.90	5,031,494,110	3,698.00	4,489,002,200	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,674,600	2,439.18	4,084,650,828	2,618.00	4,384,102,800	1.20
日本	株式	村田製作所	電気機器	428,700	6,174.13	2,646,849,531	10,055.00	4,310,578,500	1.18
日本	株式	第一三共	医薬品	1,252,500	3,334.50	4,176,461,250	3,365.00	4,214,662,500	1.16
日本	株式	ダイキン工業	機械	185,900	16,403.68	3,049,444,112	22,105.00	4,109,319,500	1.13
日本	株式	HOYA	精密機器	289,400	10,260.84	2,969,487,096	13,395.00	3,876,513,000	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,148,200	3,126.85	3,590,249,170	3,079.00	3,535,307,800	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	128,100	19,393.15	2,484,262,515	27,365.00	3,505,456,500	0.96
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	85,500	22,290.23	1,905,814,665	39,810.00	3,403,755,000	0.93
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	995,800	3,126.57	3,113,438,406	3,245.00	3,231,371,000	0.89
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,148,700	2,782.52	3,196,280,724	2,764.50	3,175,581,150	0.87
日本	株式	日立製作所	電気機器	701,500	3,492.86	2,450,241,290	4,306.00	3,020,659,000	0.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,005,100	2,363.26	2,375,312,626	2,997.50	3,012,787,250	0.83
日本	株式	S M C	機械	42,700	54,897.13	2,344,107,451	63,360.00	2,705,472,000	0.74
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,955,300	1,353.03	2,645,579,559	1,378.50	2,695,381,050	0.74
日本	株式	花王	化学	349,300	8,579.60	2,996,854,280	7,597.00	2,653,632,100	0.73
日本	株式	中外製薬	医薬品	456,300	5,248.81	2,395,032,003	5,472.00	2,496,873,600	0.68

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	477,000	4,704.73	2,244,156,210	5,133.00	2,448,441,000	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	148,300	15,532.18	2,303,422,294	16,350.00	2,424,705,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,459,000	1,426.58	2,081,380,220	1,594.50	2,326,375,500	0.64
日本	株式	三菱商事	卸売業	874,900	2,516.44	2,201,633,356	2,647.50	2,316,297,750	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.15
		建設業	2.27
		食料品	3.54
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.58
		医薬品	5.96
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.60
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.59
		機械	5.72
		電気機器	17.96
		輸送用機器	6.72
		精密機器	2.67
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.34
		陸運業	3.41
		海運業	0.17
		空運業	0.40
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.17
		卸売業	4.50
小売業	4.71		
銀行業	4.54		
証券、商品先物取引業	0.75		
保険業	1.84		
その他金融業	1.10		

	不動産業	1.88
	サービス業	5.53
	小計	99.04
合計		99.04

(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	160	円	2,923,377,100	2,886,400,000	0.79

(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。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

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	14,454,281,700	33.11
	フィリピン	298,314,000	0.68
	小計	14,752,595,700	33.80
社債券	日本	26,963,482,000	61.77
	フランス	702,286,000	1.61
	スペイン	200,476,000	0.46
小計	27,866,244,000	63.84	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,031,390,441	2.36
合計(純資産総額)		43,650,230,141	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	売建	日本	7,591,000,000	17.39

(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。

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券オプション	買建	日本	21,991,000	0.05
	売建	日本	48,610,000	0.11

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	1,240,000,000	120.85	1,498,540,000	117.95	1,462,604,800	1.600	2033/12/20	3.35
日本	社債券	第5回三菱商事利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,100,000,000	100.33	1,103,647,000	100.20	1,102,277,000	0.690	2076/9/13	2.53
日本	社債券	第1回アサヒグループHD利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	100.77	1,007,770,000	0.970	2080/10/15	2.31
日本	社債券	第1回MS&ADインシュアランス利払繰延・期限前償還(劣後特)	1,000,000,000	100.65	1,006,504,000	100.54	1,005,450,000	1.030	2076/12/25	2.30
日本	国債証券	第155回利付国債(20年)	780,000,000	113.74	887,172,000	110.52	862,079,400	1.000	2035/12/20	1.97
日本	国債証券	第169回利付国債(20年)	800,000,000	101.67	813,360,000	97.86	782,944,000	0.300	2039/6/20	1.79
日本	社債券	第4回楽天利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	700,000,000	100.00	700,000,000	102.20	715,421,000	1.810	2055/11/4	1.64
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	700,000,000	101.37	709,604,000	101.10	707,700,000	0.100	2029/3/20	1.62
日本	社債券	第1回積水ハウス利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	700,000,000	101.18	708,302,000	100.54	703,822,000	0.810	2077/8/18	1.61
日本	社債券	第20回みずほフィナンシャルグループ期限前償還(劣後特約付)	700,000,000	99.67	697,725,000	99.65	697,550,000	0.390	2029/10/30	1.60
日本	社債券	第7回イオン利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	600,000,000	100.00	600,000,000	103.28	619,704,000	1.740	2050/12/2	1.42
日本	社債券	第2回住友化学利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	600,000,000	100.01	600,110,000	100.21	601,260,000	0.840	2079/12/13	1.38

日本	社債券	第9回ソフトバンク株式会社無担保社債	600,000,000	100.00	600,000,000	99.96	599,772,000	0.480	2027/12/3	1.37
日本	国債証券	第2回利付国債（40年）	410,000,000	143.75	589,415,200	140.36	575,496,500	2.200	2049/3/20	1.32
日本	国債証券	第4回1回利付国債（30年）	450,000,000	132.89	598,009,500	125.28	563,769,000	1.700	2043/12/20	1.29
日本	国債証券	第1回2回利付国債（40年）	600,000,000	103.07	618,439,000	93.83	563,034,000	0.500	2059/3/20	1.29
日本	国債証券	第1回6回3回利付国債（20年）	510,000,000	105.50	538,050,000	103.98	530,323,500	0.600	2037/12/20	1.21
日本	国債証券	第1回6回5回利付国債（20年）	500,000,000	102.81	514,065,000	102.03	510,195,000	0.500	2038/6/20	1.17
日本	社債券	第3回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	100.57	502,895,000	100.61	503,055,000	0.850	2077/12/10	1.15
日本	社債券	第1回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	101.14	505,700,000	100.41	502,060,000	0.960	2079/12/24	1.15
日本	社債券	第2回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	100.00	500,000,000	100.16	500,800,000	1.380	2080/7/30	1.15
日本	社債券	第1回あいおいニッセイ同和損害保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	100.15	500,765,000	100.07	500,385,000	0.660	2079/9/10	1.15
日本	国債証券	第1回7回4回利付国債（20年）	500,000,000	100.18	500,915,000	99.00	495,040,000	0.400	2040/9/20	1.13
日本	国債証券	第1回6回0回利付国債（20年）	460,000,000	106.72	490,912,000	105.82	486,808,800	0.700	2037/3/20	1.12
日本	国債証券	第3回5回9回利付国債（10年）	480,000,000	100.89	484,272,000	100.74	483,595,200	0.100	2030/6/20	1.11
日本	国債証券	第6回4回利付国債（30年）	470,000,000	101.61	477,567,000	93.62	440,037,500	0.400	2049/9/20	1.01
日本	社債券	第6回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	100.00	400,000,000	107.95	431,816,000	3.000	2060/11/4	0.99
日本	国債証券	第5回2回利付国債（30年）	420,000,000	105.05	441,210,000	98.10	412,041,000	0.500	2046/9/20	0.94
日本	社債券	第1回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	102.90	411,604,000	101.85	407,420,000	1.300	2079/12/13	0.93
日本	社債券	第1回サントリーHD利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	100.74	402,968,000	100.39	401,592,000	0.680	2078/4/25	0.92

(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	33.80
社債券	63.84
合計	97.64

(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 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	売建	50円		7,597,213,500	7,591,000,000	17.39

(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。

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 (%)
債券オプション	店頭	第145回利付国債(5年)コールオプション	売建	40,000,000円		40,000	2,320,000	0.01
	店頭	第165回利付国債(20年)コールオプション	買建	10,000,000円		6,000,000	300,000	0.00
	店頭	第174回利付国債(20年)コールオプション	買建	9,000,000円		11,000	549,000	0.00
	店頭	第144回利付国債(5年)コールオプション	売建	6,000,000円		1,800,000	54,000	0.00
	店頭	第419回利付国債(2年)コールオプション	売建	50,000,000円		5,000,000		
	店頭	第145回利付国債(5年)コールオプション	売建	11,000,000円		550,000	330,000	0.00
	店頭	第361回利付国債(10年)コールオプション	買建	15,000,000円		3,450,000	1,890,000	0.00
	店頭	第361回利付国債(10年)コールオプション	買建	11,000,000円		11,000	1,551,000	0.00
	店頭	第361回利付国債(10年)コールオプション	買建	20,000,000円		3,200,000	4,140,000	0.01
	店頭	第69回利付国債(30年)コールオプション	売建	7,000,000円		7,000	6,657,000	0.02
	店頭	第145回利付国債(5年)プットオプション	買建	40,000,000円		1,840,000	640,000	0.00
	店頭	第165回利付国債(20年)プットオプション	売建	10,000,000円		7,136,000	11,140,000	0.03
	店頭	第174回利付国債(20年)プットオプション	売建	9,000,000円		854,000	12,906,000	0.03
	店頭	第144回利付国債(5年)プットオプション	買建	6,000,000円		2,160,000	864,000	0.00
	店頭	第419回利付国債(2年)プットオプション	買建	50,000,000円		7,150,000	2,850,000	0.01
	店頭	第145回利付国債(5年)プットオプション	買建	11,000,000円		1,067,000	1,122,000	0.00
	店頭	第361回利付国債(10年)プットオプション	売建	15,000,000円		4,061,000	5,490,000	0.01
	店頭	第361回利付国債(10年)プットオプション	売建	11,000,000円		440,000	4,213,000	0.01
	店頭	第361回利付国債(10年)プットオプション	売建	20,000,000円		3,980,000	5,500,000	0.01
	店頭	第69回利付国債(30年)プットオプション	買建	7,000,000円		1,015,000	8,085,000	0.02

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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	308,577,125,227	65.86
	イギリス	20,813,172,378	4.44
	スイス	15,889,789,463	3.39
	カナダ	15,497,643,213	3.31
	フランス	14,955,629,750	3.19
	ドイツ	13,885,174,345	2.96
	オーストラリア	9,658,839,650	2.06
	オランダ	8,485,535,851	1.81
	アイルランド	8,138,585,120	1.74
	スウェーデン	5,074,649,995	1.08
	香港	3,792,371,038	0.81
	デンマーク	3,741,313,490	0.80
	スペイン	3,636,916,253	0.78
	イタリア	2,775,622,389	0.59
	フィンランド	1,908,465,856	0.41
	バミューダ	1,490,512,676	0.32
	シンガポール	1,379,497,547	0.29
	ジャージー	1,374,587,675	0.29
	ベルギー	1,333,176,458	0.28
	イスラエル	959,530,516	0.20
	ノルウェー	895,342,514	0.19
	ケイマン	836,087,550	0.18
	ニュージーランド	579,498,145	0.12
	ルクセンブルク	414,089,266	0.09
	キュラソー	290,157,493	0.06
	オーストリア	270,325,446	0.06
	ポルトガル	267,472,848	0.06
	リベリア	122,088,344	0.03
	パナマ	100,069,356	0.02
	マン島	88,293,795	0.02
パプアニューギニア	59,616,997	0.01	
	小計	447,291,180,644	95.46
投資信託受益証券	オーストラリア	208,990,693	0.04
	香港	75,268,747	0.02
	小計	284,259,440	0.06

投資証券	アメリカ	8,107,681,625	1.73
	オーストラリア	654,666,950	0.14
	フランス	277,347,949	0.06
	イギリス	259,161,231	0.06
	シンガポール	239,540,049	0.05
	香港	182,813,738	0.04
	カナダ	59,292,907	0.01
	小計	9,780,504,449	2.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,202,802,960	2.39
合計(純資産総額)		468,558,747,493	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	7,837,996,090	1.67
	買建	カナダ	610,730,244	0.13
	買建	ドイツ	1,620,801,153	0.35
	買建	イギリス	528,989,617	0.11
	買建	オーストラリア	303,443,140	0.06

(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		241,329,400	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	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	1,568,957	8,423.17	13,215,603,458	14,323.16	22,472,427,165	4.80
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	659,370	19,034.16	12,550,558,299	24,963.40	16,460,121,278	3.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	39,039	253,293.99	9,888,344,403	338,266.53	13,205,587,361	2.82
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	220,260	23,700.24	5,220,215,567	27,687.20	6,098,382,672	1.30
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	68,317	17,903.69	1,223,126,581	87,285.72	5,963,098,970	1.27
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,494	148,367.86	4,079,226,185	194,657.73	5,351,919,706	1.14
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	27,509	148,506.82	4,085,274,309	193,622.33	5,326,356,841	1.14
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	240,947	15,361.69	3,701,354,180	17,673.83	4,258,457,955	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	278,861	10,432.32	2,909,169,418	13,593.89	3,790,806,540	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	154,172	20,332.85	3,134,756,582	20,710.02	3,192,906,067	0.68
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	262,902	12,112.04	3,184,280,618	12,070.92	3,173,469,693	0.68
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	227,618	12,199.08	2,776,731,283	13,620.01	3,100,160,073	0.66
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	128,123	19,477.16	2,495,472,376	24,129.65	3,091,563,916	0.66
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	56,416	36,117.69	2,037,615,667	54,542.73	3,077,083,175	0.66
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	86,894	31,768.18	2,760,464,997	35,329.91	3,069,957,373	0.66
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	165,195	12,252.36	2,024,030,196	17,958.02	2,966,575,510	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	98,397	25,740.73	2,532,811,358	29,050.66	2,858,498,186	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	81,638	31,716.99	2,589,311,923	33,880.77	2,765,958,660	0.59
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	101,916	15,669.91	1,597,014,588	24,844.29	2,532,031,597	0.54
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	64,019	40,062.91	2,564,787,762	37,250.20	2,384,720,842	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	391,768	6,404.62	2,509,126,736	5,857.67	2,294,848,131	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	40,623	43,458.45	1,765,412,858	56,272.92	2,285,975,154	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	420,027	4,158.30	1,746,599,955	5,391.16	2,264,436,122	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	712,055	2,599.46	1,850,960,199	3,167.83	2,255,671,754	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	39,056	37,382.42	1,460,008,139	56,789.51	2,217,971,493	0.47

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	377,805	5,839.38	2,206,149,682	5,785.05	2,185,623,687	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	44,184	40,032.55	1,768,798,489	48,653.20	2,149,693,059	0.46
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	163,008	9,674.84	1,577,077,622	12,578.34	2,050,371,220	0.44
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	83,779	19,592.08	1,641,405,675	23,664.72	1,982,606,577	0.42
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	656,261	3,237.83	2,124,864,966	3,009.02	1,974,705,099	0.42

(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	4.32
		資本財	6.20
		商業・専門サービス	1.10
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	2.20
		耐久消費財・アパレル	1.88
		消費者サービス	1.49
		メディア・娯楽	6.81
		小売	5.87
		食品・生活必需品小売り	1.41
		食品・飲料・タバコ	3.94
		家庭用品・パーソナル用品	1.85
		ヘルスケア機器・サービス	5.16
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.84
		銀行	5.47
		各種金融	4.26
		保険	2.99
		不動産	0.47
		ソフトウェア・サービス	11.73
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.26		
電気通信サービス	1.78		
公益事業	3.17		
半導体・半導体製造装置	4.40		
		小計	95.46
投資信託受益証券			0.06
投資証券			2.09

合計	97.61
----	-------

(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	397	アメリカドル	73,735,509	7,703,885,980	75,019,105	7,837,996,090	1.67
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	36	カナダドル	7,462,622	607,084,300	7,507,440	610,730,244	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	4,031,386	473,647,541	4,093,740	480,973,512	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	254	ユーロ	8,968,883	1,134,384,321	9,011,920	1,139,827,641	0.24
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	23	オーストラリアドル	3,815,886	305,576,151	3,789,250	303,443,140	0.06
	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	57	イギリスポンド	3,732,198.75	534,600,149	3,693,030	528,989,617	0.11

(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	1,220,000.00	127,453,400	127,453,400	0.03
	カナダドル	売建	1,400,000.00	113,743,000	113,876,000	0.02

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

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

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	120,586,185,276	42.05

フランス	29,990,272,554	10.46
イタリア	26,581,001,401	9.27
ドイツ	21,774,136,550	7.59
イギリス	19,295,038,059	6.73
スペイン	17,053,426,690	5.95
オーストラリア	7,716,537,764	2.69
ベルギー	7,108,387,313	2.48
オランダ	5,616,143,801	1.96
カナダ	5,534,313,820	1.93
オーストリア	4,335,703,483	1.51
アイルランド	2,392,141,409	0.83
メキシコ	2,270,805,809	0.79
フィンランド	1,789,480,172	0.62
ポーランド	1,778,066,528	0.62
デンマーク	1,457,486,835	0.51
マレーシア	1,368,903,252	0.48
イスラエル	1,257,609,683	0.44
シンガポール	1,232,842,764	0.43
スウェーデン	946,379,776	0.33
ノルウェー	645,589,880	0.23
小計	280,730,452,819	97.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	6,006,126,761	2.09
合計(純資産総額)	286,736,579,580	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	1,422,664,174	0.50
	買建	ドイツ	1,924,104,825	0.67

(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		3,368,097,300	1.17

(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% 08/15/30	15,950,000	10,316.70	1,645,514,721	10,058.64	1,604,354,484	0.625	2030/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,400.47	1,466,466,841	10,089.66	1,422,642,948	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,776.03	1,265,924,171	11,580.95	1,244,952,662	2.375	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,217.63	1,220,541,237	11,878.07	1,186,619,193	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,450.76	1,170,267,988	11,308.73	1,155,752,777	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,344.65	1,151,482,035	11,228.74	1,139,717,424	2.250	2024/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	22,905.76	1,081,152,292	23,785.44	1,122,673,210	4.500	2041/4/25	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,505.09	1,146,582,287	13,219.05	1,122,297,956	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,904.28	1,090,428,380	10,791.84	1,079,184,535	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,356.39	1,102,190,211	12,033.15	1,073,357,649	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,752.05	1,075,205,310	10,673.08	1,067,308,095	1.500	2022/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,468.68	1,062,571,735	10,474.12	1,063,123,180	0.250	2023/4/15	0.37
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	12,960.53	1,048,507,482	13,004.92	1,052,098,559	0.000	2025/3/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,441.52	1,044,152,224	10,394.12	1,039,412,750	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,612.69	1,059,466,380	12,255.17	1,029,434,910	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,653.60	1,042,997,316	11,480.14	1,027,473,254	2.250	2027/2/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	15,892.76	1,013,958,135	16,092.30	1,026,688,954	2.500	2030/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,776.13	1,029,120,653	10,677.36	1,019,688,482	1.750	2022/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,748.99	1,026,528,749	10,649.81	1,017,057,604	1.750	2022/3/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	10,727.53	1,019,116,102	10,682.87	1,014,873,215	1.500	2022/9/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,719.71	1,002,035,846	11,509.94	984,099,981	2.250	2027/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000	19,029.67	983,834,192	18,994.26	982,003,267	5.500	2029/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	10,962.14	986,593,147	10,894.08	980,467,254	1.375	2025/1/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,545.21	987,121,096	15,437.64	980,290,323	3.500	2026/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,398.16	987,825,489	10,252.91	974,027,048	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,205.48	983,841,144	11,085.89	973,341,967	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/15/50	10,650,000	10,076.81	1,073,180,776	9,106.90	969,884,987	1.250	2050/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	10,830.41	974,737,179	10,725.93	965,333,979	1.875	2022/7/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000	13,626.50	936,141,087	13,829.82	950,109,260	0.750	2028/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	T 2.25% 12/31/24	8,400,000	11,364.24	954,596,210	11,248.33	944,859,980	2.250	2024/12/31	0.33

(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	97.91
合計	97.91

(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	41	アメリカドル	5,156,005.55	538,699,459	5,163,117.29	539,442,494	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	27	アメリカドル	3,696,997.51	386,262,300	3,705,750	387,176,760	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	28	アメリカドル	4,731,172.15	494,312,866	4,747,750	496,044,920	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	19	ユーロ	2,133,579.9	269,855,186	2,134,840	270,014,563	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	27	ユーロ	3,650,456.7	461,709,763	3,656,070	462,419,733	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	53	ユーロ	9,404,971.3	1,189,540,770	9,421,810	1,191,670,529	0.42

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	13,990,000.00	1,450,332,376	1,461,395,400	0.51
	カナダドル	買建	2,210,000.00	180,807,153	179,739,300	0.06
	ユーロ	買建	11,580,000.00	1,456,807,766	1,464,870,000	0.51
	イギリスポンド	買建	1,830,000.00	259,397,939	262,092,600	0.09

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

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

新興国債券インデックス 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	中国	6,562,509,460	10.24
	インドネシア	6,072,392,722	9.48
	メキシコ	6,017,886,482	9.39
	タイ	5,593,892,498	8.73
	ポーランド	5,228,744,028	8.16
	ブラジル	5,139,485,839	8.02
	ロシア	4,532,777,183	7.07
	南アフリカ	4,531,182,984	7.07
	マレーシア	4,410,878,065	6.88
	コロンビア	3,364,335,230	5.25
	ハンガリー	2,567,731,183	4.01
	チェコ	2,461,475,428	3.84
	ペルー	1,732,565,112	2.70
	チリ	1,687,901,506	2.63
	トルコ	1,176,611,474	1.84
	フィリピン	117,890,892	0.18
	ドミニカ共和国	86,111,701	0.13
	ウルグアイ	85,600,612	0.13
	小計	61,369,972,399	95.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,712,732,231	4.23
合計(純資産総額)		64,082,704,630	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		10,391,649	0.02
	売建		10,358,820	0.02

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	88,800,000,000	3.79	3,365,746,084	3.78	3,364,335,230	9.850	2027/6/28	5.25
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	79,700,000	1,607.82	1,281,432,985	1,614.82	1,287,017,991	0.000	2024/1/1	2.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	114,200,000	812.73	928,144,852	813.71	929,266,230	10.500	2026/12/21	1.45
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,661.38	850,626,774	1,680.59	860,463,564	0.000	2023/7/1	1.34
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000	2,112.28	797,386,154	2,088.15	788,279,739	10.000	2023/1/1	1.23
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	171,200,000	426.41	730,017,190	428.96	734,389,244	3.300	2038/6/17	1.15
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000	2,173.24	730,211,328	2,160.10	725,793,818	10.000	2025/1/1	1.13
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	25,750,000	2,838.70	730,965,673	2,814.59	724,757,350	3.885	2029/8/15	1.13
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000	1,615.25	694,561,113	1,613.88	693,970,830	2.940	2024/10/17	1.08
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	573.63	623,251,983	590.24	641,302,985	7.500	2027/6/3	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	613.08	614,622,349	617.40	618,951,269	10.000	2024/12/5	0.97
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,680.27	612,443,370	2,667.84	609,602,937	3.480	2023/3/15	0.95
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	19,400,000	3,083.02	598,107,712	3,074.67	596,487,424	2.500	2026/7/25	0.93
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	19,850,000	3,014.90	598,458,634	2,997.44	594,993,682	2.500	2024/4/25	0.93
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	93,600,000	610.79	571,704,260	630.57	590,214,596	8.500	2029/5/31	0.92
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	26,850,000	2,204.44	591,892,721	2,194.21	589,146,011	10.000	2027/1/1	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	89,200,000	655.94	585,101,689	656.40	585,508,943	8.000	2030/1/31	0.91
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,935.31	584,126,769	2,921.50	581,378,850	2.500	2023/1/25	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	532.07	575,702,174	531.05	574,598,859	6.500	2022/6/9	0.90
中国	国債証券	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000	1,630.95	570,834,670	1,634.71	572,151,703	3.250	2026/6/6	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	565.51	553,918,221	566.65	555,038,083	8.000	2023/12/7	0.87
中国	国債証券	CGB 2.68% 05/21/30	35,400,000	1,541.98	545,863,717	1,541.46	545,680,043	2.680	2030/5/21	0.85
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	126,700,000	431.16	546,290,515	430.25	545,130,906	3.400	2036/6/17	0.85
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	557.47	497,829,212	566.15	505,576,594	8.750	2048/2/28	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	424.72	485,459,029	426.70	487,726,284	3.650	2031/6/20	0.76
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,575.76	480,606,864	1,584.83	483,373,699	2.850	2027/6/4	0.75
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	3,174.01	477,688,589	3,184.50	479,268,189	2.750	2029/10/25	0.75
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000	448.87	473,559,566	450.94	475,743,683	4.875	2029/6/22	0.74
中国	国債証券	CGB 3.19% 04/11/24	28,000,000	1,628.80	456,065,632	1,630.24	456,468,768	3.190	2024/4/11	0.71
中国	国債証券	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000	1,610.55	450,955,998	1,615.90	452,453,232	3.020	2025/10/22	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	95.77
合計	95.77

(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	99,470.18	10,434,988	10,391,649	0.02
	ロシアルーブル	売建	7,616,780.00	10,434,988	10,358,820	0.02

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

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

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	101,046,346,720	96.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,551,145,081	3.40
合計(純資産総額)		104,597,491,801	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	3,536,916,000	3.38

(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	11,489	575,287.25	6,609,475,215	632,000	7,261,048,000	6.94
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,208	551,577.63	5,630,504,447	637,000	6,502,496,000	6.22
日本	投資証券	GLP投資法人	31,899	154,146.49	4,917,118,884	167,800	5,352,652,200	5.12
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,546	330,363.03	5,135,823,674	341,500	5,308,959,000	5.08
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	33,011	136,596.9	4,509,200,265	158,900	5,245,447,900	5.01
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,565	244,796.39	3,565,459,420	281,300	4,097,134,500	3.92
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	19,179	169,665.55	3,254,015,583	198,000	3,797,442,000	3.63
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	20,340	159,796.68	3,250,264,471	175,200	3,563,568,000	3.41
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,832	126,588.44	2,763,678,822	142,300	3,106,693,600	2.97
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,696	304,450.87	2,951,955,635	310,000	3,005,760,000	2.87
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,430	176,642.1	2,548,945,503	188,200	2,715,726,000	2.60
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,356	313,544.47	1,992,888,651	369,500	2,348,542,000	2.25
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	30,025	75,088.43	2,254,530,110	75,700	2,272,892,500	2.17
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,115	403,120.49	2,061,961,306	419,000	2,143,185,000	2.05
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,158	633,733.32	2,001,329,824	675,000	2,131,650,000	2.04
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,670	290,685.77	1,938,874,085	313,000	2,087,710,000	2.00
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,518	585,087.28	2,058,337,051	576,000	2,026,368,000	1.94
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,376	161,443.01	1,836,575,681	164,200	1,867,939,200	1.79
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	3,563	493,801.27	1,759,413,925	524,000	1,867,012,000	1.78
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,991	132,213.47	1,585,371,718	145,800	1,748,287,800	1.67
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,885	57,584.14	1,893,654,443	52,500	1,726,462,500	1.65
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	42,684	38,137.52	1,627,861,903	34,850	1,487,537,400	1.42
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,175	630,016.5	1,370,285,887	677,000	1,472,475,000	1.41
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,388	378,430.89	1,282,123,855	429,000	1,453,452,000	1.39
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,354	124,123.68	1,285,176,582	138,000	1,428,852,000	1.37
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,330	100,250.48	1,336,338,898	100,400	1,338,332,000	1.28
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,454	301,680.15	1,343,683,388	297,500	1,325,065,000	1.27
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,218	143,618.79	1,180,259,216	159,000	1,306,662,000	1.25
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,316	357,965.51	1,187,013,631	372,000	1,233,552,000	1.18
日本	投資証券	M C U B S Mid C i t y 投資法人	12,491	84,337.8	1,053,463,459	98,400	1,229,114,400	1.18

(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	3,201,444,000	3,536,916,000	3.38

(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	59,212,251,564	72.72
	オーストラリア	6,058,508,945	7.44
	イギリス	4,528,132,610	5.56
	シンガポール	3,500,782,861	4.30
	フランス	2,089,538,226	2.57
	カナダ	1,523,126,158	1.87
	香港	1,350,886,202	1.66
	ベルギー	1,155,924,777	1.42
	ニュージーランド	415,878,875	0.51
	スペイン	386,990,573	0.48
	ドイツ	249,595,632	0.31
	ガンジー	214,187,057	0.26
	オランダ	168,144,384	0.21
	アイルランド	106,512,248	0.13
	韓国	97,036,070	0.12
	イスラエル	63,685,502	0.08
	マン島	19,241,143	0.02
イタリア	15,107,739	0.02	
	小計	81,155,530,566	99.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		266,487,533	0.33
合計(純資産総額)		81,422,018,099	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		26,117,500	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	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	454,886	10,407.25	4,734,113,597	10,803.23	4,914,238,991	6.04
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	54,815	77,650.58	4,256,416,587	77,130.27	4,227,895,772	5.19
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	172,036	14,429.73	2,482,433,512	15,136.01	2,603,939,924	3.20
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	93,803	23,202.91	2,176,503,355	23,770.24	2,229,720,273	2.74
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	201,268	8,276.90	1,665,876,236	10,187.84	2,050,487,147	2.52
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	257,211	6,964.63	1,791,381,196	6,454.77	1,660,238,978	2.04
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,986	17,206.81	1,479,544,868	17,345.76	1,491,493,345	1.83
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,032,018	1,599.19	1,650,400,708	1,416.61	1,461,972,385	1.80
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	216,880	6,433.98	1,395,402,998	6,368.05	1,381,103,985	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	210,837	6,193.57	1,305,834,646	6,515.37	1,373,681,655	1.69
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,436	16,195.83	1,237,944,852	17,483.68	1,336,382,809	1.64
香港	投資証券	LINK REIT	1,269,400	849.24	1,078,025,256	918.66	1,166,149,543	1.43
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	229,561	4,894.88	1,123,675,384	4,930.41	1,131,830,125	1.39
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	344,097	2,882.60	991,895,114	3,030.96	1,042,945,895	1.28
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	331,090	3,041.41	1,006,981,364	3,135.44	1,038,114,419	1.27
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	40,091	26,584.93	1,065,816,669	25,427.29	1,019,405,788	1.25
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	732,491	1,296.32	949,544,198	1,368.80	1,002,634,735	1.23
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	66,396	14,250.21	946,157,255	15,021.08	997,340,265	1.22
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,276	13,123.73	922,283,446	13,873.89	975,002,140	1.20
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	79,295	11,171.00	885,804,571	11,835.49	938,495,528	1.15
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	227,492	4,039.19	918,884,958	4,124.87	938,375,017	1.15
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	329,746	2,488.71	820,643,355	2,700.80	890,580,635	1.09
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	87,045	9,274.68	807,315,356	9,603.80	835,962,910	1.03
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	350,228	2,016.14	706,108,785	2,216.02	776,112,533	0.95
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	84,908	5,408.28	459,206,645	8,959.84	760,762,366	0.93
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	107,487	6,970.90	749,281,730	7,049.26	757,704,411	0.93
アメリカ	投資証券	UDR INC	180,652	3,985.91	720,062,975	4,066.36	734,596,356	0.90

オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,183,999	192.99	614,488,882	226.62	721,578,231	0.89
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	103,916	6,078.64	631,668,619	6,425.51	667,714,336	0.82
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	431,456	1,425.10	614,871,052	1,488.83	642,368,951	0.79

(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	99.67
合計	99.67

(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	売建	250,000.00	26,117,500	26,117,500	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。

グローバル・コモディティ（米ドル建て） 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(%)
社債券	アイルランド	8,004,735,200	42.52
	ルクセンブルク	7,886,181,744	41.89
	イギリス	2,002,432,336	10.64
	アメリカ	353,090,160	1.88
	ジャージー	347,291,520	1.84
	小計	18,593,730,960	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		232,851,237	1.24
合計(純資産総額)		18,826,582,197	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 (%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/22/21	70,000,000	10,448.00	7,313,600,000	11,435.33	8,004,735,200	0.000	2021/10/22	42.52
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 019 04/30/21	21,000,000	10,586.95	2,223,261,264	13,475.83	2,829,924,384	0.000	2021/4/30	15.03
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 020 06/30/21	17,000,000	10,630.84	1,807,242,800	12,594.01	2,140,983,264	0.000	2021/6/30	11.37
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 018 02/26/21	14,000,000	9,413.64	1,317,910,720	12,025.64	1,683,590,720	0.000	2021/2/26	8.94
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 021 11/30/21	11,000,000	10,757.64	1,183,340,480	11,197.12	1,231,683,376	0.000	2021/11/30	6.54
イギリス	社債券	CS USD COM 017 07/30/21	9,000,000	10,474.12	942,670,800	11,953.55	1,075,820,112	0.000	2021/7/30	5.71
イギリス	社債券	BAR USD COM 038 08/31/21	8,000,000	10,500.24	840,019,200	11,582.65	926,612,224	0.000	2021/8/31	4.92
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	1,764.66	264,700,080	2,353.93	353,090,160	0.000	2036/6/12	1.88
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	675.98	270,394,240	868.22	347,291,520	0.000	9999/99/99	1.84

(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。

(注3) 償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	98.76
合計	98.76

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	33,394,675,401	101.19
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		392,115,902	1.19
合計（純資産総額）		33,002,559,499	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		34,200,871,577	103.63

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 （％）
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	18,212,390	1,821.20	33,168,568,326	1,833.62	33,394,675,401	101.19

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	101.19
合計	101.19

(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	327,375,051.00	33,732,843,807	34,200,871,577	103.63

(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。

米国株式LS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(%)
社債券	アイルランド	23,276,869,344	98.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		310,667,193	1.32
合計(純資産総額)		23,587,536,537	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		1,034,428,509	4.39
	売建		23,287,890,000	98.73

(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 (%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/22	225,000,000	11,366.28	25,574,142,150	10,345.27	23,276,869,344	0.000	2022/10/18	98.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
社債券	98.68
合計	98.68

(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	9,901,680.00	1,034,438,411	1,034,428,509	4.39
	アメリカドル	売建	223,000,000.00	23,288,447,500	23,287,890,000	98.73

(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。

コモディティ L S アルファ・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(%)
社債券	アイルランド	17,276,896,000	98.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		198,585,521	1.14
合計(純資産総額)		17,475,481,521	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、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 (%)
アイル ランド	社債券	STAR HEL IOS 0% 0 7/13/21	15,470,000,000	111.99	17,325,309,000	111.68	17,276,896,000	0.000	2021/7/13	98.86

(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(%)
社債券	98.86
合計	98.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	17,327,772,000	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		412,357,466	2.32
合計(純資産総額)		17,740,129,466	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(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 10/18/21	18,620,000,000	99.84	18,590,362,000	93.06	17,327,772,000	0.000	2021/10/18	97.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
社債券	97.68
合計	97.68

(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

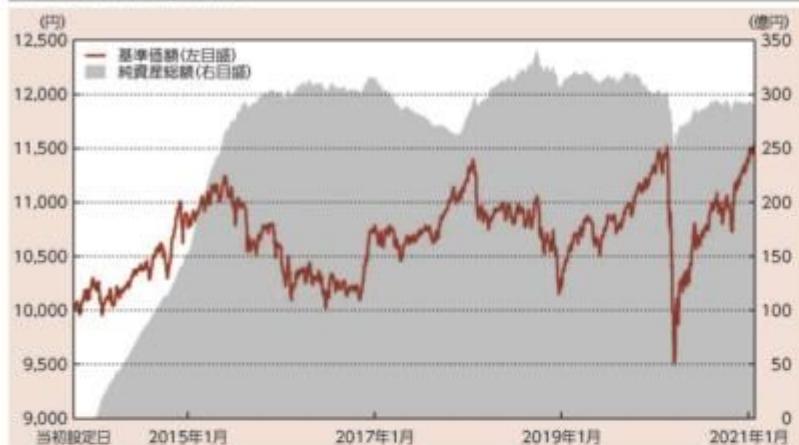
該当事項はありません。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2013年10月17日
作成基準日：2021年1月29日


基準価額・純資産の推移


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 11,455円

純資産総額 287.89億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2016年7月	0円
2017年7月	0円
2018年7月	0円
2019年7月	0円
2020年7月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	14.0%
国内株式インデックス マザーファンド	13.4%
外国債券インデックス マザーファンド	8.6%
J-REIT インデックス マザーファンド	6.5%
グローバルREIT インデックス マザーファンド	6.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.0%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	5.8%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4.9%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	3.9%
米国株式LSマザーファンド	3.7%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021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。

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等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々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、申込みを受け付けられないものとします。

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（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8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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、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。

<スイッチング>

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。上記受付不可日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

<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々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

<一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7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て扱います。

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、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（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 >

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法
計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法
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。

外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

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

- ・ 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。

- ・ 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。

- ・ 公社債等（仕組債を含みます。）

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。

- ・ 市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

- ・ 店頭デリバティブ取引

計算日における次のa. 又はb. のいずれかの価額で評価します。

- a. 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。）
- b. 価格情報会社の提供する価額

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2013年10月17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7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年10月17日から2014年7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ち、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらか

じめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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にあっても、当該併合に係る他のファン

ドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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ます。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2019年7月11日から2020年7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】

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2019年 7月10日現在）	第7期 （2020年 7月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	704,008,991	851,936,471
投資信託受益証券	17,219,654,576	10,005,709,730
投資証券	1,630,199,887	795,918,333
親投資信託受益証券	12,426,933,579	17,057,216,938
流動資産合計	31,980,797,033	28,710,781,472
資産合計	31,980,797,033	28,710,781,472
負債の部		
流動負債		
未払解約金	134,368,173	7,644,402
未払受託者報酬	8,459,990	7,697,483
未払委託者報酬	225,035,710	204,753,010
未払利息	1,942	457
その他未払費用	807,543	770,046
流動負債合計	368,673,358	220,865,398
負債合計	368,673,358	220,865,398
純資産の部		
元本等		
元本	29,103,280,048	26,675,763,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,508,843,627	1,814,152,974
（分配準備積立金）	303,442,172	239,238,064
元本等合計	31,612,123,675	28,489,916,074
純資産合計	31,612,123,675	28,489,916,074
負債純資産合計	31,980,797,033	28,710,781,472

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自 2018年 7月11日 至 2019年 7月10日		自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	
営業収益				
受取配当金		39,204,019		26,491,812
受取利息		410		2,646
有価証券売買等損益		323,599,728		44,871,558
その他収益		5,729		1,287
営業収益合計		362,809,886		71,367,303
営業費用				
支払利息		461,262		333,253
受託者報酬		17,239,342		16,254,663
委託者報酬		458,566,315		432,374,001
その他費用		1,664,565		1,596,249
営業費用合計		477,931,484		450,558,166
営業利益又は営業損失（ ）		115,121,598		379,190,863
経常利益又は経常損失（ ）		115,121,598		379,190,863
当期純利益又は当期純損失（ ）		115,121,598		379,190,863
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（ ）		111,925,687		133,202,046
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,594,964,689		2,508,843,627
剰余金増加額又は欠損金減少額		543,681,841		387,519,130
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		543,681,841		387,519,130
剰余金減少額又は欠損金増加額		626,606,992		569,816,874
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		626,606,992		569,816,874
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,508,843,627		1,814,152,974

(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	<p>(1)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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)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>(3)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。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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>

(貸借対照表に関する注記)

	第6期 (2019年 7月10日現在)	第7期 (2020年 7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,103,280,048口	26,675,763,100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 1.0862円 (1万口当たり純資産額) (10,862円)	1口当たり純資産額 1.0680円 (1万口当たり純資産額) (10,680円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 2018年 7月11日 至 2019年 7月10日	第7期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日												
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="172 1966 754 2056"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="834 1966 1417 2056"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円
項目													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円											
項目													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円											

第6期 自 2018年 7月11日 至 2019年 7月10日			第7期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日		
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	2,205,401,455円	収益調整金額	C	1,574,914,910円
分配準備積立金額	D	303,442,172円	分配準備積立金額	D	239,238,064円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,508,843,627円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,814,152,974円
当ファンドの期末残存口数	F	29,103,280,048口	当ファンドの期末残存口数	F	26,675,763,100口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	862円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	680円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7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 7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。

	第7期 (2020年 7月10日現在)
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第6期 自 2018年 7月11日 至 2019年 7月10日	第7期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	28,993,439,555円	29,103,280,048円
期中追加設定元本額	7,219,577,787円	4,135,234,340円
期中一部解約元本額	7,109,737,294円	6,562,751,288円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期 (2019年 7月10日現在)	第7期 (2020年 7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)

投資信託受益証券	71,976,320	61,081,812
投資証券	14,234,086	10,112,039
親投資信託受益証券	664,562,082	114,644,659
合計	722,304,316	43,450,808

（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
投資信託受益証券	ノムラ F O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略 ファンド（適格機関投資家専用）	1,317,293,773	1,419,384,040	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機 関投資家専用）	1,404,448,106	1,246,588,138	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	41,629.317	404,054,150	
	大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド （適格機関投資家専用）	240,054,479	236,237,612	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド （適格機関投資家専用）	139,069,164	166,076,395	
	L M ・ウエスタン・グローバル債券ファンド （適格機関投資家専用）	333,100,294	368,209,064	
	F O F s 用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為 替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	1,851,986,324	2,036,073,764	
	F O F s 用 K I M マルチストラテジー リ ンクファンド（適格機関投資家専用）	350,461,273	341,874,971	
	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リ ンクファンド（適格機関投資家専用）	1,045,731,597	1,100,109,640	
	F O F s 用世界物価連動債ファンド 為替ヘッ ジあり（適格機関投資家専用）	596,378,721	654,227,456	
マニユライフ F O F s 用日本債券ストラテジッ クファンド（適格機関投資家専用）	2,076,056,475	2,032,874,500		
投資信託受益証券合計		9,354,621,835.317	10,005,709,730	
投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	59,081.463	597,524,511	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	20,000	198,393,822	

投資証券合計		79,081,463	795,918,333
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,107,909,967	1,860,845,580
	グローバルREITインデックス マザーファンド	691,612,815	1,077,947,733
	国内株式インデックス マザーファンド	1,850,426,267	2,685,893,726
	外国株式インデックス マザーファンド	1,124,523,312	3,037,449,918
	外国債券インデックス マザーファンド	563,477,235	1,660,905,497
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	2,038,753,933	536,600,035
	新興国債券インデックス マザーファンド	86,647,214	143,019,891
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	1,493,024,102	1,915,997,830
	コモディティLSアルファ・マザーファンド	831,055,128	931,197,270
	米国株式LSマザーファンド	1,172,838,484	1,186,091,558
	日本債券ツイン戦略マザーファンド	2,052,882,288	2,021,267,900
親投資信託受益証券合計		13,013,150,745	17,057,216,938
合計			27,858,845,001

(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

項目	2020年 7月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,260,861,007
株式	312,636,026,410
派生商品評価勘定	3,592,500
未収配当金	493,810,981
前払金	74,338,400
差入委託証拠金	73,310,000
流動資産合計	315,541,939,298
資産合計	315,541,939,298

	2020年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,944,100
未払金	686,100
未払解約金	64,251,289
未払利息	1,214
その他未払費用	6,565
流動負債合計	142,889,268
負債合計	142,889,268
純資産の部	
元本等	
元本	217,285,082,423
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	98,113,967,607
元本等合計	315,399,050,030
純資産合計	315,399,050,030
負債純資産合計	315,541,939,298

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月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。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		217,285,082,423口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4515円 (14,515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 7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 7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 7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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	193,616,822,892円
期中追加設定元本額	66,312,526,217円
期中一部解約元本額	42,644,266,686円
期末元本額	217,285,082,423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）	541,055,718円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,050,246,717円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,240,338円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,456,983,978円
世界経済インデックスファンド	2,298,962,683円

区分	2020年 7月10日現在
日本株式インデックス・オープン	4,150,542,504円
DCマイセレクション25	6,899,139,745円
DCマイセレクション50	19,439,702,052円
DCマイセレクション75	18,089,893,302円
DC日本株式インデックス・オープン	5,822,748,914円
DCマイセレクションS25	2,940,054,721円
DCマイセレクションS50	8,272,040,623円
DCマイセレクションS75	5,329,967,071円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,051,200,471円
DCターゲット・イヤーフンド2025	344,381,220円
DCターゲット・イヤーフンド2035	708,161,711円
DCターゲット・イヤーフンド2045	474,080,030円
DC世界経済インデックスファンド	2,935,270,791円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,059,050,541円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	16,817,284円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	35,161,415円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,561,470円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	260,313,684円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,628,611円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	67,605,289円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	251,518,762円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	52,460,062円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	274,377,858円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,515,463,846円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	663,715,865円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,797,189,211円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	608,958,156円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	38,731,034円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	696,369,212円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	34,307,613円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	410,487,800円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	510,782,623円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	52,581,925円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	829,044,424円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,592,388,781円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,082,491,336円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,687,113,627円
コア投資戦略ファンド(成長型)	7,064,328,730円
分散投資コア戦略ファンドA	5,501,749,681円
分散投資コア戦略ファンドS	15,115,390,823円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	331,530,669円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	352,847,065円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,850,426,267円

区分	2020年 7月10日現在
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	208,294,193円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,928,764円
SMT インデックスバランス・オープン	67,691,494円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,641,059,306円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	23,792,274円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	78,739,306円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	13,758,068円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,863,991円
グローバル経済コア	267,496,639円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	18,946,686円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	49,908,661円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,376,418円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	761,423,048円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	111,994,533円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	219,064円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	247,042円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	88,935円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	117,892円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	49,999,759,040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)	1,854,071,666円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	45,773,563円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	12,399,482円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,198,262,701
合計	6,198,262,701

(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 7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	2,813,758,400	-	2,739,420,000	74,338,400
合計		2,813,758,400	-	2,739,420,000	74,338,400

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,900	2,650.00	18,285,000	
日本水産	197,100	449.00	88,497,900	
マルハニチロ	28,500	2,064.00	58,824,000	
カネコ種苗	6,000	1,311.00	7,866,000	
サカタのタネ	23,500	3,275.00	76,962,500	
ホクト	15,000	1,981.00	29,715,000	
ホクリヨウ	3,000	630.00	1,890,000	
住石ホールディングス	39,800	116.00	4,616,800	
日鉄鉱業	4,500	4,105.00	18,472,500	
三井松島ホールディングス	7,700	754.00	5,805,800	
国際石油開発帝石	790,900	598.20	473,116,380	
石油資源開発	25,800	1,782.00	45,975,600	
K&Oエナジーグループ	9,600	1,422.00	13,651,200	
ヒノキヤグループ	4,900	1,499.00	7,345,100	
ショーボンドホールディングス	30,700	4,715.00	144,750,500	
ミライト・ホールディングス	58,600	1,518.00	88,954,800	
タマホーム	10,600	1,170.00	12,402,000	
サンヨーホームズ	1,700	628.00	1,067,600	
日本アクア	7,800	620.00	4,836,000	
ファーストコーポレーション	6,000	546.00	3,276,000	
ベステラ	3,400	981.00	3,335,400	
T A T E R U	40,600	172.00	6,983,200	
キャンディル	3,300	514.00	1,696,200	
スペースバリューホールディングス	24,000	339.00	8,136,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	792.00	3,009,600	
第一カッター興業	2,400	2,330.00	5,592,000	
明豊ファシリティワークス	6,300	534.00	3,364,200	

安藤・間	117,400	589.00	69,148,600
東急建設	57,700	532.00	30,696,400
コムシスホールディングス	69,900	3,115.00	217,738,500
ピーアールホールディングス	21,500	574.00	12,341,000
高松コンストラクショングループ	12,300	2,291.00	28,179,300
東建コーポレーション	6,100	6,960.00	42,456,000
ソネック	2,000	784.00	1,568,000
ヤマウラ	8,600	800.00	6,880,000
大成建設	151,800	3,780.00	573,804,000
大林組	455,200	977.00	444,730,400
清水建設	462,000	836.00	386,232,000
飛鳥建設	13,100	1,019.00	13,348,900
長谷工コーポレーション	176,200	1,304.00	229,764,800
松井建設	17,900	617.00	11,044,300
銭高組	2,000	3,680.00	7,360,000
鹿島建設	357,400	1,232.00	440,316,800
不動テトラ	11,900	1,423.00	16,933,700
大末建設	5,300	797.00	4,224,100
鉄建建設	9,900	1,980.00	19,602,000
西松建設	35,100	2,015.00	70,726,500
三井住友建設	110,000	448.00	49,280,000
大豊建設	10,200	2,360.00	24,072,000
前田建設工業	114,000	764.00	87,096,000
佐田建設	9,800	414.00	4,057,200
ナカノフドー建設	12,400	346.00	4,290,400
奥村組	24,700	2,441.00	60,292,700
東鉄工業	19,500	2,630.00	51,285,000
イチケン	3,300	1,462.00	4,824,600
富士ピー・エス	6,700	580.00	3,886,000
浅沼組	5,100	4,055.00	20,680,500
戸田建設	189,000	681.00	128,709,000
熊谷組	21,100	2,554.00	53,889,400
北野建設	2,800	2,557.00	7,159,600
植木組	2,000	2,483.00	4,966,000
矢作建設工業	20,100	735.00	14,773,500
ピーエス三菱	15,000	512.00	7,680,000
日本ハウスホールディングス	31,100	263.00	8,179,300
大東建託	49,700	9,708.00	482,487,600
新日本建設	19,400	772.00	14,976,800
N I P P O	37,700	2,640.00	99,528,000
東亜道路工業	2,800	3,075.00	8,610,000
前田道路	40,200	1,943.00	78,108,600

日本道路	4,400	7,160.00	31,504,000
東亜建設工業	14,200	1,509.00	21,427,800
日本国土開発	44,300	556.00	24,630,800
若築建設	8,200	1,188.00	9,741,600
東洋建設	51,000	373.00	19,023,000
五洋建設	180,500	572.00	103,246,000
世紀東急工業	21,900	732.00	16,030,800
福田組	5,300	4,625.00	24,512,500
住友林業	115,300	1,293.00	149,082,900
日本基礎技術	15,300	400.00	6,120,000
巴コーポレーション	20,200	320.00	6,464,000
大和ハウス工業	450,400	2,416.00	1,088,166,400
ライト工業	26,100	1,455.00	37,975,500
積水ハウス	493,700	2,022.50	998,508,250
日特建設	11,900	750.00	8,925,000
北陸電気工事	7,900	882.00	6,967,800
ユアテック	26,000	611.00	15,886,000
日本リーテック	9,500	2,591.00	24,614,500
四電工	2,500	2,360.00	5,900,000
中電工	18,300	2,173.00	39,765,900
関電工	64,800	877.00	56,829,600
きんでん	108,100	1,734.00	187,445,400
東京エネシス	15,100	704.00	10,630,400
トーエネック	4,600	3,485.00	16,031,000
住友電設	12,800	2,309.00	29,555,200
日本電設工業	25,000	2,294.00	57,350,000
協和エクシオ	69,000	2,541.00	175,329,000
新日本空調	12,000	2,253.00	27,036,000
九電工	31,900	3,120.00	99,528,000
三機工業	32,800	1,176.00	38,572,800
日揮ホールディングス	140,100	1,094.00	153,269,400
中外炉工業	4,900	1,510.00	7,399,000
ヤマト	14,600	588.00	8,584,800
太平電業	11,000	2,176.00	23,936,000
高砂熱学工業	39,500	1,525.00	60,237,500
三晃金属工業	2,000	2,031.00	4,062,000
朝日工業社	3,100	3,035.00	9,408,500
明星工業	29,400	769.00	22,608,600
大気社	22,100	2,953.00	65,261,300
ダイダン	10,900	2,578.00	28,100,200
日比谷総合設備	14,700	1,766.00	25,960,200
フィル・カンパニー	2,600	2,190.00	5,694,000

OSJBホールディングス	71,800	219.00	15,724,200
東洋エンジニアリング	19,100	333.00	6,360,300
レイズネクスト	24,400	1,219.00	29,743,600
日本製粉	42,600	1,638.00	69,778,800
日清製粉グループ本社	164,600	1,522.00	250,521,200
日東富士製粉	1,100	5,820.00	6,402,000
昭和産業	13,400	3,250.00	43,550,000
鳥越製粉	12,900	820.00	10,578,000
中部飼料	17,800	1,526.00	27,162,800
フィード・ワン	97,900	185.00	18,111,500
東洋精糖	2,500	1,150.00	2,875,000
日本甜菜製糖	7,600	1,680.00	12,768,000
三井製糖	12,800	1,900.00	24,320,000
塩水港精糖	15,800	237.00	3,744,600
日新製糖	6,900	1,729.00	11,930,100
森永製菓	34,200	3,950.00	135,090,000
中村屋	3,800	4,010.00	15,238,000
江崎グリコ	43,200	4,990.00	215,568,000
名糖産業	7,000	1,311.00	9,177,000
井村屋グループ	8,300	2,155.00	17,886,500
不二家	8,100	2,149.00	17,406,900
山崎製パン	109,200	1,782.00	194,594,400
第一屋製パン	2,500	982.00	2,455,000
モロゾフ	2,500	5,400.00	13,500,000
亀田製菓	8,300	5,140.00	42,662,000
寿スピリッツ	14,000	4,080.00	57,120,000
カルビー	66,400	2,973.00	197,407,200
森永乳業	26,900	4,725.00	127,102,500
六甲バター	9,700	1,417.00	13,744,900
ヤクルト本社	100,200	6,270.00	628,254,000
明治ホールディングス	96,300	8,340.00	803,142,000
雪印メグミルク	35,100	2,435.00	85,468,500
プリマハム	22,800	2,786.00	63,520,800
日本ハム	55,700	4,255.00	237,003,500
林兼産業	4,800	545.00	2,616,000
丸大食品	15,500	1,833.00	28,411,500
S Foods	11,600	2,492.00	28,907,200
柿安本店	5,000	2,576.00	12,880,000
伊藤ハム米久ホールディングス	93,800	618.00	57,968,400
サッポロホールディングス	49,700	1,896.00	94,231,200
アサヒグループホールディングス	305,100	3,587.00	1,094,393,700
キリンホールディングス	617,900	2,086.50	1,289,248,350

宝ホールディングス	108,000	948.00	102,384,000
オエノンホールディングス	38,400	397.00	15,244,800
養命酒製造	4,500	1,781.00	8,014,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	102,300	1,837.00	187,925,100
サントリー食品インターナショナル	97,500	4,315.00	420,712,500
ダイドグループホールディングス	7,500	4,730.00	35,475,000
伊藤園	44,200	6,180.00	273,156,000
キーコーヒー	14,300	2,146.00	30,687,800
ユニカフェ	3,700	981.00	3,629,700
ジャパンフーズ	2,100	1,180.00	2,478,000
日清オイリオグループ	18,700	3,285.00	61,429,500
不二製油グループ本社	35,500	2,786.00	98,903,000
かどや製油	1,600	3,670.00	5,872,000
J - オイルミルズ	7,600	3,925.00	29,830,000
キッコーマン	104,900	4,850.00	508,765,000
味の素	321,800	1,721.50	553,978,700
キューピー	81,100	1,882.00	152,630,200
ハウス食品グループ本社	54,500	3,280.00	178,760,000
カゴメ	55,300	3,170.00	175,301,000
焼津水産化学工業	7,100	841.00	5,971,100
アリアケジャパン	13,300	6,570.00	87,381,000
ピエトロ	1,900	1,620.00	3,078,000
エバラ食品工業	3,500	2,100.00	7,350,000
やまみ	1,300	2,190.00	2,847,000
ニチレイ	69,400	3,040.00	210,976,000
東洋水産	75,000	6,130.00	459,750,000
イトアンド	5,000	1,702.00	8,510,000
大冷	1,900	2,004.00	3,807,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	1,181.00	9,566,100
日清食品ホールディングス	61,900	9,510.00	588,669,000
永谷園ホールディングス	7,100	2,100.00	14,910,000
一正蒲鉾	5,700	935.00	5,329,500
フジッコ	15,800	1,953.00	30,857,400
ロック・フィールド	15,700	1,252.00	19,656,400
日本たばこ産業	841,300	1,930.00	1,623,709,000
ケンコーマヨネーズ	8,200	1,830.00	15,006,000
わらべや日洋ホールディングス	9,500	1,514.00	14,383,000
なとり	8,100	1,739.00	14,085,900
イフジ産業	2,500	792.00	1,980,000
ピクルスコーポレーション	3,200	2,765.00	8,848,000
北の達人コーポレーション	50,900	536.00	27,282,400
ユーグレナ	62,800	736.00	46,220,800

ミヨシ油脂	5,600	1,040.00	5,824,000
理研ビタミン	13,800	2,169.00	29,932,200
片倉工業	21,100	1,046.00	22,070,600
ゲンゼ	10,500	4,000.00	42,000,000
東洋紡	56,500	1,433.00	80,964,500
ユニチカ	43,000	332.00	14,276,000
富士紡ホールディングス	7,000	3,055.00	21,385,000
倉敷紡績	14,300	2,018.00	28,857,400
シキボウ	7,500	1,003.00	7,522,500
日本毛織	47,200	987.00	46,586,400
トーア紡コーポレーション	5,600	455.00	2,548,000
帝国繊維	16,200	2,150.00	34,830,000
帝人	116,300	1,650.00	191,895,000
東レ	1,030,300	484.20	498,871,260
サカイオーベックス	4,000	2,145.00	8,580,000
住江織物	3,100	1,978.00	6,131,800
日本フェルト	9,100	440.00	4,004,000
イチカワ	2,400	1,123.00	2,695,200
日東製網	1,600	1,377.00	2,203,200
アツギ	11,900	595.00	7,080,500
ダイニック	5,400	707.00	3,817,800
セーレン	35,300	1,252.00	44,195,600
ソトー	5,800	947.00	5,492,600
東海染工	2,100	1,120.00	2,352,000
小松マテーレ	23,500	690.00	16,215,000
ワコールホールディングス	35,500	1,882.00	66,811,000
ホギメディカル	16,200	3,065.00	49,653,000
クラウディアホールディングス	3,700	326.00	1,206,200
T S Iホールディングス	48,000	336.00	16,128,000
マツオカコーポレーション	4,100	1,682.00	6,896,200
ワールド	20,200	1,420.00	28,684,000
三陽商会	7,400	577.00	4,269,800
ナイガイ	5,500	349.00	1,919,500
オンワードホールディングス	85,800	284.00	24,367,200
ルックホールディングス	5,000	685.00	3,425,000
ゴールドウイン	25,800	6,500.00	167,700,000
デサント	27,800	1,538.00	42,756,400
キング	7,000	463.00	3,241,000
ヤマトインターナショナル	12,800	360.00	4,608,000
特種東海製紙	9,000	4,470.00	40,230,000
王子ホールディングス	594,300	465.00	276,349,500
日本製紙	62,900	1,407.00	88,500,300

三菱製紙	16,100	331.00	5,329,100
北越コーポレーション	84,800	354.00	30,019,200
中越パルプ工業	6,000	1,438.00	8,628,000
巴川製紙所	4,200	926.00	3,889,200
大王製紙	62,700	1,436.00	90,037,200
阿波製紙	3,700	482.00	1,783,400
レンゴー	134,400	816.00	109,670,400
トモク	8,700	1,732.00	15,068,400
ザ・パック	10,800	2,816.00	30,412,800
クラレ	223,900	1,080.00	241,812,000
旭化成	942,300	823.60	776,078,280
共和レザー	7,700	609.00	4,689,300
昭和電工	101,200	2,271.00	229,825,200
住友化学	1,044,500	312.00	325,884,000
住友精化	6,300	3,495.00	22,018,500
日産化学	79,000	5,510.00	435,290,000
ラサ工業	5,000	1,422.00	7,110,000
クレハ	12,200	4,410.00	53,802,000
多木化学	5,500	7,030.00	38,665,000
テイカ	10,400	1,288.00	13,395,200
石原産業	25,500	672.00	17,136,000
片倉コープアグリ	3,700	1,198.00	4,432,600
日本曹達	21,000	2,724.00	57,204,000
東ソー	219,800	1,427.00	313,654,600
トクヤマ	41,000	2,369.00	97,129,000
セントラル硝子	29,100	1,840.00	53,544,000
東亜合成	89,200	1,031.00	91,965,200
大阪ソーダ	14,500	2,317.00	33,596,500
関東電化工業	33,700	821.00	27,667,700
デンカ	51,900	2,551.00	132,396,900
信越化学工業	244,100	12,410.00	3,029,281,000
日本カーバイド工業	4,900	1,152.00	5,644,800
堺化学工業	9,200	1,946.00	17,903,200
第一稀元素化学工業	15,400	712.00	10,964,800
エア・ウォーター	132,200	1,454.00	192,218,800
大陽日酸	136,600	1,774.00	242,328,400
日本化学工業	4,400	2,089.00	9,191,600
東邦アセチレン	2,100	1,231.00	2,585,100
日本パーカライズिंग	71,700	1,063.00	76,217,100
高圧ガス工業	22,500	779.00	17,527,500
チタン工業	1,800	1,679.00	3,022,200
四国化成工業	21,900	1,004.00	21,987,600

戸田工業	3,300	1,669.00	5,507,700
ステラ ケミファ	7,700	2,301.00	17,717,700
保土谷化学工業	5,300	4,735.00	25,095,500
日本触媒	22,100	5,390.00	119,119,000
大日精化工業	12,600	2,206.00	27,795,600
カネカ	36,800	2,574.00	94,723,200
三菱瓦斯化学	132,300	1,603.00	212,076,900
三井化学	129,100	2,167.00	279,759,700
J S R	132,500	2,110.00	279,575,000
東京応化工業	24,400	5,650.00	137,860,000
大阪有機化学工業	13,100	2,832.00	37,099,200
三菱ケミカルホールディングス	950,400	607.30	577,177,920
K Hネオケム	25,100	2,030.00	50,953,000
ダイセル	185,100	764.00	141,416,400
住友ベークライト	22,300	2,724.00	60,745,200
積水化学工業	300,700	1,466.00	440,826,200
日本ゼオン	128,200	947.00	121,405,400
アイカ工業	42,600	3,505.00	149,313,000
宇部興産	71,800	1,757.00	126,152,600
積水樹脂	25,600	2,089.00	53,478,400
タキロンシーアイ	30,800	679.00	20,913,200
旭有機材	8,000	1,346.00	10,768,000
ニチバン	7,500	1,496.00	11,220,000
リケンテクノス	35,800	390.00	13,962,000
大倉工業	6,700	1,452.00	9,728,400
積水化成品工業	19,100	527.00	10,065,700
群栄化学工業	3,200	2,552.00	8,166,400
タイガースポリマー	7,500	452.00	3,390,000
ミライアル	5,000	982.00	4,910,000
ダイキアクシス	5,000	722.00	3,610,000
ダイキョーニシカワ	30,000	443.00	13,290,000
竹本容器	5,100	668.00	3,406,800
森六ホールディングス	7,600	1,564.00	11,886,400
日本化薬	88,000	1,047.00	92,136,000
カーリットホールディングス	15,200	481.00	7,311,200
日本精化	11,400	1,385.00	15,789,000
扶桑化学工業	14,400	3,900.00	56,160,000
トリケミカル研究所	3,200	11,770.00	37,664,000
A D E K A	65,400	1,399.00	91,494,600
日油	53,500	3,855.00	206,242,500
新日本理化	23,500	156.00	3,666,000
ハリマ化成グループ	11,800	870.00	10,266,000

花王	347,600	8,409.00	2,922,968,400
第一工業製薬	5,300	4,960.00	26,288,000
石原ケミカル	3,900	1,931.00	7,530,900
日華化学	4,800	800.00	3,840,000
ニイタカ	2,900	4,940.00	14,326,000
三洋化成工業	8,500	4,545.00	38,632,500
有機合成薬品工業	10,900	326.00	3,553,400
大日本塗料	16,100	865.00	13,926,500
日本ペイントホールディングス	117,300	7,740.00	907,902,000
関西ペイント	159,700	2,154.00	343,993,800
神東塗料	11,200	169.00	1,892,800
中国塗料	40,500	800.00	32,400,000
日本特殊塗料	10,600	943.00	9,995,800
藤倉化成	19,200	495.00	9,504,000
太陽ホールディングス	10,400	5,050.00	52,520,000
D I C	60,000	2,644.00	158,640,000
サカタインクス	31,000	1,011.00	31,341,000
東洋インキS Cホールディングス	30,100	1,997.00	60,109,700
T & K T O K A	11,000	796.00	8,756,000
富士フィルムホールディングス	278,300	4,639.00	1,291,033,700
資生堂	288,400	6,712.00	1,935,740,800
ライオン	188,700	2,645.00	499,111,500
高砂香料工業	9,100	2,070.00	18,837,000
マンダム	32,600	1,896.00	61,809,600
ミルボン	19,400	4,840.00	93,896,000
ファンケル	58,700	3,065.00	179,915,500
コーセー	27,300	12,020.00	328,146,000
コタ	8,400	1,160.00	9,744,000
シーボン	1,900	1,901.00	3,611,900
ポーラ・オルビスホールディングス	62,000	1,782.00	110,484,000
ノエビアホールディングス	12,300	4,435.00	54,550,500
アジュバンコスメジャパン	3,200	942.00	3,014,400
エステー	9,300	1,652.00	15,363,600
アグロ カネショウ	6,000	1,251.00	7,506,000
コニシ	23,900	1,395.00	33,340,500
長谷川香料	25,000	2,314.00	57,850,000
星光P M C	8,300	686.00	5,693,800
小林製薬	40,700	9,410.00	382,987,000
荒川化学工業	13,000	1,139.00	14,807,000
メック	10,000	2,018.00	20,180,000
日本高純度化学	4,000	2,476.00	9,904,000
タカラバイオ	38,000	3,010.00	114,380,000

J C U	17,600	3,170.00	55,792,000
新田ゼラチン	9,100	632.00	5,751,200
O A Tアグリオ	2,500	1,078.00	2,695,000
デクセリアルズ	37,500	807.00	30,262,500
アース製薬	10,900	7,240.00	78,916,000
北興化学工業	14,900	551.00	8,209,900
大成ラミック	4,800	2,638.00	12,662,400
クミアイ化学工業	60,000	984.00	59,040,000
日本農薬	25,900	500.00	12,950,000
アキレス	10,000	1,913.00	19,130,000
有沢製作所	23,000	803.00	18,469,000
日東電工	100,200	5,850.00	586,170,000
レック	15,500	1,415.00	21,932,500
三光合成	16,600	250.00	4,150,000
きもと	24,700	166.00	4,100,200
藤森工業	13,000	3,475.00	45,175,000
前澤化成工業	9,200	960.00	8,832,000
未来工業	7,800	1,867.00	14,562,600
ウェーブロックホールディングス	5,000	849.00	4,245,000
J S P	8,500	1,384.00	11,764,000
エフピコ	16,000	8,670.00	138,720,000
天馬	9,700	1,581.00	15,335,700
信越ポリマー	26,100	865.00	22,576,500
東リ	36,100	242.00	8,736,200
ニフコ	53,300	2,200.00	117,260,000
バルカー	11,800	1,813.00	21,393,400
ユニ・チャーム	279,800	4,873.00	1,363,465,400
ショーエイコーポレーション	2,200	867.00	1,907,400
協和キリン	146,000	2,680.00	391,280,000
武田薬品工業	1,207,800	3,670.00	4,432,626,000
アステラス製薬	1,258,600	1,713.50	2,156,611,100
大日本住友製薬	107,600	1,347.00	144,937,200
塩野義製薬	182,600	6,134.00	1,120,068,400
わかもと製薬	17,300	265.00	4,584,500
あすか製薬	16,500	1,153.00	19,024,500
日本新薬	38,000	7,850.00	298,300,000
ビオフェルミン製薬	2,500	2,219.00	5,547,500
中外製薬	454,000	5,398.00	2,450,692,000
科研製薬	24,800	5,120.00	126,976,000
エーザイ	173,800	8,723.00	1,516,057,400
ロート製薬	74,500	3,430.00	255,535,000
小野薬品工業	333,400	2,910.00	970,194,000

久光製薬	38,400	4,960.00	190,464,000
持田製薬	20,100	3,815.00	76,681,500
参天製薬	270,500	1,857.00	502,318,500
扶桑薬品工業	5,100	2,210.00	11,271,000
日本ケミファ	1,900	2,410.00	4,579,000
ツムラ	45,000	2,758.00	124,110,000
日医工	41,100	1,212.00	49,813,200
キッセイ薬品工業	25,700	2,318.00	59,572,600
生化学工業	28,200	1,030.00	29,046,000
栄研化学	25,500	1,594.00	40,647,000
日水製薬	6,100	1,090.00	6,649,000
鳥居薬品	9,100	3,100.00	28,210,000
JCRファーマ	10,200	10,380.00	105,876,000
東和薬品	18,600	1,872.00	34,819,200
富士製薬工業	9,900	1,123.00	11,117,700
沢井製薬	29,800	5,140.00	153,172,000
ゼリア新薬工業	26,300	1,872.00	49,233,600
第一三共	415,400	8,459.00	3,513,868,600
キョーリン製薬ホールディングス	32,000	2,056.00	65,792,000
大幸薬品	17,700	2,202.00	38,975,400
ダイト	8,900	3,800.00	33,820,000
大塚ホールディングス	276,600	4,446.00	1,229,763,600
大正製薬ホールディングス	30,700	6,150.00	188,805,000
ペプチドリーム	73,800	4,640.00	342,432,000
日本コークス工業	122,600	62.00	7,601,200
ニチレキ	17,100	1,581.00	27,035,100
ユシロ化学工業	8,100	1,257.00	10,181,700
ビーピー・カストロール	5,200	1,056.00	5,491,200
富士石油	38,800	154.00	5,975,200
MORESCO	5,200	964.00	5,012,800
出光興産	161,100	2,248.00	362,152,800
ENEOSホールディングス	2,183,800	374.80	818,488,240
コスモエネルギーホールディングス	42,000	1,479.00	62,118,000
横浜ゴム	84,100	1,452.00	122,113,200
TOYO TIRE	83,300	1,384.00	115,287,200
ブリヂストン	418,200	3,390.00	1,417,698,000
住友ゴム工業	130,400	964.00	125,705,600
藤倉コンポジット	12,700	354.00	4,495,800
オカモト	8,800	3,805.00	33,484,000
フコク	6,300	649.00	4,088,700
ニッタ	16,400	2,288.00	37,523,200
住友理工	28,100	565.00	15,876,500

三ツ星ベルト	19,100	1,617.00	30,884,700
バンドー化学	25,500	603.00	15,376,500
日東紡績	21,600	5,020.00	108,432,000
A G C	143,500	2,976.00	427,056,000
日本板硝子	69,400	360.00	24,984,000
石塚硝子	2,700	1,758.00	4,746,600
日本山村硝子	6,100	841.00	5,130,100
日本電気硝子	58,300	1,629.00	94,970,700
オハラ	5,800	1,041.00	6,037,800
住友大阪セメント	27,500	3,555.00	97,762,500
太平洋セメント	91,700	2,283.00	209,351,100
日本ヒューム	14,600	751.00	10,964,600
日本コンクリート工業	31,400	260.00	8,164,000
三谷セキサン	6,800	4,810.00	32,708,000
アジアパイルホールディングス	20,700	450.00	9,315,000
東海カーボン	152,100	970.00	147,537,000
日本カーボン	7,500	3,420.00	25,650,000
東洋炭素	8,500	1,654.00	14,059,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	3,175.00	25,400,000
T O T O	103,700	4,155.00	430,873,500
日本碍子	174,300	1,382.00	240,882,600
日本特殊陶業	110,400	1,424.00	157,209,600
M A R U W A	5,600	7,930.00	44,408,000
品川リフラクトリーズ	3,800	2,089.00	7,938,200
黒崎播磨	2,900	3,505.00	10,164,500
ヨータイ	11,600	705.00	8,178,000
イソライト工業	7,500	401.00	3,007,500
東京窯業	18,600	278.00	5,170,800
ニッカトー	6,600	645.00	4,257,000
フジミインコーポレーテッド	12,900	3,415.00	44,053,500
クニミネ工業	5,900	890.00	5,251,000
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,032.00	2,580,000
ニチアス	39,700	2,253.00	89,444,100
ニチハ	20,200	2,221.00	44,864,200
日本製鉄	642,500	980.30	629,842,750
神戸製鋼所	262,900	353.00	92,803,700
中山製鋼所	20,100	341.00	6,854,100
合同製鐵	7,800	1,749.00	13,642,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	387,800	750.00	290,850,000
東京製鐵	70,000	608.00	42,560,000
共英製鋼	16,200	1,248.00	20,217,600
大和工業	30,500	2,049.00	62,494,500

東京鐵鋼	6,000	1,450.00	8,700,000
大阪製鐵	7,700	1,203.00	9,263,100
淀川製鋼所	19,400	1,760.00	34,144,000
丸一鋼管	46,600	2,591.00	120,740,600
モリ工業	4,300	2,112.00	9,081,600
大同特殊鋼	23,500	3,255.00	76,492,500
日本高周波鋼業	5,500	333.00	1,831,500
日本冶金工業	11,900	1,486.00	17,683,400
山陽特殊製鋼	9,900	833.00	8,246,700
愛知製鋼	8,100	2,942.00	23,830,200
日立金属	154,700	1,275.00	197,242,500
日本金属	3,300	590.00	1,947,000
大平洋金属	9,700	1,506.00	14,608,200
新日本電工	92,900	160.00	14,864,000
栗本鐵工所	7,100	1,584.00	11,246,400
虹技	2,200	1,161.00	2,554,200
三菱製鋼	10,700	605.00	6,473,500
日亜鋼業	21,200	267.00	5,660,400
日本精線	2,400	3,245.00	7,788,000
エンビプロ・ホールディングス	6,200	517.00	3,205,400
シンニッタン	22,600	209.00	4,723,400
新家工業	3,300	1,152.00	3,801,600
大紀アルミニウム工業所	23,900	513.00	12,260,700
日本軽金属ホールディングス	364,000	182.00	66,248,000
三井金属鉱業	38,800	2,245.00	87,106,000
東邦亜鉛	7,400	1,478.00	10,937,200
三菱マテリアル	94,900	2,228.00	211,437,200
住友金属鉱山	183,500	3,157.00	579,309,500
D O W A ホールディングス	36,400	3,245.00	118,118,000
古河機械金属	25,700	1,051.00	27,010,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	887.00	13,393,700
東邦チタニウム	25,900	624.00	16,161,600
U A C J	21,900	1,824.00	39,945,600
C K サンエツ	3,000	2,889.00	8,667,000
古河電気工業	44,600	2,550.00	113,730,000
住友電気工業	536,800	1,215.00	652,212,000
フジクラ	173,300	304.00	52,683,200
昭和電線ホールディングス	16,700	1,104.00	18,436,800
東京特殊電線	2,200	2,111.00	4,644,200
タツタ電線	28,700	518.00	14,866,600
カナレ電気	2,500	1,621.00	4,052,500
平河ヒューテック	7,300	983.00	7,175,900

リヨービ	17,800	1,068.00	19,010,400
アーレスティ	19,200	326.00	6,259,200
アサヒホールディングス	25,200	2,797.00	70,484,400
稲葉製作所	8,100	1,400.00	11,340,000
宮地エンジニアリンググループ	4,400	1,616.00	7,110,400
トーカロ	39,900	1,116.00	44,528,400
アルファC o	5,100	900.00	4,590,000
SUMCO	170,600	1,620.00	276,372,000
川田テクノロジーズ	2,900	4,650.00	13,485,000
RS Technologies	4,100	4,070.00	16,687,000
信和	8,300	691.00	5,735,300
東洋製罐グループホールディングス	91,400	1,134.00	103,647,600
ホッカンホールディングス	7,900	1,665.00	13,153,500
コロナ	7,900	1,008.00	7,963,200
横河ブリッジホールディングス	26,700	2,124.00	56,710,800
駒井ハルテック	2,700	1,401.00	3,782,700
高田機工	1,300	2,373.00	3,084,900
三和ホールディングス	135,300	890.00	120,417,000
文化シャッター	42,300	724.00	30,625,200
三協立山	18,500	877.00	16,224,500
アルインコ	10,400	898.00	9,339,200
東洋シャッター	3,500	647.00	2,264,500
LIXILグループ	211,800	1,471.00	311,557,800
日本フィルコン	11,000	455.00	5,005,000
ノーリツ	29,800	1,289.00	38,412,200
長府製作所	14,600	2,055.00	30,003,000
リンナイ	27,900	8,760.00	244,404,000
ダイニチ工業	7,700	683.00	5,259,100
日東精工	19,800	422.00	8,355,600
三洋工業	1,900	1,937.00	3,680,300
岡部	29,100	782.00	22,756,200
ジーテクト	17,800	937.00	16,678,600
東プレ	26,800	1,091.00	29,238,800
高周波熱錬	27,600	475.00	13,110,000
東京製綱	10,300	542.00	5,582,600
サンコール	10,700	400.00	4,280,000
モリテック スチール	11,200	264.00	2,956,800
パイオラックス	21,200	1,490.00	31,588,000
エイチワン	14,100	510.00	7,191,000
日本発條	154,000	636.00	97,944,000
中央発條	1,700	2,621.00	4,455,700
アドバネクス	2,100	1,385.00	2,908,500

立川ブラインド工業	6,300	1,146.00	7,219,800
三益半導体工業	11,200	2,367.00	26,510,400
日本ドライケミカル	3,600	1,639.00	5,900,400
日本製鋼所	43,600	1,477.00	64,397,200
三浦工業	62,100	4,250.00	263,925,000
タクマ	48,700	1,446.00	70,420,200
ツガミ	29,900	906.00	27,089,400
オークマ	16,800	4,445.00	74,676,000
芝浦機械	16,300	2,065.00	33,659,500
アマダ	178,200	790.00	140,778,000
アイダエンジニアリング	37,700	714.00	26,917,800
滝澤鉄工所	4,500	980.00	4,410,000
F U J I	61,800	1,822.00	112,599,600
牧野フライス製作所	16,900	3,145.00	53,150,500
オーエスジー	66,400	1,574.00	104,513,600
ダイジェット工業	1,700	1,322.00	2,247,400
旭ダイヤモンド工業	37,900	449.00	17,017,100
D M G 森精機	90,900	1,245.00	113,170,500
ソディック	33,800	792.00	26,769,600
ディスコ	19,500	27,640.00	538,980,000
日東工器	7,900	1,798.00	14,204,200
日進工具	5,700	2,455.00	13,993,500
パンチ工業	13,100	404.00	5,292,400
富士ダイス	6,400	660.00	4,224,000
豊和工業	8,100	736.00	5,961,600
O K K	5,900	363.00	2,141,700
東洋機械金属	10,400	385.00	4,004,000
津田駒工業	2,900	873.00	2,531,700
エンシュウ	3,600	877.00	3,157,200
島精機製作所	22,700	1,314.00	29,827,800
オプトラン	16,000	2,465.00	39,440,000
N C ホールディングス	4,400	545.00	2,398,000
イワキポンプ	9,200	917.00	8,436,400
フリー	14,100	944.00	13,310,400
ヤマシンフィルタ	31,200	990.00	30,888,000
日阪製作所	17,800	724.00	12,887,200
やまびこ	27,900	907.00	25,305,300
平田機工	6,800	5,830.00	39,644,000
ペガサスミシン製造	14,700	302.00	4,439,400
マルマエ	5,300	1,168.00	6,190,400
タツモ	6,700	1,770.00	11,859,000
ナブテスコ	84,600	3,320.00	280,872,000

三井海洋開発	15,300	1,448.00	22,154,400
レオン自動機	14,100	1,205.00	16,990,500
S M C	45,500	55,700.00	2,534,350,000
ホソカワミクロン	5,100	5,290.00	26,979,000
ユニオンツール	5,400	2,543.00	13,732,200
オイレス工業	18,600	1,354.00	25,184,400
日精エー・エス・ビー機械	4,200	3,000.00	12,600,000
サトーホールディングス	20,500	2,393.00	49,056,500
技研製作所	12,600	4,770.00	60,102,000
日本エアージェット	5,200	1,151.00	5,985,200
カワタ	4,300	718.00	3,087,400
日精樹脂工業	12,200	782.00	9,540,400
オカダアイヨン	4,600	916.00	4,213,600
ワイエイシイホールディングス	6,200	657.00	4,073,400
小松製作所	657,600	2,160.00	1,420,416,000
住友重機械工業	83,100	2,178.00	180,991,800
日立建機	58,200	3,000.00	174,600,000
日工	20,000	596.00	11,920,000
巴工業	6,200	1,790.00	11,098,000
井関農機	14,600	1,076.00	15,709,600
T O W A	14,700	1,396.00	20,521,200
丸山製作所	3,100	1,118.00	3,465,800
北川鉄工所	6,600	1,477.00	9,748,200
ローツェ	6,400	6,020.00	38,528,000
タカキタ	5,200	585.00	3,042,000
クボタ	770,200	1,518.00	1,169,163,600
荏原実業	3,700	2,746.00	10,160,200
三菱化工機	5,100	1,806.00	9,210,600
月島機械	26,800	1,103.00	29,560,400
帝国電機製作所	12,000	1,191.00	14,292,000
新東工業	34,600	733.00	25,361,800
澁谷工業	12,700	2,810.00	35,687,000
アイチ コーポレーション	25,200	740.00	18,648,000
小森コーポレーション	37,000	665.00	24,605,000
鶴見製作所	11,200	1,721.00	19,275,200
住友精密工業	2,200	2,081.00	4,578,200
日本ギア工業	6,000	275.00	1,650,000
酒井重工業	2,800	2,036.00	5,700,800
荏原製作所	60,100	2,493.00	149,829,300
石井鐵工所	1,900	2,430.00	4,617,000
西島製作所	14,800	835.00	12,358,000
北越工業	15,000	1,030.00	15,450,000

ダイキン工業	184,900	18,415.00	3,404,933,500
オルガノ	5,200	5,440.00	28,288,000
トーヨーカネツ	6,400	2,000.00	12,800,000
栗田工業	78,600	2,943.00	231,319,800
椿本チエイン	20,800	2,493.00	51,854,400
大同工業	7,100	617.00	4,380,700
木村化工機	12,400	402.00	4,984,800
アネスト岩田	22,600	798.00	18,034,800
ダイフク	74,200	10,030.00	744,226,000
サムコ	3,700	3,170.00	11,729,000
加藤製作所	8,000	1,157.00	9,256,000
油研工業	2,500	1,503.00	3,757,500
タダノ	70,200	854.00	59,950,800
フジテック	52,800	1,860.00	98,208,000
C K D	39,800	2,121.00	84,415,800
キトー	11,000	1,179.00	12,969,000
平和	40,500	1,762.00	71,361,000
理想科学工業	12,900	1,255.00	16,189,500
S A N K Y O	32,300	2,635.00	85,110,500
日本金銭機械	16,100	534.00	8,597,400
マースグループホールディングス	9,300	1,594.00	14,824,200
フクシマガリレイ	9,000	3,290.00	29,610,000
オーイズミ	6,200	372.00	2,306,400
ダイコク電機	6,700	1,180.00	7,906,000
竹内製作所	24,300	1,795.00	43,618,500
アマノ	38,000	2,212.00	84,056,000
J U K I	20,200	505.00	10,201,000
蛇の目マシン工業	13,300	415.00	5,519,500
マックス	22,200	1,488.00	33,033,600
グローリー	37,300	2,430.00	90,639,000
新晃工業	13,500	1,401.00	18,913,500
大和冷機工業	21,000	935.00	19,635,000
セガサミーホールディングス	144,000	1,281.00	184,464,000
日本ピストンリング	5,300	1,146.00	6,073,800
リケン	6,700	2,666.00	17,862,200
T P R	19,600	1,397.00	27,381,200
ツバキ・ナカシマ	29,700	772.00	22,928,400
ホシザキ	42,400	8,680.00	368,032,000
大豊工業	11,900	505.00	6,009,500
日本精工	273,400	744.00	203,409,600
N T N	336,200	198.00	66,567,600
ジェイテクト	139,300	761.00	106,007,300

不二越	13,500	3,245.00	43,807,500
日本トムソン	43,200	321.00	13,867,200
THK	84,500	2,678.00	226,291,000
ユーシン精機	11,300	676.00	7,638,800
前澤給装工業	5,300	2,026.00	10,737,800
イーグル工業	18,000	672.00	12,096,000
前澤工業	9,800	379.00	3,714,200
日本ピラー工業	14,700	1,362.00	20,021,400
キッツ	58,900	655.00	38,579,500
マキタ	189,300	3,915.00	741,109,500
日立造船	115,400	367.00	42,351,800
三菱重工業	243,300	2,538.00	617,495,400
IHI	104,700	1,492.00	156,212,400
スター精密	22,400	1,252.00	28,044,800
日清紡ホールディングス	96,900	734.00	71,124,600
イビデン	89,100	3,130.00	278,883,000
コニカミノルタ	318,700	360.00	114,732,000
ブラザー工業	177,600	1,833.00	325,540,800
ミネベアミツミ	269,800	1,836.00	495,352,800
日立製作所	697,500	3,342.00	2,331,045,000
三菱電機	1,451,700	1,376.50	1,998,265,050
富士電機	87,500	2,781.00	243,337,500
東洋電機製造	5,400	1,137.00	6,139,800
安川電機	156,300	4,110.00	642,393,000
シンフォニアテクノロジー	18,900	1,004.00	18,975,600
明電舎	26,800	1,553.00	41,620,400
オリジン	4,000	1,270.00	5,080,000
山洋電気	7,100	4,620.00	32,802,000
デンヨー	12,400	1,960.00	24,304,000
東芝テック	18,200	4,205.00	76,531,000
芝浦メカトロニクス	2,800	2,726.00	7,632,800
マブチモーター	40,300	3,220.00	129,766,000
日本電産	349,400	6,985.00	2,440,559,000
トレックス・セミコンダクター	8,800	1,196.00	10,524,800
東光高岳	8,600	969.00	8,333,400
ダイヘン	15,900	3,975.00	63,202,500
ヤーマン	24,300	936.00	22,744,800
JVCケンウッド	122,000	151.00	18,422,000
ミマキエンジニアリング	14,500	377.00	5,466,500
第一精工	6,200	1,962.00	12,164,400
日新電機	34,100	997.00	33,997,700
大崎電気工業	29,100	508.00	14,782,800

オムロン	130,200	7,250.00	943,950,000
日東工業	21,400	1,742.00	37,278,800
I D E C	21,000	1,589.00	33,369,000
正興電機製作所	4,000	922.00	3,688,000
不二電機工業	2,800	1,328.00	3,718,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,800	1,762.00	85,985,600
サクサホールディングス	3,500	1,512.00	5,292,000
メルコホールディングス	5,200	3,225.00	16,770,000
テクノメディカ	3,600	1,700.00	6,120,000
日本電気	176,100	5,550.00	977,355,000
富士通	139,900	12,960.00	1,813,104,000
沖電気工業	59,100	1,015.00	59,986,500
岩崎通信機	6,400	817.00	5,228,800
電気興業	7,000	2,422.00	16,954,000
サンケン電気	15,900	1,980.00	31,482,000
ナカヨ	2,900	1,360.00	3,944,000
アイホン	8,300	1,411.00	11,711,300
ルネサスエレクトロニクス	696,600	592.00	412,387,200
セイコーエプソン	180,200	1,173.00	211,374,600
ワコム	98,700	571.00	56,357,700
アルバック	26,700	3,245.00	86,641,500
アクセル	6,800	754.00	5,127,200
E I Z O	11,300	4,020.00	45,426,000
日本信号	37,100	1,059.00	39,288,900
京三製作所	34,200	550.00	18,810,000
能美防災	19,500	2,009.00	39,175,500
ホーチキ	11,000	1,190.00	13,090,000
星和電機	8,100	595.00	4,819,500
エレコム	16,300	5,430.00	88,509,000
パナソニック	1,658,700	954.90	1,583,892,630
シャープ	168,100	1,122.00	188,608,200
アンリツ	93,500	2,488.00	232,628,000
富士通ゼネラル	39,500	2,400.00	94,800,000
ソニー	909,400	7,780.00	7,075,132,000
T D K	70,100	10,480.00	734,648,000
帝国通信工業	6,900	1,142.00	7,879,800
タムラ製作所	48,800	428.00	20,886,400
アルプスアルパイン	128,900	1,313.00	169,245,700
池上通信機	4,600	851.00	3,914,600
鈴木	8,000	652.00	5,216,000
日本トリム	2,100	3,200.00	6,720,000
ローランド ディー . ジー .	8,500	1,125.00	9,562,500

フォスター電機	15,300	1,079.00	16,508,700
S M K	3,800	2,420.00	9,196,000
ヨコオ	9,600	2,573.00	24,700,800
ホシデン	40,300	909.00	36,632,700
ヒロセ電機	22,500	11,630.00	261,675,000
日本航空電子工業	33,400	1,392.00	46,492,800
T O A	15,700	721.00	11,319,700
マクセルホールディングス	31,900	912.00	29,092,800
古野電気	19,300	937.00	18,084,100
ユニデンホールディングス	4,100	1,702.00	6,978,200
スミダコーポレーション	11,900	689.00	8,199,100
アイコム	8,100	2,970.00	24,057,000
リオン	6,400	2,071.00	13,254,400
本多通信工業	13,800	393.00	5,423,400
横河電機	133,200	1,598.00	212,853,600
新電元工業	5,200	2,023.00	10,519,600
アズビル	91,700	3,360.00	308,112,000
東亜ディーケーケー	7,900	846.00	6,683,400
日本光電工業	60,200	3,515.00	211,603,000
チノー	5,100	1,375.00	7,012,500
共和電業	15,500	397.00	6,153,500
日本電子材料	5,800	1,464.00	8,491,200
堀場製作所	28,800	5,730.00	165,024,000
アドバンテスト	108,000	6,960.00	751,680,000
小野測器	7,200	474.00	3,412,800
エスペック	13,200	1,823.00	24,063,600
キーエンス	131,500	44,840.00	5,896,460,000
日置電機	7,800	2,991.00	23,329,800
シスメックス	103,800	7,924.00	822,511,200
日本マイクロニクス	25,700	1,170.00	30,069,000
メガチップス	13,800	2,047.00	28,248,600
O B A R A G R O U P	8,600	3,330.00	28,638,000
澤藤電機	2,100	1,551.00	3,257,100
原田工業	7,500	882.00	6,615,000
コーセル	20,000	838.00	16,760,000
イリソ電子工業	12,400	3,130.00	38,812,000
オブテックスグループ	24,300	1,163.00	28,260,900
千代田インテグレ	7,100	1,558.00	11,061,800
アイ・オー・データ機器	5,300	992.00	5,257,600
レーザーテック	63,800	11,510.00	734,338,000
スタンレー電気	102,000	2,529.00	257,958,000
岩崎電気	6,000	1,816.00	10,896,000

ウシオ電機	80,600	1,317.00	106,150,200	
岡谷電機産業	13,300	292.00	3,883,600	
ハリオス テクノ ホールディング	15,200	302.00	4,590,400	
エノモト	4,900	1,008.00	4,939,200	
日本セラミック	15,000	2,115.00	31,725,000	
遠藤照明	8,300	602.00	4,996,600	
古河電池	10,800	1,122.00	12,117,600	
双信電機	8,500	394.00	3,349,000	
山一電機	10,900	1,346.00	14,671,400	
図研	9,600	3,070.00	29,472,000	
日本電子	28,800	3,020.00	86,976,000	
カシオ計算機	128,500	1,859.00	238,881,500	
ファナック	136,500	19,725.00	2,692,462,500	
日本シイエムケイ	35,500	387.00	13,738,500	
エンプラス	7,600	2,227.00	16,925,200	
大真空	5,600	2,372.00	13,283,200	
ローム	64,500	7,030.00	453,435,000	
浜松ホトニクス	104,200	4,800.00	500,160,000	
三井ハイテック	16,400	1,715.00	28,126,000	
新光電気工業	49,100	1,655.00	81,260,500	
京セラ	204,300	5,637.00	1,151,639,100	
太陽誘電	64,700	3,310.00	214,157,000	
村田製作所	426,500	6,480.00	2,763,720,000	
双葉電子工業	23,600	957.00	22,585,200	
北陸電気工業	6,500	816.00	5,304,000	
ニチコン	50,000	689.00	34,450,000	
日本ケミコン	11,000	1,856.00	20,416,000	
K O A	22,500	924.00	20,790,000	
市光工業	22,900	466.00	10,671,400	
小糸製作所	87,100	4,240.00	369,304,000	
ミツバ	28,200	377.00	10,631,400	
S C R E E Nホールディングス	25,200	5,270.00	132,804,000	
キャノン電子	15,600	1,562.00	24,367,200	
キャノン	781,500	2,007.00	1,568,470,500	
リコー	369,500	766.00	283,037,000	
象印マホービン	43,000	1,310.00	56,330,000	
M U T O Hホールディングス	2,200	1,500.00	3,300,000	
東京エレクトロン	92,100	29,610.00	2,727,081,000	
トヨタ紡織	42,300	1,356.00	57,358,800	
芦森工業	3,100	973.00	3,016,300	
ユニプレス	28,200	840.00	23,688,000	
豊田自動織機	117,500	5,460.00	641,550,000	

モリタホールディングス	25,400	1,731.00	43,967,400
三櫻工業	18,500	619.00	11,451,500
デンソー	319,600	4,071.00	1,301,091,600
東海理化電機製作所	38,300	1,443.00	55,266,900
三井E & Sホールディングス	52,400	409.00	21,431,600
川崎重工業	113,000	1,487.00	168,031,000
名村造船所	46,700	148.00	6,911,600
日本車輛製造	5,300	2,313.00	12,258,900
三菱ロジスネクスト	19,200	864.00	16,588,800
近畿車輛	2,200	1,160.00	2,552,000
日産自動車	1,712,000	374.80	641,657,600
いすゞ自動車	420,600	915.40	385,017,240
トヨタ自動車	1,619,700	6,568.00	10,638,189,600
日野自動車	181,300	687.00	124,553,100
三菱自動車工業	537,300	258.00	138,623,400
エフテック	10,300	465.00	4,789,500
レシップホールディングス	5,700	527.00	3,003,900
G M B	2,700	552.00	1,490,400
ファルテック	2,600	635.00	1,651,000
武蔵精密工業	32,400	856.00	27,734,400
日産車体	28,300	861.00	24,366,300
新明和工業	39,100	992.00	38,787,200
極東開発工業	27,000	1,252.00	33,804,000
日信工業	29,500	2,201.00	64,929,500
トピー工業	12,000	1,129.00	13,548,000
ティラド	5,300	1,235.00	6,545,500
曙ブレーキ工業	79,700	163.00	12,991,100
タチエス	23,900	828.00	19,789,200
N O K	78,100	1,262.00	98,562,200
フタバ産業	40,500	415.00	16,807,500
K Y B	16,200	1,901.00	30,796,200
大同メタル工業	28,000	520.00	14,560,000
プレス工業	72,200	272.00	19,638,400
ミクニ	18,700	248.00	4,637,600
太平洋工業	30,500	850.00	25,925,000
ケーヒン	33,400	2,544.00	84,969,600
河西工業	19,800	405.00	8,019,000
アイシン精機	119,500	3,000.00	358,500,000
マツダ	427,100	628.00	268,218,800
今仙電機製作所	13,600	666.00	9,057,600
本田技研工業	1,142,900	2,636.50	3,013,255,850
スズキ	287,700	3,652.00	1,050,680,400

S U B A R U	450,700	2,129.50	959,765,650	
安永	7,100	962.00	6,830,200	
ヤマハ発動機	189,300	1,625.00	307,612,500	
ショーワ	34,300	2,245.00	77,003,500	
T B K	17,400	421.00	7,325,400	
エクセディ	19,800	1,449.00	28,690,200	
豊田合成	46,900	2,102.00	98,583,800	
愛三工業	22,900	482.00	11,037,800	
盟和産業	2,300	841.00	1,934,300	
日本プラスト	11,500	407.00	4,680,500	
ヨロズ	13,600	1,004.00	13,654,400	
エフ・シー・シー	23,800	1,742.00	41,459,600	
シマノ	54,300	20,980.00	1,139,214,000	
テイ・エス テック	33,700	2,763.00	93,113,100	
ジャムコ	7,400	694.00	5,135,600	
テルモ	410,800	3,899.00	1,601,709,200	
クリエートメディック	4,800	950.00	4,560,000	
日機装	43,600	925.00	40,330,000	
日本エム・ディ・エム	8,400	1,494.00	12,549,600	
島津製作所	173,500	2,876.00	498,986,000	
J M S	12,300	757.00	9,311,100	
長野計器	10,500	980.00	10,290,000	
ブイ・テクノロジー	6,800	3,700.00	25,160,000	
東京計器	9,300	905.00	8,416,500	
愛知時計電機	1,900	4,415.00	8,388,500	
インターアクション	7,800	1,844.00	14,383,200	
オーバル	13,200	210.00	2,772,000	
東京精密	26,300	3,410.00	89,683,000	
マニー	57,800	2,836.00	163,920,800	
ニコン	221,700	834.00	184,897,800	
トプコン	73,100	806.00	58,918,600	
オリンパス	803,200	1,978.00	1,588,729,600	
理研計器	12,800	2,339.00	29,939,200	
タムロン	11,700	1,720.00	20,124,000	
H O Y A	288,000	10,735.00	3,091,680,000	
シード	6,200	694.00	4,302,800	
ノーリツ鋼機	9,800	1,488.00	14,582,400	
エー・アンド・デイ	13,300	652.00	8,671,600	
朝日インテック	164,400	3,000.00	493,200,000	
シチズン時計	170,100	317.00	53,921,700	
リズム時計工業	4,600	588.00	2,704,800	
大研医器	10,100	551.00	5,565,100	

メニコン	20,600	5,240.00	107,944,000
シンシア	1,700	370.00	629,000
松風	6,600	1,386.00	9,147,600
セイコーホールディングス	20,600	1,571.00	32,362,600
ニプロ	100,500	1,131.00	113,665,500
中本パックス	3,700	1,438.00	5,320,600
スノーピーク	7,700	1,234.00	9,501,800
パラマウントベッドホールディングス	15,300	4,355.00	66,631,500
トランザクション	7,900	1,153.00	9,108,700
粧美堂	4,200	341.00	1,432,200
ニホンフラッシュ	13,600	1,365.00	18,564,000
前田工織	16,000	2,432.00	38,912,000
永大産業	19,000	270.00	5,130,000
アートネイチャー	15,500	597.00	9,253,500
バンダイナムコホールディングス	150,100	5,762.00	864,876,200
アイフィスジャパン	3,700	696.00	2,575,200
共立印刷	24,200	131.00	3,170,200
SHOEI	12,700	2,603.00	33,058,100
フランスベッドホールディングス	20,500	801.00	16,420,500
パイロットコーポレーション	23,700	3,250.00	77,025,000
萩原工業	8,100	1,419.00	11,493,900
トッパン・フォームズ	31,100	1,034.00	32,157,400
フジシールインターナショナル	32,500	1,927.00	62,627,500
タカラトミー	65,100	819.00	53,316,900
廣済堂	10,100	771.00	7,787,100
エステールホールディングス	3,900	618.00	2,410,200
アーク	55,400	110.00	6,094,000
タカノ	5,700	661.00	3,767,700
プロネクサス	12,500	1,151.00	14,387,500
ホクシン	9,000	116.00	1,044,000
ウッドワン	4,900	1,082.00	5,301,800
大建工業	9,800	1,721.00	16,865,800
凸版印刷	204,900	1,693.00	346,895,700
大日本印刷	190,000	2,417.00	459,230,000
共同印刷	4,500	2,645.00	11,902,500
NISSHA	29,800	953.00	28,399,400
光村印刷	1,300	1,486.00	1,931,800
TAKARA & COMPANY	7,000	2,111.00	14,777,000
アシックス	119,800	1,195.00	143,161,000
ツツミ	4,500	1,812.00	8,154,000
小松ウオール工業	4,400	1,740.00	7,656,000
ヤマハ	86,300	4,710.00	406,473,000

河合楽器製作所	4,500	2,600.00	11,700,000
クリナップ	13,500	545.00	7,357,500
ピジョン	87,700	4,395.00	385,441,500
オリバー	3,100	2,348.00	7,278,800
兼松サステック	900	1,472.00	1,324,800
キングジム	12,100	800.00	9,680,000
リンテック	34,500	2,534.00	87,423,000
イトーキ	30,900	316.00	9,764,400
任天堂	89,000	48,680.00	4,332,520,000
三菱鉛筆	23,900	1,212.00	28,966,800
タカラスタANDARD	30,000	1,492.00	44,760,000
コクヨ	69,600	1,200.00	83,520,000
ナカバヤシ	14,300	550.00	7,865,000
グローブライド	6,500	1,987.00	12,915,500
オカムラ	50,700	719.00	36,453,300
美津濃	13,200	1,932.00	25,502,400
東京電力ホールディングス	1,158,800	305.00	353,434,000
中部電力	444,100	1,334.50	592,651,450
関西電力	550,000	1,060.00	583,000,000
中国電力	209,400	1,400.00	293,160,000
北陸電力	132,700	655.00	86,918,500
東北電力	362,600	1,009.00	365,863,400
四国電力	130,700	775.00	101,292,500
九州電力	299,200	893.00	267,185,600
北海道電力	135,800	398.00	54,048,400
沖縄電力	28,200	1,745.00	49,209,000
電源開発	115,500	1,759.00	203,164,500
エフオン	7,800	587.00	4,578,600
イーレックス	20,700	1,401.00	29,000,700
レノバ	24,200	1,020.00	24,684,000
東京瓦斯	279,200	2,568.50	717,125,200
大阪瓦斯	281,700	2,112.00	594,950,400
東邦瓦斯	71,400	5,360.00	382,704,000
北海道瓦斯	7,800	1,552.00	12,105,600
広島ガス	29,900	351.00	10,494,900
西部瓦斯	16,300	2,492.00	40,619,600
静岡ガス	41,200	876.00	36,091,200
メタウォーター	7,000	4,690.00	32,830,000
SBSホールディングス	12,500	2,207.00	27,587,500
東武鉄道	151,300	3,380.00	511,394,000
相鉄ホールディングス	46,400	2,721.00	126,254,400
東急	366,100	1,382.00	505,950,200

京浜急行電鉄	186,400	1,550.00	288,920,000
小田急電鉄	215,900	2,570.00	554,863,000
京王電鉄	75,300	5,830.00	438,999,000
京成電鉄	101,000	3,115.00	314,615,000
富士急行	19,800	3,190.00	63,162,000
新京成電鉄	3,700	2,130.00	7,881,000
東日本旅客鉄道	255,500	7,116.00	1,818,138,000
西日本旅客鉄道	129,300	5,389.00	696,797,700
東海旅客鉄道	120,700	15,055.00	1,817,138,500
西武ホールディングス	189,500	1,135.00	215,082,500
鴻池運輸	23,100	1,043.00	24,093,300
西日本鉄道	40,200	2,829.00	113,725,800
ハマキョウレックス	11,100	3,100.00	34,410,000
サカイ引越センター	7,600	5,010.00	38,076,000
近鉄グループホールディングス	137,500	4,555.00	626,312,500
阪急阪神ホールディングス	183,400	3,415.00	626,311,000
南海電気鉄道	65,200	2,351.00	153,285,200
京阪ホールディングス	61,200	4,585.00	280,602,000
神戸電鉄	3,300	3,510.00	11,583,000
名古屋鉄道	113,000	2,924.00	330,412,000
山陽電気鉄道	9,800	2,130.00	20,874,000
日本通運	47,600	5,600.00	266,560,000
ヤマトホールディングス	241,000	2,679.00	645,639,000
山九	38,200	3,890.00	148,598,000
丸運	7,800	215.00	1,677,000
丸全昭和運輸	11,100	2,953.00	32,778,300
センコーグループホールディングス	75,800	801.00	60,715,800
トナミホールディングス	3,300	5,400.00	17,820,000
ニッコンホールディングス	49,200	2,023.00	99,531,600
日本石油輸送	1,500	3,165.00	4,747,500
福山通運	17,600	3,645.00	64,152,000
セイノーホールディングス	103,000	1,374.00	141,522,000
エスライン	4,100	901.00	3,694,100
神奈川中央交通	3,400	3,930.00	13,362,000
日立物流	25,200	2,847.00	71,744,400
丸和運輸機関	14,500	3,300.00	47,850,000
C & F ロジホールディングス	13,900	1,476.00	20,516,400
九州旅客鉄道	120,500	2,525.00	304,262,500
S Gホールディングス	144,300	3,705.00	534,631,500
日本郵船	115,600	1,466.00	169,469,600
商船三井	87,500	1,911.00	167,212,500
川崎汽船	42,300	1,030.00	43,569,000

N Sユニテッド海運	8,200	1,403.00	11,504,600
飯野海運	67,800	331.00	22,441,800
共栄タンカー	3,600	765.00	2,754,000
乾汽船	7,900	821.00	6,485,900
日本航空	243,100	1,907.00	463,591,700
A N Aホールディングス	251,300	2,347.50	589,926,750
パスコ	2,700	1,403.00	3,788,100
ランコム	3,800	6,950.00	26,410,000
日新	11,900	1,415.00	16,838,500
三菱倉庫	43,600	2,694.00	117,458,400
三井倉庫ホールディングス	15,700	1,479.00	23,220,300
住友倉庫	49,400	1,221.00	60,317,400
澁澤倉庫	7,500	1,915.00	14,362,500
東陽倉庫	24,800	300.00	7,440,000
日本トランスシティ	30,300	439.00	13,301,700
ケイヒン	2,700	1,217.00	3,285,900
中央倉庫	8,400	945.00	7,938,000
川西倉庫	2,500	977.00	2,442,500
安田倉庫	11,300	847.00	9,571,100
ファイズホールディングス	2,900	1,035.00	3,001,500
東洋埠頭	4,200	1,363.00	5,724,600
宇徳	11,700	450.00	5,265,000
上組	76,700	2,016.00	154,627,200
サンリツ	3,200	575.00	1,840,000
キムラユニティー	3,700	990.00	3,663,000
キューソー流通システム	3,400	1,430.00	4,862,000
近鉄エクスプレス	29,200	1,874.00	54,720,800
東海運	7,800	265.00	2,067,000
エーアイティー	9,700	721.00	6,993,700
内外トランスライン	4,800	975.00	4,680,000
日本コンセプト	4,400	1,203.00	5,293,200
N E C ネットエスアイ	40,500	2,211.00	89,545,500
クロスキャット	4,000	1,119.00	4,476,000
システナ	51,100	1,366.00	69,802,600
デジタルアーツ	7,000	8,660.00	60,620,000
日鉄ソリューションズ	21,500	2,839.00	61,038,500
キューブシステム	7,900	935.00	7,386,500
エイジア	2,800	1,360.00	3,808,000
コア	6,300	1,153.00	7,263,900
ラクーンホールディングス	6,800	1,004.00	6,827,200
ソリトンシステムズ	6,500	1,417.00	9,210,500
ソフトクリエイティブホールディングス	6,400	2,131.00	13,638,400

T I S	142,600	2,250.00	320,850,000
ネオス	5,700	677.00	3,858,900
電算システム	5,500	4,455.00	24,502,500
グリー	88,100	466.00	41,054,600
コーエーテクモホールディングス	29,200	3,465.00	101,178,000
三菱総合研究所	6,200	4,195.00	26,009,000
電算	1,700	2,125.00	3,612,500
A G S	8,500	763.00	6,485,500
ファインデックス	12,400	915.00	11,346,000
ブレインパッド	3,700	4,230.00	15,651,000
K L a b	27,600	709.00	19,568,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,600	823.00	14,484,800
イーブুকイニシアティブジャパン	2,200	3,075.00	6,765,000
ネクソン	397,900	2,593.00	1,031,754,700
アイスタイル	41,200	281.00	11,577,200
エムアップホールディングス	4,300	2,390.00	10,277,000
エイチーム	10,200	846.00	8,629,200
エニグモ	13,700	1,262.00	17,289,400
テクノスジャパン	11,500	748.00	8,602,000
コロプラ	47,100	1,039.00	48,936,900
ブロードリーフ	71,300	543.00	38,715,900
クロス・マーケティンググループ	7,300	331.00	2,416,300
デジタルハーツホールディングス	7,900	852.00	6,730,800
システム情報	10,900	1,400.00	15,260,000
メディアドゥ	4,600	4,550.00	20,930,000
じげん	36,300	312.00	11,325,600
エンカレッジ・テクノロジー	3,500	820.00	2,870,000
サイバーリンクス	2,400	2,117.00	5,080,800
フィックスターズ	15,400	1,191.00	18,341,400
C A R T A H O L D I N G S	7,200	1,233.00	8,877,600
オブティム	7,600	3,620.00	27,512,000
セレス	5,000	1,065.00	5,325,000
S H I F T	5,800	12,780.00	74,124,000
ティーガイア	12,800	1,952.00	24,985,600
セック	2,200	2,899.00	6,377,800
日本アジアグループ	15,000	282.00	4,230,000
テクマトリックス	20,300	1,878.00	38,123,400
プロシップ	4,400	1,382.00	6,080,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,500	1,987.00	68,551,500
G M O ペイメントゲートウェイ	30,200	11,790.00	356,058,000
ザッパラス	7,100	373.00	2,648,300
システムリサーチ	3,900	1,886.00	7,355,400

インターネットイニシアティブ	21,200	3,600.00	76,320,000
さくらインターネット	15,800	606.00	9,574,800
ヴィンクス	4,300	1,314.00	5,650,200
GMOクラウド	2,700	8,090.00	21,843,000
SRAホールディングス	7,700	2,301.00	17,717,700
システムインテグレータ	4,800	1,028.00	4,934,400
朝日ネット	10,400	1,119.00	11,637,600
eBASE	17,300	1,326.00	22,939,800
アバント	13,900	982.00	13,649,800
アドソル日進	5,200	2,294.00	11,928,800
フリービット	7,900	720.00	5,688,000
コムチュア	16,100	2,704.00	43,534,400
サイバーコム	2,700	1,770.00	4,779,000
アステリア	9,400	503.00	4,728,200
アイル	8,100	1,577.00	12,773,700
マークラインズ	7,300	2,228.00	16,264,400
メディカル・データ・ビジョン	11,100	1,231.00	13,664,100
ショーケース	3,900	668.00	2,605,200
モバイルファクトリー	3,500	992.00	3,472,000
テラスカイ	5,300	2,829.00	14,993,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,306.00	7,705,400
PCIホールディングス	5,700	1,093.00	6,230,100
パイプドHD	2,100	1,428.00	2,998,800
アイビーシー	2,700	935.00	2,524,500
ネオジャパン	2,800	2,306.00	6,456,800
PR TIMES	1,300	2,804.00	3,645,200
ランドコンピュータ	2,500	964.00	2,410,000
ダブルスタンダード	1,900	5,370.00	10,203,000
オープンドア	7,300	1,263.00	9,219,900
マイネット	4,600	1,140.00	5,244,000
アカツキ	5,100	3,790.00	19,329,000
ベネフィットジャパン	1,300	1,504.00	1,955,200
Ubicomホールディングス	3,300	2,066.00	6,817,800
LINE	32,700	5,500.00	179,850,000
カナミックネットワーク	13,400	927.00	12,421,800
ノムラシステムコーポレーション	7,300	390.00	2,847,000
チェンジ	5,000	8,140.00	40,700,000
シンクロ・フード	7,200	309.00	2,224,800
オークネット	9,100	1,011.00	9,200,100
セグエグループ	3,500	841.00	2,943,500
エイトレッド	2,500	1,885.00	4,712,500
AOI TYO Holdings	15,300	384.00	5,875,200

マクロミル	29,600	709.00	20,986,400
ビーグリー	3,000	1,854.00	5,562,000
オロ	3,900	2,735.00	10,666,500
ユーザーローカル	1,500	3,785.00	5,677,500
テモナ	3,400	952.00	3,236,800
ニーズウェル	3,200	705.00	2,256,000
サインポスト	3,200	1,534.00	4,908,800
ソルクシーズ	6,500	678.00	4,407,000
フェイス	5,500	621.00	3,415,500
プロトコーポレーション	13,100	942.00	12,340,200
ハイマックス	1,900	1,927.00	3,661,300
野村総合研究所	202,000	2,897.00	585,194,000
サイバネットシステム	10,700	639.00	6,837,300
C Eホールディングス	8,200	516.00	4,231,200
日本システム技術	2,500	1,584.00	3,960,000
インテージホールディングス	18,200	868.00	15,797,600
東邦システムサイエンス	4,100	904.00	3,706,400
ソースネクスト	68,800	272.00	18,713,600
インフォコム	15,700	3,160.00	49,612,000
HEROZ	2,100	3,360.00	7,056,000
ラクスル	11,500	3,550.00	40,825,000
F I G	16,700	260.00	4,342,000
システムサポート	3,400	1,894.00	6,439,600
イーソル	7,100	1,072.00	7,611,200
アルテリア・ネットワークス	16,000	1,972.00	31,552,000
東海ソフト	1,200	1,431.00	1,717,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,006.00	2,816,800
トビラシステムズ	1,900	1,779.00	3,380,100
フォーカスシステムズ	9,200	800.00	7,360,000
クレスコ	8,900	1,294.00	11,516,600
フジ・メディア・ホールディングス	137,600	968.00	133,196,800
オービック	49,400	19,090.00	943,046,000
ジャストシステム	23,200	7,870.00	182,584,000
T D Cソフト	12,800	872.00	11,161,600
Zホールディングス	1,956,800	532.00	1,041,017,600
トレンドマイクロ	63,400	6,180.00	391,812,000
I Dホールディングス	5,700	1,325.00	7,552,500
日本オラクル	28,900	13,370.00	386,393,000
アルファシステムズ	4,500	3,785.00	17,032,500
フューチャー	17,400	1,674.00	29,127,600
C A C Holdings	9,600	1,154.00	11,078,400
S Bテクノロジー	5,200	3,600.00	18,720,000

トーセ	4,300	846.00	3,637,800
オービックビジネスコンサルタント	14,600	5,900.00	86,140,000
伊藤忠テクノソリューションズ	65,000	4,175.00	271,375,000
アイティフォー	17,700	720.00	12,744,000
東計電算	2,200	4,025.00	8,855,000
エクスネット	2,600	970.00	2,522,000
大塚商会	77,100	5,640.00	434,844,000
サイボウズ	16,800	3,490.00	58,632,000
ソフトブレーン	9,200	415.00	3,818,000
電通国際情報サービス	8,900	4,950.00	44,055,000
A C C E S S	13,700	926.00	12,686,200
デジタルガレージ	25,700	3,600.00	92,520,000
E Mシステムズ	20,400	910.00	18,564,000
ウェザーニューズ	4,900	3,400.00	16,660,000
C I J	10,100	779.00	7,867,900
ビジネスエンジニアリング	1,800	2,554.00	4,597,200
日本エンタープライズ	15,900	271.00	4,308,900
WOWOW	7,000	2,383.00	16,681,000
スカラ	10,000	626.00	6,260,000
インテリジェント ウェイブ	8,800	770.00	6,776,000
I M A G I C A G R O U P	13,000	361.00	4,693,000
ネットワンシステムズ	54,400	3,505.00	190,672,000
システムソフト	34,500	92.00	3,174,000
アルゴグラフィックス	12,200	3,315.00	40,443,000
マーベラス	22,300	695.00	15,498,500
エイベックス	24,900	880.00	21,912,000
日本ユニシス	44,600	3,255.00	145,173,000
兼松エレクトロニクス	7,800	3,975.00	31,005,000
東京放送ホールディングス	86,800	1,613.00	140,008,400
日本テレビホールディングス	119,200	1,143.00	136,245,600
朝日放送グループホールディングス	14,600	720.00	10,512,000
テレビ朝日ホールディングス	39,400	1,482.00	58,390,800
スカパーJ S A Tホールディングス	94,600	416.00	39,353,600
テレビ東京ホールディングス	11,800	2,290.00	27,022,000
日本BS放送	5,200	1,077.00	5,600,400
ビジョン	13,800	620.00	8,556,000
スマートバリュー	4,000	1,135.00	4,540,000
ワイヤレスゲート	7,200	717.00	5,162,400
コネクシオ	8,300	1,351.00	11,213,300
クロップス	3,100	710.00	2,201,000
日本電信電話	1,904,200	2,515.00	4,789,063,000
K D D I	1,038,600	3,265.00	3,391,029,000

ソフトバンク	1,294,800	1,393.50	1,804,303,800
光通信	14,700	22,560.00	331,632,000
NTTドコモ	1,018,700	2,935.50	2,990,393,850
エムティーアイ	14,200	811.00	11,516,200
GMOインターネット	56,300	2,992.00	168,449,600
ファイバーゲート	4,800	1,447.00	6,945,600
アйдママーケティングコミュニケーション	5,100	438.00	2,233,800
KADOKAWA	38,500	2,371.00	91,283,500
学研ホールディングス	19,400	1,396.00	27,082,400
ゼンリン	28,700	1,121.00	32,172,700
昭文社ホールディングス	7,400	427.00	3,159,800
インプレスホールディングス	11,800	144.00	1,699,200
アイネット	7,600	1,486.00	11,293,600
松竹	9,400	14,290.00	134,326,000
東宝	84,100	3,540.00	297,714,000
東映	5,300	14,150.00	74,995,000
エヌ・ティ・ティ・データ	379,600	1,191.00	452,103,600
ピー・シー・エー	2,500	4,070.00	10,175,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,142.00	5,938,400
DTS	32,000	2,181.00	69,792,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,800	5,520.00	335,616,000
シーイーシー	15,500	1,577.00	24,443,500
カブコン	67,200	4,125.00	277,200,000
アイ・エス・ビー	2,900	2,082.00	6,037,800
ジャステック	9,300	1,223.00	11,373,900
SCSK	32,900	5,140.00	169,106,000
日本システムウエア	4,900	1,892.00	9,270,800
アイネス	14,300	1,349.00	19,290,700
TKC	12,100	5,840.00	70,664,000
富士ソフト	18,300	4,425.00	80,977,500
NSD	46,000	1,882.00	86,572,000
コナミホールディングス	51,800	3,270.00	169,386,000
福井コンピュータホールディングス	5,700	2,568.00	14,637,600
JBCホールディングス	9,900	1,434.00	14,196,600
ミロク情報サービス	12,700	2,160.00	27,432,000
ソフトバンクグループ	1,130,300	6,267.00	7,083,590,100
ハウスイ	1,200	896.00	1,075,200
高千穂交易	5,500	889.00	4,889,500
カワニシホールディングス	1,700	1,274.00	2,165,800
伊藤忠食品	3,500	4,805.00	16,817,500
エレマテック	13,400	791.00	10,599,400
JALUX	4,000	1,650.00	6,600,000

あらた	11,400	4,555.00	51,927,000
トーメンデバイス	2,200	3,615.00	7,953,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	3,685.00	19,162,000
フィールズ	10,900	341.00	3,716,900
双日	789,600	229.00	180,818,400
アルフレッサ ホールディングス	158,900	2,177.00	345,925,300
横浜冷凍	37,400	858.00	32,089,200
ラサ商事	7,600	908.00	6,900,800
アルコニックス	15,200	1,216.00	18,483,200
神戸物産	49,300	6,520.00	321,436,000
ハイパー	2,200	555.00	1,221,000
あい ホールディングス	20,400	1,479.00	30,171,600
ディーブイエックス	5,100	861.00	4,391,100
ダイワボウホールディングス	12,200	7,170.00	87,474,000
マクニカ・富士エレホールディングス	34,100	1,477.00	50,365,700
ラクト・ジャパン	5,300	3,430.00	18,179,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,900	1,011.00	27,195,900
八洲電機	11,100	900.00	9,990,000
メディアスホールディングス	8,100	872.00	7,063,200
レスターホールディングス	14,900	1,995.00	29,725,500
ジューテックホールディングス	3,300	999.00	3,296,700
大光	6,100	640.00	3,904,000
OCHIホールディングス	4,200	1,443.00	6,060,600
TOKAIホールディングス	75,600	978.00	73,936,800
黒谷	3,900	521.00	2,031,900
Cominix	2,500	706.00	1,765,000
三洋貿易	14,400	954.00	13,737,600
ビューティガレージ	2,300	1,990.00	4,577,000
ウイン・パートナーズ	10,300	896.00	9,228,800
ミタチ産業	4,300	560.00	2,408,000
シップヘルスケアホールディングス	22,900	4,545.00	104,080,500
明治電機工業	4,500	1,361.00	6,124,500
デリカフーズホールディングス	5,100	608.00	3,100,800
スターティアホールディングス	3,300	580.00	1,914,000
コメダホールディングス	31,200	1,763.00	55,005,600
ピーバンドットコム	1,400	910.00	1,274,000
アセンテック	1,500	3,920.00	5,880,000
富士興産	4,400	405.00	1,782,000
協栄産業	1,600	1,155.00	1,848,000
小野建	12,800	1,159.00	14,835,200
南陽	3,100	1,487.00	4,609,700
佐島電機	9,700	772.00	7,488,400

エコトレーディング	3,300	519.00	1,712,700	
伯東	8,700	915.00	7,960,500	
コンドーテック	11,100	1,089.00	12,087,900	
中山福	8,300	407.00	3,378,100	
ナガイレーベン	19,000	2,643.00	50,217,000	
三菱食品	15,700	2,707.00	42,499,900	
松田産業	10,400	1,330.00	13,832,000	
第一興商	21,300	3,050.00	64,965,000	
メディカルホールディングス	154,300	1,977.00	305,051,100	
S P K	6,100	1,212.00	7,393,200	
萩原電気ホールディングス	5,300	1,960.00	10,388,000	
アズワン	9,300	11,230.00	104,439,000	
スズデン	5,000	1,175.00	5,875,000	
尾家産業	4,200	1,200.00	5,040,000	
シモジマ	8,800	1,171.00	10,304,800	
ドウシシャ	13,500	1,601.00	21,613,500	
小津産業	3,200	1,745.00	5,584,000	
高速	8,500	1,377.00	11,704,500	
たけびし	5,000	1,387.00	6,935,000	
リックス	3,200	1,608.00	5,145,600	
丸文	12,700	517.00	6,565,900	
ハピネット	11,900	1,083.00	12,887,700	
橋本総業ホールディングス	2,900	1,990.00	5,771,000	
日本ライフライン	42,400	1,310.00	55,544,000	
タカショー	9,300	478.00	4,445,400	
マルカ	5,100	1,699.00	8,664,900	
I D O M	38,600	484.00	18,682,400	
進和	8,500	1,872.00	15,912,000	
エスケイジャパン	3,200	284.00	908,800	
ダイトロン	6,100	1,437.00	8,765,700	
シークス	18,200	893.00	16,252,600	
田中商事	4,400	687.00	3,022,800	
オーハシテクニカ	7,300	1,589.00	11,599,700	
白銅	5,100	1,354.00	6,905,400	
ダイコー通産	900	1,255.00	1,129,500	
伊藤忠商事	1,000,000	2,296.00	2,296,000,000	
丸紅	1,488,200	469.30	698,412,260	
高島	2,300	1,771.00	4,073,300	
長瀬産業	80,400	1,260.00	101,304,000	
蝶理	9,100	1,655.00	15,060,500	
豊田通商	159,600	2,663.00	425,014,800	
三共生興	21,700	414.00	8,983,800	

兼松	53,300	1,224.00	65,239,200
ツカモトコーポレーション	2,600	1,125.00	2,925,000
三井物産	1,237,900	1,560.00	1,931,124,000
日本紙パルプ商事	8,100	3,655.00	29,605,500
カメイ	18,700	952.00	17,802,400
東都水産	1,800	3,275.00	5,895,000
OUGホールディングス	2,300	2,571.00	5,913,300
スターゼン	5,300	3,990.00	21,147,000
山善	55,900	900.00	50,310,000
椿本興業	2,600	3,210.00	8,346,000
住友商事	902,100	1,205.00	1,087,030,500
内田洋行	5,600	6,200.00	34,720,000
三菱商事	937,400	2,241.50	2,101,182,100
第一実業	7,000	3,650.00	25,550,000
キャノンマーケティングジャパン	35,500	2,123.00	75,366,500
西華産業	8,100	1,148.00	9,298,800
佐藤商事	11,800	840.00	9,912,000
菱洋エレクトロ	14,500	3,175.00	46,037,500
東京産業	13,000	495.00	6,435,000
ユアサ商事	13,600	2,892.00	39,331,200
神鋼商事	3,600	1,805.00	6,498,000
トルク	8,600	266.00	2,287,600
阪和興業	26,700	1,895.00	50,596,500
正栄食品工業	9,300	3,815.00	35,479,500
カナデン	11,600	1,223.00	14,186,800
菱電商事	10,300	1,379.00	14,203,700
フルサト工業	7,900	1,302.00	10,285,800
岩谷産業	31,700	3,710.00	117,607,000
ナイス	6,100	828.00	5,050,800
昭光通商	4,600	578.00	2,658,800
ニチモウ	2,200	1,791.00	3,940,200
極東貿易	4,100	1,256.00	5,149,600
イワキ	18,800	512.00	9,625,600
三愛石油	35,200	858.00	30,201,600
稲畑産業	31,500	1,238.00	38,997,000
G S Iクレオス	3,500	1,160.00	4,060,000
明和産業	13,200	432.00	5,702,400
クワザワ	5,100	519.00	2,646,900
ヤマエ久野	10,400	1,224.00	12,729,600
ワキタ	30,500	901.00	27,480,500
東邦ホールディングス	45,900	1,867.00	85,695,300
サンゲツ	39,000	1,434.00	55,926,000

ミツウロコグループホールディングス	21,100	1,114.00	23,505,400
シナネンホールディングス	5,900	2,686.00	15,847,400
伊藤忠エネクス	31,600	841.00	26,575,600
サンリオ	40,200	1,562.00	62,792,400
サンワテクノス	10,200	829.00	8,455,800
リョーサン	15,800	2,107.00	33,290,600
新光商事	22,400	814.00	18,233,600
トーホー	6,500	1,807.00	11,745,500
三信電気	7,700	1,636.00	12,597,200
東陽テクニカ	15,300	931.00	14,244,300
モスフードサービス	18,800	2,680.00	50,384,000
加賀電子	14,200	1,933.00	27,448,600
ソーダニッカ	14,800	500.00	7,400,000
立花エレテック	10,600	1,662.00	17,617,200
フォーバル	6,300	994.00	6,262,200
PALTAC	22,900	4,910.00	112,439,000
三谷産業	18,900	332.00	6,274,800
西本Wismettacホールディングス	2,600	2,100.00	5,460,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,828.00	2,376,400
国際紙パルプ商事	33,900	266.00	9,017,400
ヤマタネ	7,200	1,153.00	8,301,600
丸紅建材リース	1,400	1,488.00	2,083,200
日鉄物産	10,200	3,290.00	33,558,000
泉州電業	4,400	2,554.00	11,237,600
トラスコ中山	29,800	2,650.00	78,970,000
オートバックスセブン	53,100	1,345.00	71,419,500
モリト	10,500	639.00	6,709,500
加藤産業	20,600	3,285.00	67,671,000
北恵	3,600	911.00	3,279,600
イノテック	7,400	951.00	7,037,400
イエローハット	27,000	1,446.00	39,042,000
JKホールディングス	12,900	749.00	9,662,100
日伝	12,900	2,054.00	26,496,600
北沢産業	10,800	278.00	3,002,400
杉本商事	7,700	1,723.00	13,267,100
因幡電機産業	40,700	2,431.00	98,941,700
東テク	4,700	2,176.00	10,227,200
ミスミグループ本社	179,200	2,642.00	473,446,400
アルテック	11,500	235.00	2,702,500
タキヒヨー	4,300	1,750.00	7,525,000
蔵王産業	2,800	1,400.00	3,920,000
スズケン	60,600	3,810.00	230,886,000

ジェコス	9,900	864.00	8,553,600
グローセル	14,400	413.00	5,947,200
ローソン	36,200	5,500.00	199,100,000
サンエー	11,900	4,000.00	47,600,000
カワチ薬品	11,200	2,850.00	31,920,000
エービーシー・マート	22,400	5,890.00	131,936,000
ハードオフコーポレーション	5,900	675.00	3,982,500
アスクル	15,000	3,475.00	52,125,000
ゲオホールディングス	25,900	1,405.00	36,389,500
アダストリア	19,900	1,493.00	29,710,700
ジーフット	8,600	479.00	4,119,400
くら寿司	7,500	4,600.00	34,500,000
キャンドウ	6,900	2,095.00	14,455,500
パルグループホールディングス	14,800	1,155.00	17,094,000
エディオン	65,800	1,033.00	67,971,400
サーラコーポレーション	29,400	556.00	16,346,400
ワッツ	6,500	1,050.00	6,825,000
ハローズ	5,400	3,295.00	17,793,000
フジオフードグループ本社	12,200	1,231.00	15,018,200
あみやき亭	3,200	2,803.00	8,969,600
ひらまつ	26,300	165.00	4,339,500
大黒天物産	3,500	5,930.00	20,755,000
ハニーズホールディングス	12,800	1,063.00	13,606,400
ファーマライズホールディングス	3,700	672.00	2,486,400
アルペン	11,100	1,643.00	18,237,300
ハブ	4,400	577.00	2,538,800
クオールホールディングス	21,200	1,100.00	23,320,000
ジーンズホールディングス	7,600	7,390.00	56,164,000
ビックカメラ	85,000	1,148.00	97,580,000
DCMホールディングス	79,400	1,271.00	100,917,400
Monotaro	101,700	4,540.00	461,718,000
東京一番フーズ	4,000	499.00	1,996,000
DDホールディングス	5,600	728.00	4,076,800
きちりホールディングス	4,100	545.00	2,234,500
アーランドサービスホールディングス	10,500	1,843.00	19,351,500
J.フロント リテイリング	171,000	658.00	112,518,000
ドトール・日レスホールディングス	20,700	1,666.00	34,486,200
マツモトキヨシホールディングス	59,100	3,880.00	229,308,000
broncoビリー	7,600	2,218.00	16,856,800
Zozo	98,400	2,584.00	254,265,600
トレジャー・ファクトリー	4,400	755.00	3,322,000
物語コーポレーション	3,800	7,630.00	28,994,000

ココカラファイン	15,000	5,980.00	89,700,000
三越伊勢丹ホールディングス	250,300	574.00	143,672,200
H a m e e	5,200	1,882.00	9,786,400
ウエルシアホールディングス	42,500	8,800.00	374,000,000
クリエイティブSDホールディングス	24,200	3,320.00	80,344,000
丸善CHIホールディングス	16,700	390.00	6,513,000
ティーライフ	2,300	1,100.00	2,530,000
チムニー	4,500	1,206.00	5,427,000
シュッピン	10,000	693.00	6,930,000
オイシックス・ラ・大地	14,200	2,040.00	28,968,000
ネクステージ	20,700	959.00	19,851,300
ジョイフル本田	42,000	1,429.00	60,018,000
鳥貴族	4,300	1,407.00	6,050,100
キリン堂ホールディングス	5,700	2,541.00	14,483,700
ホットランド	9,700	1,034.00	10,029,800
すかいらーくホールディングス	160,300	1,605.00	257,281,500
SFPホールディングス	8,300	1,364.00	11,321,200
綿半ホールディングス	5,500	1,858.00	10,219,000
ヨシックス	2,400	1,778.00	4,267,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,700	1,221.00	50,915,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	507.00	3,549,000
B E E N O S	6,800	1,116.00	7,588,800
あさひ	10,800	1,536.00	16,588,800
日本調剤	8,800	1,673.00	14,722,400
コスモス薬品	12,600	17,000.00	214,200,000
トーエル	7,200	650.00	4,680,000
オンリー	2,800	566.00	1,584,800
セブン&アイ・ホールディングス	559,400	3,304.00	1,848,257,600
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	77,100	601.00	46,337,100
ツルハホールディングス	31,100	14,570.00	453,127,000
サンマルクホールディングス	11,400	1,530.00	17,442,000
フェリシモ	3,300	1,051.00	3,468,300
トリドールホールディングス	35,500	1,127.00	40,008,500
T O K Y O B A S E	13,500	329.00	4,441,500
ウイルプラスホールディングス	2,100	585.00	1,228,500
J Mホールディングス	10,900	3,385.00	36,896,500
サツドラホールディングス	2,200	1,977.00	4,349,400
アレンザホールディングス	7,300	1,091.00	7,964,300
串カツ田中ホールディングス	3,100	1,577.00	4,888,700
パロックジャパンリミテッド	10,200	645.00	6,579,000
クスリのアオキホールディングス	12,800	9,790.00	125,312,000

力の源ホールディングス	6,500	618.00	4,017,000
スシログローバルホールディングス	78,500	2,415.00	189,577,500
LIXILビバ	14,200	2,596.00	36,863,200
メディカルシステムネットワーク	14,200	466.00	6,617,200
はるやまホールディングス	7,000	689.00	4,823,000
ノジマ	25,500	2,617.00	66,733,500
カップ・クリエイト	20,000	1,344.00	26,880,000
ライトオン	10,700	585.00	6,259,500
良品計画	190,000	1,371.00	260,490,000
三城ホールディングス	15,800	253.00	3,997,400
アドヴァン	22,000	1,262.00	27,764,000
アルビス	5,500	2,224.00	12,232,000
コナカ	17,500	288.00	5,040,000
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,583.00	3,007,700
G-7ホールディングス	8,500	2,365.00	20,102,500
イオン北海道	19,000	760.00	14,440,000
コジマ	24,900	517.00	12,873,300
ヒマラヤ	5,200	807.00	4,196,400
コーナン商事	20,400	3,450.00	70,380,000
エコス	5,400	1,993.00	10,762,200
ワタミ	17,100	877.00	14,996,700
マルシェ	4,100	480.00	1,968,000
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	314,300	2,420.00	760,606,000
西松屋チェーン	31,500	1,072.00	33,768,000
ゼンショーホールディングス	68,600	2,027.00	139,052,200
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,468.00	13,358,800
ハークスレイ	3,200	1,013.00	3,241,600
サイゼリヤ	21,300	1,846.00	39,319,800
V Tホールディングス	59,800	341.00	20,391,800
魚力	4,100	1,570.00	6,437,000
フジ・コーポレーション	3,900	1,918.00	7,480,200
ユナイテッドアローズ	15,100	1,583.00	23,903,300
ハイデイ日高	20,800	1,531.00	31,844,800
京都きもの友禅	9,900	256.00	2,534,400
コロワイド	47,500	1,332.00	63,270,000
ピーシーデポコーポレーション	19,200	686.00	13,171,200
壱番屋	10,100	4,715.00	47,621,500
P L A N T	4,000	615.00	2,460,000
スギホールディングス	28,600	7,480.00	213,928,000
薬王堂ホールディングス	6,300	2,686.00	16,921,800
スクロール	22,400	427.00	9,564,800
ヨンドシーホールディングス	14,700	1,900.00	27,930,000

ファミリーマート	114,300	2,306.00	263,575,800
木曽路	18,800	2,266.00	42,600,800
S R S ホールディングス	17,100	819.00	14,004,900
タカキュー	11,000	125.00	1,375,000
リテールパートナーズ	19,000	1,856.00	35,264,000
ケーヨー	29,600	753.00	22,288,800
上新電機	16,900	1,995.00	33,715,500
日本瓦斯	22,600	4,750.00	107,350,000
ロイヤルホールディングス	25,000	1,636.00	40,900,000
いなげや	17,800	1,723.00	30,669,400
島忠	27,000	2,969.00	80,163,000
チヨダ	15,200	1,085.00	16,492,000
ライフコーポレーション	10,900	3,755.00	40,929,500
リンガーハット	17,700	2,176.00	38,515,200
MrMaxHD	20,000	615.00	12,300,000
テンアライド	13,200	360.00	4,752,000
AOKIホールディングス	28,900	567.00	16,386,300
オークワ	22,500	1,501.00	33,772,500
コメリ	22,100	2,740.00	60,554,000
青山商事	29,800	608.00	18,118,400
しまむら	16,700	7,230.00	120,741,000
はせがわ	8,200	300.00	2,460,000
高島屋	104,300	801.00	83,544,300
松屋	29,000	625.00	18,125,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,900	661.00	44,881,900
近鉄百貨店	5,500	2,801.00	15,405,500
丸井グループ	131,100	1,693.00	221,952,300
アクシアル リテイリング	11,900	4,425.00	52,657,500
イオン	550,200	2,386.50	1,313,052,300
イズミ	29,100	3,205.00	93,265,500
平和堂	29,100	1,885.00	54,853,500
フジ	17,300	1,771.00	30,638,300
ヤオコー	16,300	7,930.00	129,259,000
ゼビオホールディングス	17,500	774.00	13,545,000
ケースホールディングス	138,100	1,351.00	186,573,100
Olympicグループ	7,600	878.00	6,672,800
日産東京販売ホールディングス	21,800	241.00	5,253,800
シルバーライフ	2,000	1,995.00	3,990,000
一家ダイニングプロジェクト	1,500	550.00	825,000
Genky DrugStores	6,300	3,520.00	22,176,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,500	565.00	1,977,500
ブックオフグループホールディングス	8,300	759.00	6,299,700

アインホールディングス	17,600	6,810.00	119,856,000
元気寿司	3,700	2,163.00	8,003,100
ヤマダ電機	436,000	492.00	214,512,000
アークランドサカモト	22,500	1,841.00	41,422,500
ニトリホールディングス	61,900	21,920.00	1,356,848,000
グルメ杵屋	10,400	910.00	9,464,000
愛眼	11,400	217.00	2,473,800
ケーユーホールディングス	7,700	818.00	6,298,600
吉野家ホールディングス	47,100	2,003.00	94,341,300
松屋フーズホールディングス	6,900	3,460.00	23,874,000
サガミホールディングス	19,300	1,129.00	21,789,700
関西スーパーマーケット	12,100	1,066.00	12,898,600
王将フードサービス	10,500	5,620.00	59,010,000
プレナス	16,100	1,731.00	27,869,100
ミニストップ	10,700	1,492.00	15,964,400
アークス	29,300	2,476.00	72,546,800
パローホールディングス	31,700	2,153.00	68,250,100
ベルク	7,100	7,610.00	54,031,000
大庄	7,800	1,147.00	8,946,600
ファーストリテイリング	19,100	60,280.00	1,151,348,000
サンドラッグ	53,800	3,465.00	186,417,000
サクスパー ホールディングス	12,500	534.00	6,675,000
ヤマザワ	3,500	1,658.00	5,803,000
やまや	2,900	2,100.00	6,090,000
ベルーナ	31,000	635.00	19,685,000
島根銀行	3,800	522.00	1,983,600
じもとホールディングス	96,700	91.00	8,799,700
めぶきフィナンシャルグループ	743,900	245.00	182,255,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,300	1,088.00	20,998,400
九州フィナンシャルグループ	313,300	432.00	135,345,600
ゆうちょ銀行	405,600	803.00	325,696,800
富山第一銀行	34,100	252.00	8,593,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	817,700	335.00	273,929,500
西日本フィナンシャルホールディングス	95,300	671.00	63,946,300
関西みらいフィナンシャルグループ	84,000	385.00	32,340,000
三十三フィナンシャルグループ	13,300	1,280.00	17,024,000
第四北越フィナンシャルグループ	24,800	2,001.00	49,624,800
新生銀行	105,100	1,264.00	132,846,400
あおぞら銀行	85,300	1,824.00	155,587,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,794,000	410.00	4,015,540,000
りそなホールディングス	1,571,200	360.30	566,103,360
三井住友トラスト・ホールディングス	270,600	2,907.50	786,769,500

三井住友フィナンシャルグループ	990,200	2,980.00	2,950,796,000	
千葉銀行	477,800	504.00	240,811,200	
群馬銀行	275,000	321.00	88,275,000	
武蔵野銀行	21,300	1,463.00	31,161,900	
千葉興業銀行	39,300	215.00	8,449,500	
筑波銀行	59,500	161.00	9,579,500	
七十七銀行	48,400	1,484.00	71,825,600	
青森銀行	11,100	2,083.00	23,121,300	
秋田銀行	9,200	1,395.00	12,834,000	
山形銀行	16,100	1,189.00	19,142,900	
岩手銀行	9,400	2,384.00	22,409,600	
東邦銀行	128,000	216.00	27,648,000	
東北銀行	6,900	942.00	6,499,800	
みちのく銀行	9,200	1,003.00	9,227,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	120,600	1,629.00	196,457,400	
静岡銀行	348,700	682.00	237,813,400	
十六銀行	17,900	1,866.00	33,401,400	
スルガ銀行	146,500	355.00	52,007,500	
八十二銀行	345,500	392.00	135,436,000	
山梨中央銀行	16,600	813.00	13,495,800	
大垣共立銀行	28,300	2,107.00	59,628,100	
福井銀行	12,200	1,534.00	18,714,800	
北國銀行	14,300	2,811.00	40,197,300	
清水銀行	5,900	1,530.00	9,027,000	
富山銀行	2,800	2,195.00	6,146,000	
滋賀銀行	28,700	2,369.00	67,990,300	
南都銀行	23,800	1,973.00	46,957,400	
百五銀行	128,800	310.00	39,928,000	
京都銀行	51,300	3,800.00	194,940,000	
紀陽銀行	50,700	1,565.00	79,345,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	95,300	855.00	81,481,500	
広島銀行	211,300	488.00	103,114,400	
山陰合同銀行	84,900	505.00	42,874,500	
中国銀行	123,200	952.00	117,286,400	
鳥取銀行	4,900	1,106.00	5,419,400	
伊予銀行	204,300	652.00	133,203,600	
百十四銀行	15,200	1,752.00	26,630,400	
四国銀行	21,800	730.00	15,914,000	
阿波銀行	23,400	2,273.00	53,188,200	
大分銀行	8,200	2,282.00	18,712,400	
宮崎銀行	9,500	2,240.00	21,280,000	
佐賀銀行	8,700	1,149.00	9,996,300	

沖縄銀行	13,100	2,985.00	39,103,500
琉球銀行	33,000	930.00	30,690,000
セブン銀行	478,300	277.00	132,489,100
みずほフィナンシャルグループ	19,454,900	130.00	2,529,137,000
高知銀行	5,200	615.00	3,198,000
山口フィナンシャルグループ	178,700	620.00	110,794,000
長野銀行	4,700	1,043.00	4,902,100
名古屋銀行	10,700	2,296.00	24,567,200
北洋銀行	215,800	201.00	43,375,800
愛知銀行	5,200	2,650.00	13,780,000
中京銀行	5,900	2,001.00	11,805,900
大光銀行	4,900	1,356.00	6,644,400
愛媛銀行	20,000	1,148.00	22,960,000
トマト銀行	5,500	966.00	5,313,000
京葉銀行	61,000	486.00	29,646,000
栃木銀行	69,200	156.00	10,795,200
北日本銀行	4,500	1,695.00	7,627,500
東和銀行	25,100	656.00	16,465,600
福島銀行	13,500	154.00	2,079,000
大東銀行	7,400	610.00	4,514,000
トモニホールディングス	110,700	324.00	35,866,800
フィデアホールディングス	139,000	98.00	13,622,000
池田泉州ホールディングス	164,600	151.00	24,854,600
F P G	44,500	527.00	23,451,500
マーキュリアインベストメント	6,700	547.00	3,664,900
S B I ホールディングス	160,000	2,133.00	341,280,000
ジャフコ	22,100	3,610.00	79,781,000
大和証券グループ本社	1,149,200	464.20	533,458,640
野村ホールディングス	2,519,600	483.70	1,218,730,520
岡三証券グループ	122,600	317.00	38,864,200
丸三証券	43,000	393.00	16,899,000
東洋証券	52,700	109.00	5,744,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	165,200	230.00	37,996,000
光世証券	3,800	515.00	1,957,000
水戸証券	42,400	185.00	7,844,000
いちよし証券	27,200	417.00	11,342,400
松井証券	82,000	828.00	67,896,000
マネックスグループ	105,900	217.00	22,980,300
極東証券	19,600	485.00	9,506,000
岩井コスモホールディングス	13,700	1,075.00	14,727,500
藍澤証券	26,000	675.00	17,550,000
マネーパートナーズグループ	16,200	209.00	3,385,800

スパークス・グループ	67,000	203.00	13,601,000	
かんぽ生命保険	50,700	1,407.00	71,334,900	
S O M P Oホールディングス	269,200	3,641.00	980,157,200	
アニコム ホールディングス	11,800	4,475.00	52,805,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	374,300	2,859.50	1,070,310,850	
ソニーフィナンシャルホールディングス	118,400	2,597.00	307,484,800	
第一生命ホールディングス	810,200	1,278.50	1,035,840,700	
東京海上ホールディングス	506,200	4,663.00	2,360,410,600	
T & Dホールディングス	427,900	901.00	385,537,900	
アドバンスクリエイト	3,000	2,017.00	6,051,000	
全国保証	40,400	3,820.00	154,328,000	
イントラスト	5,100	700.00	3,570,000	
日本モーゲージサービス	2,900	2,024.00	5,869,600	
C a s a	5,000	1,058.00	5,290,000	
アルヒ	22,800	1,582.00	36,069,600	
プレミアグループ	7,800	1,810.00	14,118,000	
クレディセゾン	100,300	1,071.00	107,421,300	
芙蓉総合リース	15,000	5,610.00	84,150,000	
みずほリース	22,100	2,293.00	50,675,300	
東京センチュリー	28,800	5,220.00	150,336,000	
日本証券金融	63,200	485.00	30,652,000	
アイフル	218,600	214.00	46,780,400	
リコーリース	11,300	2,910.00	32,883,000	
イオンフィナンシャルサービス	87,700	889.00	77,965,300	
アコム	287,900	374.00	107,674,600	
ジャックス	15,800	1,603.00	25,327,400	
オリエントコーポレーション	387,700	107.00	41,483,900	
日立キャピタル	33,800	2,331.00	78,787,800	
アプラスフィナンシャル	69,100	65.00	4,491,500	
オリックス	888,300	1,278.00	1,135,247,400	
三菱U F Jリース	363,500	477.00	173,389,500	
九州リースサービス	7,100	523.00	3,713,300	
日本取引所グループ	411,000	2,540.00	1,043,940,000	
イー・ギャランティ	15,300	2,587.00	39,581,100	
アサックス	7,500	637.00	4,777,500	
N E Cキャピタルソリューション	5,800	1,876.00	10,880,800	
いちご	188,900	238.00	44,958,200	
日本駐車場開発	154,100	138.00	21,265,800	
スター・マイカ・ホールディングス	8,700	1,378.00	11,988,600	
A Dワークスグループ	26,600	160.00	4,256,000	
ヒューリック	307,500	940.00	289,050,000	
三栄建築設計	7,000	1,385.00	9,695,000	

野村不動産ホールディングス	87,900	1,825.00	160,417,500
三重交通グループホールディングス	32,800	439.00	14,399,200
サムティ	21,700	1,233.00	26,756,100
ディア・ライフ	23,800	472.00	11,233,600
日本商業開発	10,200	1,468.00	14,973,600
ハウスコム	3,900	1,257.00	4,902,300
日本管理センター	11,000	1,037.00	11,407,000
サンセイランディック	6,400	751.00	4,806,400
フージャースホールディングス	28,500	506.00	14,421,000
オープンハウス	42,100	3,645.00	153,454,500
東急不動産ホールディングス	393,100	433.00	170,212,300
飯田グループホールディングス	120,500	1,704.00	205,332,000
イーランド	4,900	687.00	3,366,300
ムゲンエステート	13,400	469.00	6,284,600
ハウストゥ	7,000	834.00	5,838,000
シーアールイー	4,700	1,546.00	7,266,200
グッドコムアセット	4,500	1,528.00	6,876,000
ジェイ・エス・ビー	3,700	2,671.00	9,882,700
テンポイノベーション	6,000	609.00	3,654,000
パーク24	77,800	1,672.00	130,081,600
パラカ	4,800	1,550.00	7,440,000
三井不動産	707,100	1,710.00	1,209,141,000
三菱地所	1,004,300	1,503.50	1,509,965,050
平和不動産	26,900	2,885.00	77,606,500
東京建物	152,300	1,132.00	172,403,600
ダイビル	38,600	1,013.00	39,101,800
京阪神ビルディング	24,200	1,310.00	31,702,000
住友不動産	322,500	2,580.50	832,211,250
テーオーシー	30,700	636.00	19,525,200
東京楽天地	2,800	3,900.00	10,920,000
スターツコーポレーション	20,300	2,071.00	42,041,300
フジ住宅	20,000	507.00	10,140,000
空港施設	18,500	403.00	7,455,500
明和地所	12,200	381.00	4,648,200
ゴールドクレスト	12,500	1,366.00	17,075,000
エスリード	6,900	1,301.00	8,976,900
日神グループホールディングス	26,100	346.00	9,030,600
日本エスコン	25,900	763.00	19,761,700
タカラレーベン	65,400	339.00	22,170,600
A V A N T I A	10,100	860.00	8,686,000
イオンモール	73,000	1,238.00	90,374,000
毎日コムネット	5,800	765.00	4,437,000

ファースト住建	8,000	889.00	7,112,000
カチタス	36,200	2,522.00	91,296,400
トーセイ	21,300	891.00	18,978,300
穴吹興産	4,300	1,418.00	6,097,400
サンフロンティア不動産	21,800	806.00	17,570,800
エフ・ジェー・ネクスト	14,600	831.00	12,132,600
インテリックス	4,000	449.00	1,796,000
ランドビジネス	4,800	326.00	1,564,800
サンネクスタグループ	6,100	981.00	5,984,100
グランディハウス	16,000	361.00	5,776,000
日本空港ビルデング	46,100	4,375.00	201,687,500
日本工営	9,400	2,819.00	26,498,600
L I F U L L	48,700	413.00	20,113,100
ジェイエシーリクルートメント	9,400	1,031.00	9,691,400
日本M&Aセンター	104,800	4,955.00	519,284,000
メンバーズ	4,200	1,358.00	5,703,600
中広	2,200	534.00	1,174,800
UTグループ	21,900	2,545.00	55,735,500
アイティメディア	5,600	1,845.00	10,332,000
タケエイ	13,400	961.00	12,877,400
E・Jホールディングス	2,500	1,961.00	4,902,500
ビーネックスグループ	17,500	964.00	16,870,000
コシダカホールディングス	33,700	374.00	12,603,800
アルトナー	3,500	837.00	2,929,500
パソナグループ	15,200	1,157.00	17,586,400
C D S	3,600	1,180.00	4,248,000
リンクアンドモチベーション	31,000	357.00	11,067,000
G C A	17,100	573.00	9,798,300
エス・エム・エス	43,200	2,322.00	100,310,400
サニーサイドアップグループ	5,000	659.00	3,295,000
パーソルホールディングス	138,800	1,378.00	191,266,400
リニカル	6,900	791.00	5,457,900
クックパッド	48,900	315.00	15,403,500
エスクリ	4,700	335.00	1,574,500
アイ・ケイ・ケイ	7,000	535.00	3,745,000
学情	5,000	1,015.00	5,075,000
スタジオアリス	7,100	1,455.00	10,330,500
シミックホールディングス	6,900	1,332.00	9,190,800
エプコ	3,100	1,225.00	3,797,500
N J S	3,100	1,769.00	5,483,900
総合警備保障	55,200	4,900.00	270,480,000
カカコム	102,500	2,824.00	289,460,000

アイロムグループ	5,000	2,417.00	12,085,000
セントケア・ホールディング	9,300	410.00	3,813,000
サイネックス	2,500	686.00	1,715,000
ルネサンス	7,900	894.00	7,062,600
ディップ	19,600	2,160.00	42,336,000
デジタルホールディングス	7,600	1,414.00	10,746,400
ツクイ	33,000	474.00	15,642,000
キャリアデザインセンター	3,300	817.00	2,696,100
ベネフィット・ワン	50,500	2,184.00	110,292,000
エムスリー	305,900	4,895.00	1,497,380,500
ツカダ・グローバルホールディング	8,800	258.00	2,270,400
プラス	1,800	505.00	909,000
アウトソーシング	79,600	585.00	46,566,000
ウェルネット	14,200	605.00	8,591,000
ワールドホールディングス	4,800	1,502.00	7,209,600
ディー・エヌ・エー	58,800	1,290.00	75,852,000
博報堂D Yホールディングス	193,000	1,133.00	218,669,000
ぐるなび	24,300	685.00	16,645,500
タカミヤ	15,000	527.00	7,905,000
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	779.00	8,491,100
ファンコミュニケーションズ	38,500	428.00	16,478,000
ライク	4,700	1,235.00	5,804,500
ビジネス・ブレークスルー	6,200	360.00	2,232,000
エスプール	35,800	661.00	23,663,800
WDBホールディングス	6,400	2,586.00	16,550,400
手間いらず	900	4,215.00	3,793,500
ティア	8,400	481.00	4,040,400
C D G	1,600	1,590.00	2,544,000
バリューコマース	7,800	2,938.00	22,916,400
インフォマート	152,200	704.00	107,148,800
J Pホールディングス	44,100	256.00	11,289,600
エコナックホールディングス	26,600	94.00	2,500,400
E P Sホールディングス	18,900	995.00	18,805,500
レッグス	3,600	827.00	2,977,200
プレステージ・インターナショナル	52,100	851.00	44,337,100
アミューズ	7,600	2,203.00	16,742,800
ドリームインキュベータ	4,300	1,214.00	5,220,200
クイック	8,700	1,105.00	9,613,500
T A C	9,100	192.00	1,747,200
ケネディクス	129,500	480.00	62,160,000
電通グループ	143,000	2,393.00	342,199,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,600	547.00	3,063,200

ぴあ	4,000	2,969.00	11,876,000
イオンファンタジー	5,400	1,381.00	7,457,400
シーティーエス	15,800	827.00	13,066,600
ネクシィーズグループ	4,400	915.00	4,026,000
H.U.グループホールディングス	38,900	2,503.00	97,366,700
アルプス技研	12,300	1,818.00	22,361,400
ダイオーズ	2,900	990.00	2,871,000
日本空調サービス	14,700	721.00	10,598,700
オリエンタルランド	147,500	13,865.00	2,045,087,500
ダスキン	34,500	2,640.00	91,080,000
明光ネットワークジャパン	17,700	802.00	14,195,400
ファルコホールディングス	7,700	1,466.00	11,288,200
ラウンドワン	38,900	706.00	27,463,400
リゾートトラスト	63,700	1,314.00	83,701,800
ビー・エム・エル	17,900	2,702.00	48,365,800
ワタベウェディング	2,700	276.00	745,200
りらいあコミュニケーションズ	25,200	1,091.00	27,493,200
リソー教育	63,800	293.00	18,693,400
早稲田アカデミー	6,200	919.00	5,697,800
ユー・エス・エス	155,400	1,646.00	255,788,400
東京個別指導学院	5,200	485.00	2,522,000
サイバーエージェント	85,500	5,980.00	511,290,000
楽天	646,700	988.00	638,939,600
クリーク・アンド・リバー社	7,400	1,307.00	9,671,800
テー・オー・ダブリュー	22,500	320.00	7,200,000
山田コンサルティンググループ	9,100	1,185.00	10,783,500
セントラルスポーツ	5,200	2,061.00	10,717,200
フルキャストホールディングス	14,000	1,279.00	17,906,000
エン・ジャパン	24,700	2,542.00	62,787,400
リソルホールディングス	1,500	3,340.00	5,010,000
テクノプロ・ホールディングス	27,700	5,780.00	160,106,000
アトラ	3,200	219.00	700,800
インターワークス	3,100	340.00	1,054,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,600	11,180.00	62,608,000
Keeper 技研	5,200	1,649.00	8,574,800
ファーストロジック	2,900	618.00	1,792,200
三機サービス	2,800	926.00	2,592,800
Gunosy	8,800	918.00	8,078,400
デザインワン・ジャパン	4,600	261.00	1,200,600
イー・ガーディアン	6,100	2,915.00	17,781,500
リブセンス	9,400	284.00	2,669,600
ジャパンマテリアル	42,700	1,700.00	72,590,000

ベクトル	17,500	841.00	14,717,500
ウチヤマホールディングス	7,300	294.00	2,146,200
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	754.00	9,048,000
ライクキッズ	2,500	1,003.00	2,507,500
キャリアリンク	4,800	737.00	3,537,600
I B J	9,700	631.00	6,120,700
アサンテ	5,700	1,420.00	8,094,000
N・フィールド	9,800	498.00	4,880,400
バリューHR	5,600	1,318.00	7,380,800
M&Aキャピタルパートナーズ	11,300	3,920.00	44,296,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	2,361.00	12,749,400
E R Iホールディングス	4,100	624.00	2,558,400
アビスト	2,200	2,574.00	5,662,800
シグマクシス	9,600	1,511.00	14,505,600
ウィルグループ	9,300	618.00	5,747,400
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	19,900	240.00	4,776,000
リクルートホールディングス	993,800	3,570.00	3,547,866,000
エラン	8,300	1,702.00	14,126,600
土木管理総合試験所	6,400	380.00	2,432,000
ネットマーケティング	5,600	600.00	3,360,000
日本郵政	1,137,100	750.80	853,734,680
ベルシステム24ホールディングス	23,300	1,669.00	38,887,700
鎌倉新書	10,600	995.00	10,547,000
S M N	3,100	1,040.00	3,224,000
一蔵	1,900	382.00	725,800
L I T A L I C O	4,800	2,137.00	10,257,600
グローバルキッズCOMPANY	2,700	591.00	1,595,700
エアトリ	7,300	1,220.00	8,906,000
アトラエ	4,200	2,967.00	12,461,400
ストライク	5,300	5,000.00	26,500,000
ソラスト	38,400	1,021.00	39,206,400
セラク	4,500	1,051.00	4,729,500
インソース	5,800	2,616.00	15,172,800
ベイカレント・コンサルティング	8,400	9,130.00	76,692,000
Orchestra Holdings	3,000	1,590.00	4,770,000
アイモバイル	5,100	777.00	3,962,700
キャリアインデックス	6,000	506.00	3,036,000
M S - J a p a n	4,700	747.00	3,510,900
船場	2,400	964.00	2,313,600
グレイステクノロジー	6,400	5,880.00	37,632,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,700	3,555.00	52,258,500
フルテック	2,100	1,271.00	2,669,100

グリーンズ	3,800	449.00	1,706,200
GameWith	4,400	551.00	2,424,400
ソウルドアウト	2,900	2,550.00	7,395,000
MS&Consulting	2,900	598.00	1,734,200
ミダック	1,900	1,594.00	3,028,600
日総工産	9,500	617.00	5,861,500
キュービーネットホールディングス	5,800	1,830.00	10,614,000
RPAホールディングス	10,700	680.00	7,276,000
スプリックス	4,100	657.00	2,693,700
マネジメントソリューションズ	6,100	1,236.00	7,539,600
プロレド・パートナーズ	1,900	5,220.00	9,918,000
and factory	1,300	894.00	1,162,200
ギークス	1,500	1,140.00	1,710,000
カーブスホールディングス	38,300	540.00	20,682,000
フォーラムエンジニアリング	7,400	730.00	5,402,000
アドバンテッジリスクマネジメント	7,200	795.00	5,724,000
リログループ	75,900	1,979.00	150,206,100
東祥	8,800	1,194.00	10,507,200
エイチ・アイ・エス	21,600	1,592.00	34,387,200
ラックランド	3,300	2,047.00	6,755,100
共立メンテナンス	23,000	3,605.00	82,915,000
イチネンホールディングス	15,700	1,103.00	17,317,100
建設技術研究所	9,700	1,680.00	16,296,000
スペース	9,200	894.00	8,224,800
長大	5,700	1,027.00	5,853,900
燦ホールディングス	6,200	1,126.00	6,981,200
スバル興業	900	8,000.00	7,200,000
東京テアトル	5,500	1,160.00	6,380,000
タナベ経営	2,800	1,277.00	3,575,600
ナガワ	4,400	7,200.00	31,680,000
よみうりランド	3,100	3,425.00	10,617,500
東京都競馬	9,100	3,955.00	35,990,500
カナモト	22,800	2,243.00	51,140,400
東京ドーム	56,400	705.00	39,762,000
西尾レントオール	12,900	2,120.00	27,348,000
トランス・コスモス	13,300	2,513.00	33,422,900
乃村工藝社	59,600	777.00	46,309,200
藤田観光	6,100	1,507.00	9,192,700
KNT-CTホールディングス	8,600	1,007.00	8,660,200
日本管財	14,900	1,841.00	27,430,900
トーカイ	13,500	2,240.00	30,240,000
白洋舎	1,600	2,719.00	4,350,400

セコム	147,200	9,242.00	1,360,422,400
セントラル警備保障	6,700	3,845.00	25,761,500
丹青社	26,400	675.00	17,820,000
メイテック	17,000	5,010.00	85,170,000
応用地質	15,000	1,430.00	21,450,000
船井総研ホールディングス	28,700	2,246.00	64,460,200
進学会ホールディングス	5,700	446.00	2,542,200
オオバ	10,100	661.00	6,676,100
いであ	3,500	1,836.00	6,426,000
学究社	4,200	1,058.00	4,443,600
ベネッセホールディングス	46,300	2,766.00	128,065,800
イオンディライト	17,100	2,945.00	50,359,500
ナック	7,800	851.00	6,637,800
ニチイ学館	19,800	1,585.00	31,383,000
ダイセキ	23,300	2,415.00	56,269,500
ステップ	5,200	1,507.00	7,836,400
合 計	170,299,200		312,636,026,410

(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。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	837,932,192
国債証券	13,827,542,700
社債券	16,654,710,000
コール・オプション(買)	19,403,000
プット・オプション(買)	3,327,000
未収入金	1,273,632,500
未収利息	25,092,887

	2020年 7月10日現在
項目	金額（円）
前払金	4,240,000
前払費用	10,593,155
差入委託証拠金	16,200,000
流動資産合計	32,672,673,434
資産合計	32,672,673,434
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	1,482,000
プット・オプション（売）	26,968,000
派生商品評価勘定	4,246,600
未払金	1,900,002,000
未払解約金	1,763,791
未払利息	449
その他未払費用	1,036
流動負債合計	1,934,463,876
負債合計	1,934,463,876
純資産の部	
元本等	
元本	31,218,365,178
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	480,155,620
元本等合計	30,738,209,558
純資産合計	30,738,209,558
負債純資産合計	32,672,673,434

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月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、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> <p>(2)債券店頭オプション取引 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、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益

	約定日基準で計上しております。
--	-----------------

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		31,218,365,178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	480,155,620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)	0.9846円 (9,846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 7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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引、債券店頭オプション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。債券店頭オプション取引に係る主要なリスクは、オプション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 7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。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月18日
期首元本額	14,930,999,500円
期中追加設定元本額	18,217,082,930円
期中一部解約元本額	1,929,717,252円
期末元本額	31,218,365,178円

期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,098,250,690円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,393,064,992円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	17,890,096,309円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,052,882,288円
債券コア戦略ファンド	239,849,042円
債券コア・セレクション	1,915,008,896円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	846,096,459円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	8,332,701円
日本債券ツイン戦略ファンド（SMA専用）	102,522,037円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	418,234,167円
FOFs用 日本債券ツイン戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	1,254,027,597円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7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		259,881,100
社債券		90,096,000
合計		349,977,100

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券ツイン戦略マザーファンド」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 7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				
	売建	3,040,160,000	-	3,044,400,000	4,240,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引				
	買建				
	コール	2,914,677,000	-	19,403,000	1,413,000
	プット	4,826,757,000	-	3,327,000	2,513,000
	売建				

	コール	4,826,757,000	-	1,482,000	638,000
	プット	2,914,677,000	-	26,968,000	6,002,000
	合計	18,523,028,000	-	3,095,580,000	10,704,000

(注)1.時価の算定方法

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

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格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(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第143回利付国債(5年)	700,000,000	707,252,000	
	第2回利付国債(40年)	110,000,000	158,101,900	
	第12回利付国債(40年)	700,000,000	678,020,000	
	第345回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,297,843,200	
	第349回利付国債(10年)	500,000,000	507,680,000	
	第350回利付国債(10年)	200,000,000	203,018,000	
	第351回利付国債(10年)	70,000,000	71,034,600	
	第356回利付国債(10年)	700,000,000	707,728,000	
	第6回利付国債(30年)	200,000,000	252,360,000	
	第18回利付国債(30年)	200,000,000	259,916,000	
	第29回利付国債(30年)	30,000,000	40,830,900	
	第35回利付国債(30年)	100,000,000	131,897,000	
	第41回利付国債(30年)	450,000,000	572,904,000	
	第46回利付国債(30年)	200,000,000	246,654,000	
	第47回利付国債(30年)	200,000,000	251,568,000	
	第48回利付国債(30年)	20,000,000	24,243,800	
	第51回利付国債(30年)	20,000,000	18,951,000	
	第52回利付国債(30年)	420,000,000	418,059,600	

	第55回利付国債（30年）	80,000,000	85,392,800
	第58回利付国債（30年）	290,000,000	309,276,300
	第61回利付国債（30年）	90,000,000	93,549,600
	第64回利付国債（30年）	570,000,000	545,746,500
	第65回利付国債（30年）	150,000,000	143,571,000
	第66回利付国債（30年）	130,000,000	124,387,900
	第144回利付国債（20年）	500,000,000	585,480,000
	第147回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,522,470,400
	第150回利付国債（20年）	200,000,000	233,436,000
	第155回利付国債（20年）	900,000,000	1,001,079,000
	第158回利付国債（20年）	190,000,000	196,473,300
	第160回利付国債（20年）	460,000,000	490,015,000
	第163回利付国債（20年）	510,000,000	533,582,400
	第169回利付国債（20年）	820,000,000	809,118,600
	第171回利付国債（20年）	40,000,000	39,349,200
	第172回利付国債（20年）	270,000,000	270,245,700
	第12回フィリピン共和国円貨債券	300,000,000	296,307,000
	国債証券合計	12,880,000,000	13,827,542,700
社債券	第2回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約）	100,000,000	100,094,000
	第1回大和証券任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	100,000,000	98,903,000
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	300,000,000	292,059,000
	第7回クレディ・アグリコル期限前償還非上位円貨社債	200,000,000	202,604,000
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	200,000,000	198,258,000
	第24回GEキャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	99,960,000
	第13回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	100,000,000	100,133,000
	第14回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	200,462,000
	第7回西松建設株式会社無担保社債	300,000,000	303,360,000
	第6回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,009,000
	第1回大和ハウス工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	398,416,000
	第1回積水ハウス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	704,326,000
	第6回日揮ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,000,000
	ソシエテ・ジェネラル 0.472% 2025/02/27	200,000,000	195,795,000
	第1回サントリーHD利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	401,348,000
	第2回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	300,084,000

第3回ヒューリック利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	300,000,000	300,132,000	
第4回ヒューリック利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	200,000,000	200,240,000	
第5回積水ハウス・リート投資法人無担保投資法人債	300,000,000	296,901,000	
第5回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	98,747,000	
第40回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第1回住友化学利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	400,000,000	398,084,000	
第2回住友化学利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	600,000,000	598,584,000	
第1回積水化成工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,302,000	
第14回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,011,000	
第15回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,011,000	
第17回Zホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	301,266,000	
第1回ENEOSホールディングス無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第33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	100,041,000	
第36回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,032,000	
第50回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	100,105,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第18回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	198,644,000	
第1回アイシン精機利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	300,000,000	295,149,000	
第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	300,000,000	296,370,000	
第3回楽天カード株式会社無担保社債	200,000,000	198,000,000	
第2回シークス株式会社無担保社債	100,000,000	100,362,000	
第3回株式会社アシックス無担保社債	100,000,000	100,026,000	
第112回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,911,000	
第5回三菱商事利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,100,000,000	1,101,969,000	
第4回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,228,000	
第11回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,022,000	
第12回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,068,000	
第20回みずほフィナンシャルグループ期限前償還(劣後特約付)	700,000,000	695,471,000	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	400,000,000	397,208,000	
第13回SBIホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,962,000	
第17回SBIホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,727,000	
第19回SBIホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,212,000	

第21回SBIホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,852,000	
第10回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	300,000,000	298,497,000	
第7回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	300,000,000	300,483,000	
第25回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第1回オリックス利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	300,000,000	292,998,000	
第2回オリックス利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	200,000,000	190,702,000	
第2回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,022,000	
第1回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	500,000,000	495,470,000	
第1回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	200,000,000	200,636,000	
第3回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	500,000,000	502,735,000	
第2回T&Dホールディングス利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	100,000,000	99,634,000	
第3回T&Dホールディングス利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	100,000,000	98,725,000	
第32回東京建物株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第89回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第55回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第3回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	297,084,000	
第28回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	200,348,000	
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	201,550,000	
第25回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	202,438,000	
第35回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	203,916,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第40回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第13回コナミホールディングス無担保社債	300,000,000	300,000,000	
社債券合計	16,700,000,000	16,654,710,000	
合計		30,482,252,700	

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

項目	2020年 7月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,171,017,267
コール・ローン	7,516,051,367
株式	387,343,688,806
投資信託受益証券	260,717,672
投資証券	9,515,306,897
派生商品評価勘定	167,373,222
未収入金	14,348,240
未収配当金	453,602,638
差入委託証拠金	3,204,992,062
流動資産合計	413,647,098,171
資産合計	413,647,098,171
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,495,628
前受金	146,575,774
未払解約金	7,542,523,335
未払利息	4,036
その他未払費用	1,275
流動負債合計	7,709,600,048
負債合計	7,709,600,048
純資産の部	
元本等	
元本	150,285,284,851
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	255,652,213,272
元本等合計	405,937,498,123
純資産合計	405,937,498,123
負債純資産合計	413,647,098,171

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	2020年 7月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		150,285,284,851口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7011円 (27,011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 7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 7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 7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)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	136,683,156,103円
期中追加設定元本額	42,689,099,791円
期中一部解約元本額	29,086,971,043円
期末元本額	150,285,284,851円
期末元本額の内訳	

区分	2020年 7月10日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,382,035,055円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,736,956円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,017,874,077円
世界経済インデックスファンド	8,324,253,060円
外国株式インデックス・オープン	774,049,183円
D C マイセレクション 2 5	993,464,420円
D C マイセレクション 5 0	4,796,397,005円
D C マイセレクション 7 5	5,099,941,862円
D C 外国株式インデックス・オープン	9,662,963,234円
D C マイセレクション S 2 5	416,293,326円
D C マイセレクション S 5 0	2,041,166,633円
D C マイセレクション S 7 5	1,471,116,042円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	92,405,681円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	203,924,917円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	136,164,103円
D C 世界経済インデックスファンド	10,666,061,738円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	2,163,505,479円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,671,179円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,500,216円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	37,762,336円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	38,330,661円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	142,171,824円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	29,639,871円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	154,989,666円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	563,477,151円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	325,301,104円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,095,356,520円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,686,608,542円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	64,095,016円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	301,064,033円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	7,911,099円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	101,376,097円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,707,023,299円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,860,856,812円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,043,383,807円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,236,946,543円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,428,373,745円
分散投資コア戦略ファンド A	2,109,567,375円
分散投資コア戦略ファンド S	6,081,166,286円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,163,332,795円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,167,897,624円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,124,523,312円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	734,014,805円

区分	2020年 7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）	39,198,654円
SMT インデックスバランス・オープン	221,267,152円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,221,448,205円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	34,513,549,682円
SMT 世界経済インデックス・オープン	121,731,081円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	410,291,289円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	72,837,525円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,282,662円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	72,884,861円
グローバル経済コア	985,367,165円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,645,546円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,268,584円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	463,823,625円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	76,831,136円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	742,790円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	859,299円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	303,871円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	402,027円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,096,607,427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）	1,849,856,454円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,758,764,006円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	228,771,733円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	63,739,786円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	402,638,376円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	794,988,771円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	399,488,655円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	15,522,970,215
投資信託受益証券	14,054,234
投資証券	27,636,821
合計	15,536,552,802

(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

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	8,452,317,660	-	8,598,893,434	146,575,774
合計		8,452,317,660	-	8,598,893,434	146,575,774

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2020年 7月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	116,359,620	-	116,057,800	301,820
	アメリカドル	26,780,000	-	26,780,000	-
	ユーロ	27,973,520	-	27,774,800	198,720
	ノルウェークローネ	16,933,500	-	16,935,000	1,500
	香港ドル	13,821,000	-	13,820,000	1,000
	シンガポールドル	30,851,600	-	30,748,000	103,600
合計		116,359,620	-	116,057,800	301,820

(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

			評価額
--	--	--	-----

通貨	銘柄	株式数 (株)	単価	金額	備考
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	67,650	14.65	991,072.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	17.03	611,019.37	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	49.81	1,094,624.56	
	CHEVRON CORP	177,002	82.74	14,645,145.48	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	47.56	915,292.20	
	CONOCOPHILLIPS	104,738	38.35	4,016,702.30	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	16,913	37.50	634,237.50	
	EOG RESOURCES INC	55,564	44.34	2,463,707.76	
	EXXON MOBIL	398,806	41.36	16,494,616.16	
	HALLIBURTON CO	77,539	11.78	913,409.42	
	HESS CORP	24,844	44.68	1,110,029.92	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	26.21	369,823.10	
	KINDER MORGAN INC	194,644	13.91	2,707,498.04	
	MARATHON PETROLEUM CORP	62,097	33.35	2,070,934.95	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	10.83	402,464.46	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,482	16.28	1,310,246.96	
	ONEOK INC	41,832	26.15	1,093,906.80	
	PHILLIPS 66	42,441	58.98	2,503,170.18	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	91.48	1,449,409.12	
	SCHLUMBERGER	132,260	17.13	2,265,613.80	
	VALERO ENERGY CORP	39,247	50.22	1,970,984.34	
	WILLIAMS COS	114,214	18.27	2,086,689.78	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	21,038	271.60	5,713,920.80	
	ALBEMARLE CORP	10,180	75.75	771,135.00	
	AMCOR PLC	153,458	10.37	1,591,359.46	
	AVERY DENNISON CORP	7,457	110.61	824,818.77	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	21.82	384,162.92	
	BALL CORP	29,987	71.75	2,151,567.25	
	CELANESE CORP-SERIES A	11,053	84.07	929,225.71	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	26.90	513,009.90	
	CORTEVA INC	70,180	25.75	1,807,135.00	
	CROWN HOLDINGS INC	12,992	65.29	848,247.68	
	DOW INC	70,834	39.44	2,793,692.96	
	DUPONT DE NEMOURS INC	70,752	50.91	3,601,984.32	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	14,194	68.31	969,592.14		
ECOLAB INC	24,761	197.50	4,890,297.50		
FMC CORP	12,118	97.89	1,186,231.02		
FREEMPORT-MCMORAN INC	138,927	12.89	1,790,769.03		
INT'L PAPER CO	33,803	33.11	1,119,217.33		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,795	122.30	1,075,628.50		
LINDE PLC	50,427	221.95	11,192,272.65		

LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	63.11	1,610,125.43
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	206.71	1,236,332.51
MOSAIC CO/THE	31,911	11.68	372,720.48
NEWMONT CORPORATION	78,251	62.73	4,908,685.23
NUCOR CORP	29,015	38.80	1,125,782.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	95.37	847,839.30
PPG INDUSTRIES INC	22,118	105.08	2,324,159.44
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	74.53	926,407.90
SEALED AIR CORP	14,689	32.46	476,804.94
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,930	579.69	4,596,941.70
STEEL DYNAMICS INC	18,273	24.51	447,871.23
VULCAN MATERIALS CO	12,657	117.10	1,482,134.70
WESTROCK CO	24,734	26.22	648,525.48
3 M COMPANY	54,004	151.45	8,178,905.80
AERCAP HOLDINGS NV	15,830	27.67	438,016.10
ALLEGION PLC	8,963	100.53	901,050.39
AMETEK INC	22,247	86.26	1,919,026.22
BOEING CO	50,222	173.28	8,702,468.16
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	23.91	1,806,424.41
CATERPILLAR	51,485	125.73	6,473,209.05
CUMMINS INC	13,804	172.17	2,376,634.68
DEERE&CO	27,735	157.65	4,372,422.75
DOVER CORP	13,872	94.86	1,315,897.92
EATON CORP	40,190	85.64	3,441,871.60
EMERSON ELECTRIC CO	59,226	59.47	3,522,170.22
FASTENAL CO	55,807	43.10	2,405,281.70
FORTIVE CORP	28,503	67.28	1,917,681.84
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	64.15	821,761.50
GENERAL DYNAMICS CORP	23,906	138.02	3,299,506.12
GENERAL ELECTRIC CO	816,436	6.58	5,372,148.88
GRAINGER (WW) INC	4,461	308.99	1,378,404.39
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	32.97	502,001.22
HEICO CORP	3,640	94.87	345,326.80
HEICO CORP-CLASS A	6,449	76.27	491,865.23
HONEYWELL INTL INC	67,906	141.37	9,599,871.22
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	14.77	539,843.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	161.77	569,753.94
IDEX CORP	6,916	157.19	1,087,126.04
ILLINOIS TOOL WORKS	29,759	173.29	5,156,937.11
INGERSOLL-RAND INC	31,562	27.86	879,317.32
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	78.85	948,250.10
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	41.70	838,170.00

JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	20.76	425,580.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	75,045	33.38	2,505,002.10
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,485	159.80	3,433,303.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,699	242.43	896,748.57
LOCKHEED MARTIN CORP	23,810	339.96	8,094,447.60
MASCO CORP	27,698	49.69	1,376,313.62
NORDSON CORP	5,718	186.93	1,068,865.74
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,837	285.95	4,242,640.15
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	56.11	2,105,191.09
OWENS CORNING	10,458	55.11	576,340.38
PACCAR INC	32,395	74.43	2,411,159.85
PARKER HANNIFIN CORP	12,505	176.32	2,204,881.60
PENTAIR PLC	18,123	38.30	694,110.90
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	142,229	58.11	8,264,927.19
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,244	211.37	2,376,644.28
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,116	394.93	3,995,111.88
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	36.10	499,190.80
SMITH (A.O.) CORP	12,146	47.57	577,785.22
SNAP-ON INC	4,900	128.89	631,561.00
STANLEY BLACK&DECKER	14,798	137.04	2,027,917.92
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	290.86	1,018,300.86
TEXTRON	21,534	30.13	648,819.42
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,309	90.29	2,104,569.61
TRANSDIGM GROUP INC	4,664	410.98	1,916,810.72
UNITED RENTALS INC	7,713	143.66	1,108,049.58
WABTEC CORP	17,764	56.60	1,005,442.40
XYLEM INC	17,545	66.52	1,167,093.40
CINTAS CORP	8,272	266.14	2,201,510.08
COPART INC	19,784	83.38	1,649,589.92
COSTAR GROUP INC	3,584	726.25	2,602,880.00
EQUIFAX INC	11,791	161.79	1,907,665.89
IHS MARKIT LTD	35,672	75.74	2,701,797.28
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	14.40	501,825.60
REPUBLIC SERVICES INC	21,742	80.50	1,750,231.00
ROBERT HALF INTL INC	9,566	49.27	471,316.82
ROLLINS INC	14,566	45.79	666,977.14
TRANSUNION	19,072	83.54	1,593,274.88
VERISK ANALYTICS INC	14,560	173.20	2,521,792.00
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	95.97	2,363,645.13
WASTE MANAGEMENT INC	39,501	102.08	4,032,262.08
AMERCO	1,179	291.54	343,725.66
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	80.87	1,066,351.82

CSX CORP	72,174	67.86	4,897,727.64
DELTA AIR LINES INC	12,549	25.65	321,881.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	77.01	1,221,994.68
FEDEX CORP	24,100	155.74	3,753,334.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	125.00	1,039,875.00
KANSAS CITY SOUTHERN	9,654	142.84	1,378,977.36
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	43.98	470,586.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,985	170.91	4,099,276.35
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,106	176.42	1,606,480.52
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	31.57	361,950.05
UBER TECHNOLOGIES INC	87,546	33.15	2,902,149.90
UNION PACIFIC CORP	65,930	165.99	10,943,720.70
UNITED PARCEL SERVICE B	65,801	114.45	7,530,924.45
XPO LOGISTICS INC	8,001	75.38	603,115.38
APTIV PLC	24,462	75.39	1,844,190.18
AUTOLIV INC	6,776	63.30	428,920.80
BORGWARNER INC	19,890	34.40	684,216.00
FORD MOTOR COMPANY	375,147	5.84	2,190,858.48
GENERAL MOTORS CO	119,364	23.42	2,795,504.88
LEAR CORP	5,287	102.30	540,860.10
TESLA INC	13,958	1,394.28	19,461,360.24
DR HORTON INC	32,171	58.04	1,867,204.84
GARMIN LTD	12,854	96.92	1,245,809.68
HASBRO INC	12,468	71.50	891,462.00
LENNAR CORP-CL A	24,928	63.25	1,576,696.00
LULULEMON ATHLETICA INC	11,527	315.20	3,633,310.40
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	73.12	370,133.44
NEWELL BRANDS INC	37,563	15.01	563,820.63
NIKE B	117,323	96.99	11,379,157.77
NVR INC	337	3,244.48	1,093,389.76
PULTE GROUP INC	28,283	33.88	958,228.04
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	67.47	308,877.66
VF CORP	32,491	58.27	1,893,250.57
WHIRLPOOL CORP	6,079	133.17	809,540.43
ARAMARK	24,034	20.77	499,186.18
CARNIVAL CORPORATION	40,341	14.58	588,171.78
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,577	1,115.58	2,874,849.66
DARDEN RESTAURANTS INC	13,394	71.34	955,527.96
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	385.50	1,434,445.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,760	74.13	2,057,848.80
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	44.68	1,478,908.00
MARRIOTT INTL A	26,598	86.25	2,294,077.50

MCDONALD'S CORP	70,444	184.33	12,984,942.52
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	15.22	268,815.64
MGM RESORTS INTERNATIONAL	49,467	16.00	791,472.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,686	47.12	880,484.32
STARBUCKS CORP	110,556	73.57	8,133,604.92
VAIL RESORTS INC	3,574	176.93	632,347.82
WYNN RESORTS LTD	9,302	71.13	661,651.26
YUM BRANDS INC	29,166	86.38	2,519,359.08
ACTIVISION BLIZZARD INC	73,316	80.64	5,912,202.24
ALPHABET INC-CL A	28,327	1,518.66	43,019,081.82
ALPHABET INC-CL C	28,988	1,510.99	43,800,578.12
ALTICE USA INC- A	35,374	23.22	821,384.28
CABLE ONE INC	483	1,773.01	856,363.83
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,769	530.19	7,300,186.11
COMCAST CORP-CL A	428,069	39.29	16,818,831.01
DISCOVERY INC - A	12,804	19.25	246,477.00
DISCOVERY INC-C	28,190	17.25	486,277.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	30.83	743,095.49
ELECTRONIC ARTS INC	27,876	138.80	3,869,188.80
FACEBOOK INC-A	227,316	244.50	55,578,762.00
FOX CORP - CLASS A	33,968	24.37	827,800.16
FOX CORP- CLASS B	15,092	24.46	369,150.32
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	124.85	976,451.85
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	16.39	554,539.26
LIBERTY BROADBAND-A	3,021	124.65	376,567.65
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	127.42	1,299,811.42
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	33.71	630,141.03
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	33.65	580,933.60
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	33.92	216,545.28
LIVE NATION ENTERTAINMENT	16,947	45.05	763,462.35
MATCH GROUP INC	21,635	96.32	2,083,883.20
NETFLIX INC	41,368	507.76	21,005,015.68
NEWS CORP-CLASS A	33,479	11.73	392,708.67
OMNICOM GROUP	20,835	51.66	1,076,336.10
PINTEREST INC- CLASS A	32,190	27.42	882,649.80
ROKU INC	8,355	149.69	1,250,659.95
SIRIUS XM HOLDINGS INC	89,917	5.63	506,232.71
SNAP INC - A	79,559	25.94	2,063,760.46
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,751	150.76	1,620,820.76
THE WALT DISNEY CO	170,184	116.81	19,879,193.04
TWITTER INC	71,690	35.72	2,560,766.80
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	22.10	1,192,869.60

ZILLOW GROUP INC-C	12,368	62.99	779,060.32
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	133.75	827,377.50
AMAZON.COM	40,184	3,182.63	127,890,803.92
AUTOZONE INC	2,285	1,107.76	2,531,231.60
BEST BUY COMPANY INC	22,720	84.95	1,930,064.00
BOOKING HOLDINGS INC	3,859	1,670.28	6,445,610.52
BURLINGTON STORES INC	6,766	178.90	1,210,437.40
CARMAX INC	15,777	86.23	1,360,450.71
DOLLAR GENERAL CORP	24,570	189.74	4,661,911.80
DOLLAR TREE INC	22,651	91.33	2,068,829.08
EBAY	74,325	59.22	4,401,526.50
EXPEDIA GROUP INC	13,383	81.56	1,091,517.48
GENUINE PARTS CO	13,937	84.45	1,176,979.65
HOME DEPOT	103,366	247.96	25,630,633.36
LKQ CORP	29,351	25.44	746,836.19
LOWES COMPANIES	72,304	135.61	9,805,145.44
MERCADOLIBRE INC	4,280	1,018.41	4,358,794.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,237	419.41	3,035,270.17
ROSS STORES INC	34,327	84.72	2,908,183.44
TARGET (DAYTON HUDSON)	48,428	117.90	5,709,661.20
TIFFANY & CO	10,426	120.99	1,261,441.74
TJX COMPANIES INC	115,530	49.99	5,775,344.70
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	137.70	1,543,892.40
ULTA BEAUTY INC	5,362	192.30	1,031,112.60
COSTCO WHOLESALE CORP	41,563	325.54	13,530,419.02
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	4.85	164,415.00
KROGER CO	76,549	32.76	2,507,745.24
SYSCO CORP	45,437	50.98	2,316,378.26
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,429	39.01	2,825,455.29
WALMART INC	133,620	127.75	17,069,955.00
ALTRIA GROUP INC	178,226	38.60	6,879,523.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	37.81	1,973,266.09
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	63.25	1,834,882.50
BUNGE LIMITED	13,606	38.23	520,157.38
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	49.41	784,087.29
COCA-COLA CO	384,034	43.91	16,862,932.94
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16,995	37.26	633,233.70
CONAGRA BRANDS INC	45,992	35.60	1,637,315.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,999	182.39	2,918,057.61
GENERAL MILLS INC	57,694	62.55	3,608,759.70
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	126.75	1,761,318.00
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.01	1,276,650.57

INGREDION INC	5,835	78.42	457,580.70
JM SMUCKER CO	10,802	103.39	1,116,818.78
KELLOGG CO	24,092	65.90	1,587,662.80
KEURIG DR PEPPER INC	36,671	29.00	1,063,459.00
KRAFT HEINZ CO/THE	64,187	31.37	2,013,546.19
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	59.96	774,923.04
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,808	183.85	2,170,900.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	33.25	605,249.75
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	137,361	50.26	6,903,763.86
MONSTER BEVERAGE CORP	37,118	71.05	2,637,233.90
PEPSICO INC	130,934	132.71	17,376,251.14
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146,196	70.14	10,254,187.44
TYSON FOODS INC	28,214	55.58	1,568,134.12
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	81.73	1,916,895.42
CLOROX COMPANY	11,988	229.50	2,751,246.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	77,689	73.32	5,696,157.48
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,244	187.81	3,989,835.64
KIMBERLY-CLARK CORP	32,715	142.22	4,652,727.30
PROCTER & GAMBLE CO	233,057	122.48	28,544,821.36
ABBOTT LABORATORIES	166,071	93.67	15,555,870.57
ABIOMED INC	4,421	265.68	1,174,571.28
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	274.08	1,949,531.04
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	96.39	1,407,679.56
ANTHEM INC	24,196	255.00	6,169,980.00
BAXTER INTERNATIONAL	47,484	85.69	4,068,903.96
BECTON DICKINSON & CO	25,805	258.61	6,673,431.05
BOSTON SCIENTIFIC CORP	133,021	34.50	4,589,224.50
CARDINAL HEALTH	27,968	48.88	1,367,075.84
CENTENE CORP	55,738	63.31	3,528,772.78
CERNER CORP	30,009	69.63	2,089,526.67
CIGNA CORP	35,629	173.90	6,195,883.10
CVS HEALTH CORP	122,285	61.28	7,493,624.80
DANAHER CORP	58,889	185.47	10,922,142.83
DAVITA INC	9,056	79.74	722,125.44
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	41.27	833,158.76
DEXCOM INC	8,490	440.50	3,739,845.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	59,721	68.26	4,076,555.46
HCA HEALTHCARE INC	25,918	94.34	2,445,104.12
HENRY SCHEIN INC	14,096	56.08	790,503.68
HOLOGIC INC	24,459	57.47	1,405,658.73
HUMANA INC	12,640	382.92	4,840,108.80
IDEXX LABORATORIES INC	8,195	341.17	2,795,888.15

INSULET CORP	5,923	211.29	1,251,470.67
INTUITIVE SURGICAL INC	10,851	574.47	6,233,573.97
LABORATORY CRP OF AMER	9,814	173.12	1,698,999.68
MASIMO CORP	5,273	236.47	1,246,906.31
MCKESSON CORP	15,443	140.89	2,175,764.27
MEDTRONIC PLC	126,090	90.13	11,364,491.70
MOLINA HEALTHCARE INC	6,271	178.62	1,120,126.02
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	115.85	1,493,769.90
RESMED INC	13,491	193.69	2,613,071.79
STERIS PLC	8,111	150.44	1,220,218.84
STRYKER CORP	32,154	177.77	5,716,016.58
TELADOC HEALTH INC	6,315	228.43	1,442,535.45
TELEFLEX INC	4,427	356.96	1,580,261.92
THE COOPER COS INC	4,688	289.73	1,358,254.24
UNITEDHEALTH GROUP INC	89,510	291.16	26,061,731.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	88.61	642,245.28
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	118.49	976,002.13
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	256.69	3,163,704.25
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,079	235.93	1,670,148.47
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,652	117.64	2,311,861.28
ABBVIE INC	166,385	97.94	16,295,746.90
AGILENT TECHNOLOGIES	29,560	89.92	2,658,035.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	108.47	2,248,149.22
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	159.03	1,696,054.95
AMGEN	55,528	251.66	13,974,176.48
AVANTOR INC	45,734	18.69	854,768.46
BEIGENE LTD-ADR	3,859	199.81	771,066.79
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	478.04	1,023,483.64
BIOGEN INC	16,218	278.70	4,519,956.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	126.81	2,177,454.51
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	214,587	58.11	12,469,650.57
CATALENT INC	16,026	79.15	1,268,457.90
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	21.36	770,262.96
EXACT SCIENCES CORP	13,278	92.75	1,231,534.50
GILEAD SCIENCES INC	118,620	74.71	8,862,100.20
ILLUMINA INC	14,031	372.60	5,227,950.60
INCYTE CORP	17,504	107.87	1,888,156.48
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	60.44	774,659.48
IQVIA HOLDINGS INC	17,736	144.99	2,571,542.64
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	105.46	524,241.66
JOHNSON & JOHNSON	248,779	142.49	35,448,519.71
LILLY (ELI) & CO	81,003	166.45	13,482,949.35

MERCK & CO	239,061	76.69	18,333,588.09
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	830.53	1,877,828.33
MODERNA INC	25,034	64.97	1,626,458.98
MYLAN NV	49,481	15.88	785,758.28
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	131.56	1,114,839.44
PERKINELMER INC	10,645	103.08	1,097,286.60
PERRIGO CO PLC	14,477	54.26	785,522.02
PFIZER	521,538	33.46	17,450,661.48
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,527	640.63	6,103,282.01
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	169.96	1,214,704.12
SEATTLE GENETICS INC	11,471	181.17	2,078,201.07
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	11.61	1,259,499.24
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,540	387.67	14,553,131.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,285	295.40	7,173,789.00
WATERS CORP	6,363	188.63	1,200,252.69
ZOETIS INC	45,448	137.68	6,257,280.64
BANK OF AMERICA CORP	740,193	22.77	16,854,194.61
CITIGROUP	197,888	49.45	9,785,561.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	22.73	909,427.30
COMERICA INC	14,360	33.40	479,624.00
EAST WEST BANCORP INC	13,827	32.56	450,207.12
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	17.39	1,181,493.99
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	102.31	1,623,864.32
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	8.06	798,036.72
JPMORGAN CHASE & CO	290,074	91.28	26,477,954.72
KEY CORP	94,322	11.03	1,040,371.66
M & T BANK CORP	13,267	95.21	1,263,151.07
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	10.40	381,888.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,823	98.85	4,134,203.55
REGIONS FINL CORP	92,434	9.83	908,626.22
SIGNATURE BANK	5,223	100.52	525,015.96
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	201.65	996,755.95
TRUIST FINANCIAL CORP	128,020	33.61	4,302,752.20
US BANCORP	127,646	34.22	4,368,046.12
WELLS FARGO & CO	365,686	24.04	8,791,091.44
ZIONS BANCORPORATION	15,186	30.44	462,261.84
ALLY FINANCIAL INC	36,028	19.05	686,333.40
AMERICAN EXPRESS	64,225	90.57	5,816,858.25
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	143.29	1,697,986.50
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	18,264	49.90	911,373.60
BANK NEW YORK CO	73,913	37.15	2,745,867.95
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	130,737	178.80	23,375,775.60

BLACKROCK INC	14,548	549.44	7,993,253.12
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,438	53.37	3,332,316.06
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44,494	58.35	2,596,224.90
CARLYLE GROUP INC/THE	16,087	28.17	453,170.79
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	90.19	957,096.28
CME GROUP INC	34,191	165.53	5,659,636.23
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	46.45	1,286,850.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	49.14	1,037,247.12
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	18.14	729,500.10
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	347.37	1,261,995.21
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	20.27	528,438.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,708	196.83	6,044,255.64
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53,142	92.14	4,896,503.88
INVESCO LTD	44,943	10.04	451,227.72
KKR & CO INC	47,403	34.73	1,646,306.19
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	548.61	1,971,155.73
MOODY'S CORP	16,220	294.29	4,773,383.80
MORGAN STANLEY	111,986	47.51	5,320,454.86
MSCI INC	7,815	375.14	2,931,719.10
NASDAQ INC	10,979	120.80	1,326,263.20
NORTHERN TRUST CORP	19,520	76.41	1,491,523.20
PRICE T ROWE GROUP INC	21,748	122.83	2,671,306.84
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	65.60	785,100.80
S&P GLOBAL INC	23,319	352.72	8,225,077.68
SCHWAB (CHARLES) CORP	110,150	33.88	3,731,882.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	53.90	660,867.90
STATE STREET CORP	34,742	61.66	2,142,191.72
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	21.34	1,133,047.30
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	36.61	947,356.97
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	55.43	502,251.23
VOYA FINANCIAL INC	12,505	45.32	566,726.60
AFLAC	62,907	33.97	2,136,950.79
ALLEGHANY CORP	1,276	471.19	601,238.44
ALLSTATE CORP	30,932	85.82	2,654,584.24
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,013	56.83	512,208.79
AMERICAN INT'L GROUP	83,130	28.00	2,327,640.00
AON PLC	22,349	194.46	4,345,986.54
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	27.04	1,049,043.84
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	97.59	1,740,322.47
ASSURANT INC	5,819	97.56	567,701.64
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	15,847	29.51	467,644.97
BROWN & BROWN INC	22,945	40.90	938,450.50

CHUBB LTD	43,249	124.34	5,377,580.66
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	67.30	999,472.30
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	188.63	408,572.58
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	198.06	777,583.56
FNF GROUP	24,961	29.64	739,844.04
GLOBE LIFE INC	9,867	70.19	692,564.73
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	35.81	1,234,764.61
LINCOLN NATIONAL CORP	20,790	32.71	680,040.90
LOEWS CORP	25,707	32.82	843,703.74
MARKEL CORP	1,312	892.91	1,171,497.92
MARSH & MCLENNAN COS	48,167	108.23	5,213,114.41
METLIFE INC	74,667	35.39	2,642,465.13
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	39.86	1,060,873.90
PROGRESSIVE CORP	55,794	77.79	4,340,215.26
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,690	58.03	2,187,150.70
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	67.56	366,918.36
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,122	166.93	855,015.46
TRAVELERS COS INC/THE	24,049	110.04	2,646,351.96
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	199.02	2,391,424.32
WR BERKLEY CORP	14,085	55.80	785,943.00
CBRE GROUP INC-A	33,971	43.87	1,490,307.77
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.04	398,748.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	102.77	460,820.68
WEYERHAEUSER CO	69,607	22.61	1,573,814.27
ACCENTURE PLC-CL A	59,753	219.31	13,104,430.43
ADOBE INC	45,456	460.84	20,947,943.04
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	15,447	114.22	1,764,356.34
ANSYS INC	8,044	304.69	2,450,926.36
AUTODESK INC	20,964	248.20	5,203,264.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	41,287	145.73	6,016,754.51
AVALARA INC	6,485	140.37	910,299.45
BLACK KNIGHT INC	14,413	72.06	1,038,600.78
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	75.26	1,011,343.88
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	127.57	1,399,570.47
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,369	101.53	2,677,244.57
CDK GLOBAL INC	10,687	40.33	431,006.71
CHECK POINT SOFTWARE TECH	11,974	118.73	1,421,673.02
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	152.68	1,594,589.92
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	52,296	55.28	2,890,922.88
COUPA SOFTWARE INC	6,059	312.22	1,891,740.98
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,119	117.46	1,071,117.74
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	109.75	340,225.00

DATADOG INC - CLASS A	9,168	96.10	881,044.80
DOCUSIGN INC	15,817	212.42	3,359,847.14
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	22.40	542,460.80
DYNATRACE INC	14,169	44.06	624,286.14
EPAM SYSTEMS INC	5,266	262.10	1,380,218.60
FAIR ISAAC CORP	3,001	421.76	1,265,701.76
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	57,789	135.79	7,847,168.31
FISERV INC	55,147	94.82	5,229,038.54
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,052	253.33	2,039,813.16
FORTINET INC	13,898	149.60	2,079,140.80
GARTNER INC	8,569	118.16	1,012,513.04
GLOBAL PAYMENTS INC	28,687	164.16	4,709,257.92
GODADDY INC - CLASS A	16,351	70.65	1,155,198.15
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	117.44	930,477.12
INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,458	115.71	9,656,925.18
INTUIT INC	24,837	307.91	7,647,560.67
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	182.30	1,341,728.00
LEIDOS HOLDINGS	12,829	86.41	1,108,553.89
MASTERCARD INC-CLASS A	84,431	294.59	24,872,528.29
MICROSOFT CORP	683,327	214.32	146,450,642.64
MONGODB INC	4,623	236.60	1,093,801.80
NORTONLIFELOCK INC	50,376	20.08	1,011,550.08
OKTA INC	10,381	222.95	2,314,443.95
ORACLE CORP	214,169	57.53	12,321,142.57
PALO ALTO NETWORKS INC	9,363	248.58	2,327,454.54
PAYCHEX INC	30,214	72.88	2,201,996.32
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	314.01	1,493,117.55
PAYPAL HOLDINGS INC	105,027	183.23	19,244,097.21
PTC INC	9,984	85.00	848,640.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,050	295.64	2,084,262.00
SALESFORCE.COM INC	79,356	200.74	15,929,923.44
SERVICENOW INC	17,785	426.37	7,582,990.45
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	31,963	34.02	1,087,381.26
SPLUNK INC	14,752	204.85	3,021,947.20
SQUARE INC - A	33,186	129.39	4,293,936.54
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	56.35	1,227,021.25
SYNOPSIS INC	14,359	204.55	2,937,133.45
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,705	463.00	1,715,415.00
TWILIO INC - A	11,282	245.30	2,767,474.60
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	361.29	1,341,469.77
VERISIGN INC	10,096	212.50	2,145,400.00
VISA INC-CLASS A SHARES	161,051	192.21	30,955,612.71

VMWARE INC-CLASS A	7,867	147.99	1,164,237.33
WESTERN UNION CO	38,757	20.73	803,432.61
WIX.COM LTD	5,010	296.71	1,486,517.10
WORKDAY INC-CLASS A	15,669	197.56	3,095,567.64
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,002	269.52	2,695,739.04
AMPHENOL CORPORATION	27,456	94.49	2,594,317.44
APPLE INC	413,796	382.73	158,372,143.08
ARISTA NETWORKS INC	5,865	218.79	1,283,203.35
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	66.24	519,255.36
CDW CORP/DE	13,742	112.51	1,546,112.42
CISCO SYSTEMS	399,683	46.70	18,665,196.10
COGNEX CORP	16,230	62.27	1,010,642.10
CORNING	72,399	26.51	1,919,297.49
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	53.69	1,155,945.70
F5 NETWORKS INC	5,350	144.81	774,733.50
FLIR SYSTEMS INC	11,686	39.93	466,680.41
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	8.98	1,111,535.42
HP INC	141,556	16.41	2,322,933.96
IPG PHOTONICS CORP	3,207	164.08	526,204.56
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	22.74	711,852.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	99.83	1,759,403.92
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,366	130.93	2,142,800.38
NETAPP INC	20,586	42.30	870,787.80
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	46.78	1,068,268.08
TE CONNECTIVITY LTD	31,955	79.06	2,526,362.30
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	42.38	1,012,203.92
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	42.32	1,204,173.28
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	262.01	1,352,495.62
AT&T INC	676,285	29.54	19,977,458.90
CENTURYLINK INC	93,962	9.63	904,854.06
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	22.72	352,523.52
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,106	22.39	942,753.34
T-MOBILE US INC	51,428	106.17	5,460,110.76
T-MOBILE US INC - RIGHTS	41,028	0.18	7,737.88
VERIZON COMMUNICATIONS	390,010	53.94	21,037,139.40
AES CORP	61,761	13.92	859,713.12
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	48.25	1,165,527.00
AMEREN CORPORATION	23,120	73.65	1,702,788.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,150	82.02	3,867,243.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	130.69	2,211,536.18
ATMOS ENERGY CORP	11,419	97.69	1,115,522.11
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	18.95	912,669.90

CMS ENERGY CORP	26,742	58.99	1,577,510.58
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	71.71	2,276,433.95
DOMINION ENERGY INC	78,420	73.77	5,785,043.40
DTE ENERGY COMPANY	18,360	106.67	1,958,461.20
DUKE ENERGY CORP	69,920	79.74	5,575,420.80
EDISON INTL	33,630	53.93	1,813,665.90
ENERGY CORP	18,696	96.45	1,803,229.20
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	42.53	886,070.02
EVERGY INC	21,330	60.87	1,298,357.10
EVERSOURCE ENERGY	30,920	84.57	2,614,904.40
EXELON CORP	92,804	36.62	3,398,482.48
FIRSTENERGY CORP	50,559	40.19	2,031,966.21
NEXTERA ENERGY INC	45,973	251.99	11,584,736.27
NISOURCE INC	35,781	22.95	821,173.95
NRG ENERGY INC	23,078	32.31	745,650.18
OGE ENERGY CORP	19,225	29.97	576,173.25
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	76.25	821,365.00
PPL CORPORATION	69,904	24.40	1,705,657.60
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	49.79	2,354,569.10
SEMPRA ENERGY	27,061	116.29	3,146,923.69
SOUTHERN CO	98,387	51.94	5,110,220.78
UGI CORP	18,019	29.87	538,227.53
VISTRA CORP	46,057	19.00	875,083.00
WEC ENERGY GROUP INC	30,120	87.47	2,634,596.40
XCEL ENERGY INC	50,065	63.24	3,166,110.60
ADVANCED MICRO DEVICES	109,297	57.25	6,257,799.73
ANALOG DEVICES	35,161	124.25	4,368,754.25
APPLIED MATERIALS	88,168	63.49	5,597,786.32
BROADCOM INC	37,568	321.50	12,078,112.00
INTEL CORP	403,460	58.42	23,570,133.20
KLA CORP	15,075	203.59	3,069,119.25
LAM RESEARCH CORP	13,850	335.76	4,650,276.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	61,408	38.12	2,340,872.96
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,878	64.47	1,668,354.66
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	107.55	2,456,872.20
MICRON TECHNOLOGY	105,648	49.98	5,280,287.04
NVIDIA CORP	57,719	420.36	24,262,758.84
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,067	117.90	3,191,199.30
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	20.76	747,276.96
QORVO INC	10,609	113.11	1,199,983.99
QUALCOMM	107,369	93.25	10,012,159.25
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,107	132.73	2,137,882.11

	TERADYNE INC	16,048	88.46	1,419,606.08
	TEXAS INSTRUMENTS	87,799	130.43	11,451,623.57
	XILINX INC	23,543	100.23	2,359,714.89
	アメリカドル 小計	27,984,730		2,576,964,957.46 (276,070,255,892)
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	14.42	592,114.04
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,748	22.02	2,350,590.96
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	5.89	569,362.74
	ENBRIDGE	193,997	40.20	7,798,679.40
	IMPERIAL OIL	24,763	20.34	503,679.42
	INTER PIPELINE LTD	35,455	11.81	418,723.55
	KEYERA CORP	18,607	20.31	377,908.17
	PARKLAND CORP	17,004	32.75	556,881.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	31.89	1,716,192.24
	SUNCOR ENERGY	147,329	21.38	3,149,894.02
	TC ENERGY CORP	86,686	55.94	4,849,214.84
	AGNICO EAGLE MINES	23,423	90.07	2,109,709.61
	B2GOLD CORP	114,473	8.12	929,520.76
	BARRICK GOLD CORP	170,934	37.50	6,410,025.00
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	43.01	565,108.39
	FRANCO-NEVADA CORP	17,244	196.00	3,379,824.00
	KINROSS GOLD CORP	125,340	10.43	1,307,296.20
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,848	63.56	1,706,458.88
	LUNDIN MINING CORP	62,243	8.04	500,433.72
	NUTRIEN LTD	55,504	42.50	2,358,920.00
	PAN AMERICAN SILVER CORP	23,098	44.08	1,018,159.84
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	14.66	669,624.82
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,391	63.47	2,563,616.77
	YAMANA GOLD INC	106,274	7.60	807,682.40
	CAE INC	25,999	20.68	537,659.32
	WSP GLOBAL INC	9,471	81.81	774,822.51
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	12,370	56.04	693,214.80
	THOMSON REUTERS CORP	15,191	92.33	1,402,585.03
	AIR CANADA	19,591	16.20	317,374.20
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,459	120.79	8,027,582.61
	CP RAILWAY LIMITED	13,160	347.64	4,574,942.40
	MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	60.51	1,692,948.78
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,923	19.81	256,004.63
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	28,808	74.02	2,132,368.16
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.38	431,376.00
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	21.99	991,463.13
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	116.08	627,876.72

DOLLARAMA INC	26,700	45.95	1,226,865.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	84,121	45.45	3,823,299.45
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	32.24	491,756.72
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	66.86	1,197,262.02
METRO INC	24,937	56.45	1,407,693.65
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	100.10	688,988.30
SAPUTO INC	24,489	31.41	769,199.49
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	23.33	648,574.00
CANOPY GROWTH CORP	25,606	21.88	560,259.28
CRONOS GROUP INC	15,900	8.21	130,539.00
BANK MONTREAL	61,534	70.88	4,361,529.92
BANK NOVA SCOTIA	116,919	54.13	6,328,825.47
CANADIAN IMPERIAL BANK	42,951	90.11	3,870,314.61
NATIONAL BANK OF CANADA	33,228	60.08	1,996,338.24
ROYAL BANK OF CANADA	133,379	91.27	12,173,501.33
TORONTO-DOMINION BANK	173,449	58.74	10,188,394.26
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	126,501	44.12	5,581,224.12
CI FINANCIAL CORP	18,671	17.86	333,464.06
IGM FINANCIAL INC	7,685	32.22	247,610.70
ONEX CORP	6,603	58.75	387,926.25
TMX GROUP LTD	6,205	134.06	831,842.30
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	401.74	1,069,833.62
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	23.28	553,784.64
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	42.50	349,775.00
INTACT FINANCIAL CORP	13,043	130.74	1,705,241.82
MANULIFE FINANCIAL CORP	190,115	17.93	3,408,761.95
POWER CORP OF CANADA	51,551	23.35	1,203,715.85
SUN LIFE FINANCIAL INC	56,979	48.96	2,789,691.84
BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.55	258,070.00
CGI INC - CL A	23,396	86.95	2,034,282.20
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,978	1,629.34	3,222,834.52
OPEN TEXT CORP	24,643	58.59	1,443,833.37
SHOPIFY INC - CLASS A	9,799	1,412.79	13,843,929.21
BCE INC	15,355	54.84	842,068.20
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	52.99	1,855,603.82
TELUS CORP	32,908	22.33	734,835.64
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.06	884,015.08
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	15.59	380,318.05
ATCO LTD -CLASS I	5,241	40.06	209,954.46
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.97	340,382.28
EMERA INC	23,704	52.89	1,253,704.56
FORTIS INC	42,633	51.28	2,186,220.24

	HYDRO ONE LTD	32,299	26.09	842,680.91
	カナダドル 小計	3,660,368		168,328,784.49 (13,260,941,642)
ユーロ	ENI	248,488	8.43	2,095,747.79
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	10.42	512,601.48
	NESTE OIL OYJ	40,117	35.06	1,406,502.02
	OMV AG	14,984	29.30	439,031.20
	REPSOL SA	133,012	7.53	1,001,846.38
	REPSOL SA-RTS	133,012	0.44	58,924.31
	TENARIS SA	40,648	5.54	225,433.80
	TOTAL SA	231,499	33.16	7,676,506.84
	VOPAK	6,360	48.32	307,315.20
	AIR LIQUIDE	45,301	132.20	5,988,792.20
	AKZO NOBEL	19,521	81.94	1,599,550.74
	ARCELORMITTAL	66,229	9.59	635,268.56
	ARKEMA	7,535	85.60	644,996.00
	BASF SE	88,020	49.61	4,367,112.30
	COVESTRO AG	15,098	34.93	527,373.14
	CRH PLC	72,257	31.39	2,268,147.23
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	23.37	461,650.98
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	36.66	211,234.92
	HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	46.94	696,261.02
	KONINKLIJKE DSM NV	15,650	125.25	1,960,162.50
	LANXESS	7,293	47.00	342,771.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	27.16	531,385.40
	SOLVAY SA	6,906	69.84	482,315.04
	STORA ENSO OYJ R	54,792	10.51	576,137.88
	SYMRISE AG	12,476	106.15	1,324,327.40
	THYSSEN KRUPP	33,044	6.28	207,516.32
	UMICORE	17,605	43.20	760,536.00
	UPM KYMMENE OYJ	50,623	24.36	1,233,176.28
	VOESTALPINE AG	12,422	19.29	239,620.38
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,018	22.78	501,570.04
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	22,018	1.45	31,948.11
	AIRBUS SE	56,107	63.22	3,547,084.54
	ALSTOM	18,760	42.20	791,672.00
	ANDRITZ AG	5,242	31.64	165,856.88
	BOUYGUES ORD	19,381	31.79	616,121.99
	BRENTAG AG	15,254	50.68	773,072.72
	CNH INDUSTRIAL NV	93,026	5.91	550,155.76
	DASSAULT AVIATION SA	213	814.50	173,488.50
	EIFFAGE	7,209	78.02	562,446.18

FERROVIAL SA	46,711	23.12	1,079,958.32
GEA GROUP AG	13,382	30.16	403,601.12
HOCHTIEF AG	2,222	79.70	177,093.40
KINGSPAN GROUP PLC	15,306	61.45	940,553.70
KION GROUP AG	5,887	57.52	338,620.24
KNORR-BREMSE AG	4,123	91.74	378,244.02
KONE OYJ-B	32,286	61.78	1,994,629.08
LEGRAND SA	24,584	68.36	1,680,562.24
LEONARDO SPA	35,425	5.60	198,663.40
MTU AERO ENGINES AG	4,753	147.00	698,691.00
PRYSMIAN SPA	21,155	21.37	452,082.35
SAFRAN SA	29,413	88.28	2,596,579.64
SAINT-GOBAIN	46,472	31.50	1,463,868.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,023	95.90	5,084,905.70
SIEMENS	73,180	105.72	7,736,589.60
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	17.12	429,871.75
THALES SA	9,665	70.74	683,702.10
VINCI S.A.	49,409	79.58	3,931,968.22
WARTSILA OYJ	34,386	7.08	243,452.88
BUREAU VERITAS SA	25,073	19.18	480,900.14
RANDSTAD NV	12,365	40.09	495,712.85
TELEPERFORMANCE	5,732	223.50	1,281,102.00
WOLTERS KLUWER	25,709	69.64	1,790,374.76
ADP	2,382	91.35	217,595.70
AENA SME SA	6,542	120.00	785,040.00
ATLANTIA SPA	51,427	13.11	674,465.10
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.72	202,978.38
DEUTSCHE POST AG-REG	91,113	34.12	3,108,775.56
FRAPORT AG	3,561	37.30	132,825.30
GETLINK	44,101	13.28	585,661.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,973	57.44	1,836,529.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	43.48	217,008.68
CONTINENTAL AG	9,928	83.44	828,392.32
DAIMLER AG	78,738	36.15	2,846,378.70
FAURECIA	5,945	33.56	199,514.20
FERRARI NV	11,392	154.70	1,762,342.40
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	111,379	8.63	961,312.14
MICHELIN	16,459	91.20	1,501,060.80
PEUGEOT SA	52,883	13.71	725,290.34
PIRELLI & C SPA	39,097	3.64	142,352.17
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	52.04	730,017.12
RENAULT SA	17,362	21.60	375,019.20

VALEO SA	19,350	22.73	439,825.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,999	135.60	2,440,664.40
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	143.40	466,193.40
ADIDAS AG	17,675	235.70	4,165,997.50
ESSILORLUXOTTICA	27,287	117.20	3,198,036.40
HERMES INTERNATIONAL	3,057	766.40	2,342,884.80
KERING	7,275	498.40	3,625,860.00
LVMH	26,074	400.95	10,454,370.30
MONCLER SPA	20,700	34.16	707,112.00
PUMA SE	7,720	69.12	533,606.40
SEB SA	2,075	144.50	299,837.50
ACCOR	17,931	23.82	427,116.42
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,877	119.00	1,413,363.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,540	27.28	287,531.20
SODEXO	8,135	59.54	484,357.90
ALTICE NV -A	50,000	3.59	179,800.00
BOLLORE	61,805	2.78	172,188.73
JC DECAUX SA	9,522	15.70	149,495.40
PUBLICIS GROUPE	21,469	26.90	577,516.10
SCOUT24 AG	11,366	72.45	823,466.70
SES	31,369	5.83	182,944.00
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	36.10	180,427.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	78.84	734,079.24
VIVENDI	77,307	23.11	1,786,564.77
DELIVERY HERO SE	11,471	99.08	1,136,546.68
INDITEX	101,980	23.18	2,363,896.40
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	94.60	1,075,791.20
PROSUS	45,138	88.20	3,981,171.60
ZALANDO SE	13,985	65.90	921,611.50
CARREFOUR	59,235	13.24	784,271.40
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,810	29.54	171,627.40
COLRUYT SA	5,424	48.50	263,064.00
JERONIMO MARTINS	24,901	15.32	381,483.32
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	24.11	2,489,695.04
METRO AG	13,712	8.17	112,136.73
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,855	45.26	3,297,781.57
DANONE (GROUPE)	59,282	59.76	3,542,692.32
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	64,414	8.12	523,041.68
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	74.15	793,479.15
HEINEKEN NV	24,387	83.00	2,024,121.00
KERRY GROUP PLC-A	14,641	106.10	1,553,410.10
PERNOD-RICARD	19,514	140.50	2,741,717.00

REMY COINTREAU	2,382	127.40	303,466.80
BEIERSDORF AG	9,190	95.00	873,050.00
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	73.10	744,889.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,238	82.62	1,424,203.56
LOREAL	24,042	286.70	6,892,841.40
UNILEVER NV	136,472	46.44	6,337,759.68
BIOMERIEUX	4,175	127.90	533,982.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	89.55	307,156.50
DIASORIN SPA	2,070	171.50	355,005.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	74.72	1,493,279.20
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,407	44.29	1,789,626.03
KONINKLIJKE PHILIPS	89,000	41.93	3,731,770.00
ORPEA	5,633	100.75	567,524.75
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	317.00	1,028,982.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,846	41.83	621,082.41
BAYER	94,130	63.34	5,962,194.20
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	549.20	635,973.60
GALAPAGOS NV	4,368	177.85	776,848.80
GRIFOLS SA	27,685	26.47	732,821.95
IPSEN	2,722	77.75	211,635.50
MERCK KGAA	12,078	110.55	1,335,222.90
ORION OYJ-CLASS B	9,854	45.81	451,411.74
QIAGEN N.V.	21,801	38.59	841,300.59
RECORDATI SPA	11,472	46.15	529,432.80
SANOFI	105,868	89.18	9,441,308.24
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	240.80	723,363.20
UCB (GROUPE)	12,416	107.90	1,339,686.40
ABN AMRO BANK NV-CVA	29,696	7.79	231,569.40
BANCO BILBAO VIZCAYA	647,435	3.07	1,990,862.62
BANCO SANTANDER SA	1,599,817	2.17	3,478,802.06
BANKINTER SA	58,881	4.12	243,060.76
BNP PARIBAS	104,161	35.51	3,698,757.11
CAIXABANK	328,697	1.95	641,452.19
COMMERZBANK AG	75,494	4.35	328,398.90
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	8.55	919,453.42
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	21.44	590,886.40
FINECOBANK SPA	53,120	12.46	662,140.80
ING GROEP NV-CVA	377,830	6.06	2,292,294.61
INTESA SANPAOLO	1,460,677	1.73	2,528,724.02
KBC GROEP NV	24,002	50.74	1,217,861.48
MEDIOBANCA	53,990	6.57	355,146.22
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	16.13	201,463.70

SOCIETE GENERALE	79,076	14.63	1,157,040.03
UNICREDIT SPA	190,988	8.29	1,584,818.42
AMUNDI SA	6,226	69.80	434,574.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	190,535	8.61	1,641,268.49
DEUTSCHE BOERSE	18,261	165.30	3,018,543.30
EURAZEO SA	3,357	44.42	149,117.94
EXOR NV	10,345	49.00	506,905.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,222	74.42	611,881.24
NATIXIS	114,996	2.28	262,190.88
SOFINA	1,781	244.00	434,564.00
WENDEL	2,023	79.70	161,233.10
AEGON	166,267	2.69	448,422.09
AGEAS	16,065	33.31	535,125.15
ALLIANZ SE-REG	38,899	180.56	7,023,603.44
ASSICURAZIONI GENERALI	109,307	13.39	1,464,167.26
AXA	185,927	17.91	3,331,068.13
CNP ASSURANCES	21,830	10.36	226,158.80
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	152.20	881,085.80
MAPFRE SA	90,939	1.57	142,865.16
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,866	226.70	3,143,422.20
NN GROUP NV	27,631	31.43	868,442.33
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.62	350,970.84
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	31.84	1,371,508.00
SCOR SE	13,354	23.54	314,353.16
AROUNDTOWN SA	111,346	5.13	571,204.98
DEUTSCHE WOHNEN SE	33,768	40.14	1,355,447.52
LEG IMMOBILIEN AG	5,781	116.74	674,873.94
VONOVIA SE	49,525	54.78	2,712,979.50
ADYEN NV	1,648	1,398.50	2,304,728.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	45.07	1,887,711.88
ATOS SE	9,750	77.10	751,725.00
CAPGEMINI SA	15,470	104.25	1,612,747.50
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	157.40	1,969,861.00
EDENRED	22,756	40.90	930,720.40
NEMETSCHKE SE	6,575	63.55	417,841.25
NEXI SPA	36,670	15.63	573,335.45
SAP SE	98,157	134.68	13,219,784.76
TEAMVIEWER AG	14,027	53.62	752,127.74
WORLDLINE SA	12,702	76.60	972,973.20
INGENICO GROUP	6,281	141.80	890,645.80
NOKIA OYJ	545,632	3.62	1,978,734.44
CELLNEX TELECOM SA	24,602	56.66	1,393,949.32

DEUTSCHE TELEKOM	319,355	14.74	4,708,889.47
ELISA A	11,943	55.78	666,180.54
ILIAD SA	1,253	178.15	223,221.95
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.28	281,880.00
KPN (KON.)	354,332	2.36	839,058.17
ORANGE	188,105	10.40	1,957,232.52
PROXIMUS	13,141	17.85	234,632.55
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.34	291,572.78
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.33	159,285.80
TELEFONICA	438,199	3.95	1,730,886.05
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	125,107	2.47	310,140.25
TELEFONICA SA-RTS	438,199	0.17	74,712.92
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	39.01	371,102.13
E.ON SE	216,142	10.00	2,161,420.00
ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	9.05	555,059.58
ELIA GROUP SA/NV	3,630	96.20	349,206.00
ENAGAS	25,299	20.85	527,484.15
ENDESA	31,750	23.41	743,267.50
ENEL	759,109	7.93	6,024,289.02
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	4.48	1,058,069.80
ENGIE	171,054	10.80	1,847,383.20
FORTUM OYJ	41,901	17.05	714,621.55
IBERDROLA SA	541,894	10.60	5,744,076.40
IBERDROLA SA-RTS	541,894	0.24	130,379.69
NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	16.64	502,278.40
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	16.90	669,780.80
RWE STAMM	56,470	31.86	1,799,134.20
SNAM SPA	203,694	4.45	908,271.54
SUEZ	28,043	10.41	292,067.84
TERNA SPA	130,230	6.15	801,695.88
UNIPER SE	20,192	29.60	597,683.20
VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	19.27	1,015,156.42
VERBUND AG	7,463	42.14	314,490.82
ASML HOLDING NV	40,029	344.35	13,783,986.15
INFINEON TECHNOLOGIES	122,254	21.65	2,647,410.37
STMICROELECTRONICS	56,957	24.12	1,373,802.84
ユーロ 小計	18,867,343		353,931,947.76 (42,740,822,011)
イギリスポンド			
BP PLC	1,938,116	2.90	5,620,536.40
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	383,729	12.31	4,724,471.44
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	357,320	11.81	4,220,663.84
ANGLO AMERICAN PLC	112,174	18.84	2,114,031.20

ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.89	354,687.55
BHP GROUP PLC	202,849	16.60	3,368,510.49
CRODA INTERNATIONAL PLC	13,429	53.22	714,691.38
EVRAZ PLC	43,000	2.88	123,926.00
GLENCORE PLC	901,837	1.73	1,564,867.56
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	20.76	349,764.48
MONDI PLC	47,780	14.37	686,598.60
RIO TINTO PLC REG	107,837	46.12	4,973,442.44
ASHTED GROUP PLC	42,021	25.81	1,084,562.01
BAE SYSTEMS PLC	308,746	4.77	1,475,497.13
BUNZL PLC	33,283	21.31	709,260.73
DCC PLC	9,127	67.30	614,247.10
FERGUSON PLC	22,288	65.24	1,454,069.12
MELROSE INDUSTRIES PLC	508,486	1.13	577,894.33
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,244	2.56	526,040.37
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.01	520,415.46
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	99.04	718,535.20
EXPERIAN PLC	87,481	27.89	2,439,845.09
INTERTEK GROUP PLC	15,404	53.98	831,507.92
RELX PLC	185,932	18.07	3,359,791.24
RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	5.21	944,440.25
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.32	513,408.01
BURBERRY GROUP PLC	40,410	15.76	636,861.60
PERSIMMON PLC	31,506	25.89	815,690.34
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.43	510,409.35
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	44.00	466,356.00
COMPASS GROUP PLC	162,339	10.99	1,784,105.61
GVC HOLDINGS PLC	59,240	8.34	494,535.52
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	37.20	596,725.20
WHITBREAD PLC	17,434	21.64	377,271.76
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.14	500,229.94
INFORMA PLC	158,400	4.32	685,555.20
ITV PLC	295,435	0.66	195,873.40
PEARSON	66,305	5.49	364,147.06
WPP PLC	113,065	5.75	650,802.14
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	6.50	208,256.00
KINGFISHER PLC	170,994	2.25	385,078.48
NEXT PLC	13,238	47.00	622,186.00
OCADO GROUP PLC	44,612	20.00	892,240.00
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.78	373,929.46
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.87	277,979.79
TESCO	919,600	2.11	1,945,873.60

	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	36,715	19.75	725,121.25	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	219,338	29.20	6,404,669.60	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.09	360,816.40	
	DIAGEO	224,511	27.01	6,065,164.66	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	14.05	1,284,394.80	
	RECKITT BENCKISER PLC	67,934	75.66	5,139,886.44	
	UNILEVER PLC	108,846	42.15	4,587,858.90	
	SMITH & NEPHEW PLC	83,051	15.20	1,262,375.20	
	ASTRAZENECA	123,279	84.80	10,454,059.20	
	GLAXOSMITHKLINE	470,077	15.92	7,487,386.45	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	21.42	352,444.68	
	BARCLAYS	1,669,454	1.11	1,869,120.69	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,902,680	3.73	7,102,704.44	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.29	1,973,544.06	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	479,086	1.18	565,561.02	
	STANDARD CHARTERED PLC	254,760	4.28	1,092,410.88	
	3I GROUP PLC	88,121	8.15	718,891.11	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.69	519,009.51	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	30,265	84.26	2,550,128.90	
	M&G PLC	229,107	1.71	392,689.39	
	SCHRODERS PLC	11,794	29.11	343,323.34	
	ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	9.35	418,591.50	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.57	601,283.67	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	22.40	364,112.00	
	AVIVA PIC	381,270	2.79	1,064,887.11	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.72	310,214.52	
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.12	1,170,228.60	
	PRUDENTIAL	246,816	12.32	3,042,007.20	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	4.12	357,142.32	
	AVEVA GROUP PLC	6,717	40.13	269,553.21	
	SAGE GROUP PLC	111,321	6.56	730,711.04	
	HALMA PLC	37,159	22.91	851,312.69	
	BT GROUP PLC	817,227	1.07	881,379.31	
	VODAFONE GROUP PLC	2,475,816	1.22	3,036,340.74	
	NATIONAL GRID PLC	334,044	8.50	2,839,374.00	
	SEVERN TRENT PLC	25,000	23.61	590,250.00	
	SSE PLC	100,354	12.87	1,291,555.98	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.62	578,850.24	
	イギリスポンド 小計	27,305,572		137,019,166.84 (18,483,885,606)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.66	307,335.67	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	745.00	605,685.00	

	GIVAUDAN-REG	849	3,576.00	3,036,024.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,484	41.79	1,984,356.36
	SIKA AG-BR	12,290	187.10	2,299,459.00
	ABB LTD	176,891	22.80	4,033,114.80
	GEBERIT AG-REG	3,423	482.40	1,651,255.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	235.40	497,164.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	235.20	886,233.60
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	44.48	588,203.52
	SGS SA	586	2,310.00	1,353,660.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	155.40	787,411.80
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	47,970	62.22	2,984,693.40
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	189.35	470,156.05
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	36.68	144,445.84
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,835.00	513,800.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	81,000.00	810,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,570.00	787,280.00
	NESTLE SA - REGISTERED	280,748	105.58	29,641,373.84
	ALCON INC	44,953	53.00	2,382,509.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	200.00	1,027,600.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	847.00	858,858.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,876	527.20	3,625,027.20
	NOVARTIS	202,202	81.90	16,560,343.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	66,209	332.95	22,044,286.55
	VIFOR PHARMA AG	4,486	141.35	634,096.10
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,550	90.80	322,340.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	220,884	9.65	2,133,297.67
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	40.28	853,009.56
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,811	879.40	1,592,593.40
	UBS GROUP AG	338,963	11.00	3,728,593.00
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	141.00	677,505.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,265	344.80	1,125,772.00
	SWISS RE LTD	28,362	73.04	2,071,560.48
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,328	335.10	4,801,312.80
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	86.60	645,862.80
	TEMENOS AG - REG	6,511	157.30	1,024,180.30
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17,151	62.40	1,070,222.40
	SWISSCOM	2,441	489.00	1,193,649.00
	スイスフラン 小計	1,621,022		121,754,271.94 (13,861,723,860)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	220.50	3,797,451.00
	BOLIDEN AB	23,903	232.00	5,545,496.00
	SCA SV CELLULOSA B	64,571	111.30	7,186,752.30

ALFA LAVAL AB	34,177	201.10	6,872,994.70	
ASSA ABLOY AB-B	90,383	195.60	17,678,914.80	
ATLAS COPCO A	63,684	401.50	25,569,126.00	
ATLAS COPCO B	36,538	351.70	12,850,414.60	
EPIROC AB-A	70,414	116.95	8,234,917.30	
EPIROC AB-B	29,972	115.35	3,457,270.20	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	18,468	171.80	3,172,802.40	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	33,536	213.10	7,146,521.60	
SANDVIK AB	101,932	177.50	18,092,930.00	
SKANSKA B	28,530	189.40	5,403,582.00	
SKF AB-B	35,405	177.75	6,293,238.75	
VOLVO B	134,889	152.05	20,509,872.45	
SECURITAS B	35,993	121.95	4,389,346.35	
ELECTROLUX AB-SER B	18,170	173.30	3,148,861.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	79.28	3,069,087.36	
EVOLUTION GAMING GROUP	13,521	669.40	9,050,957.40	
HENNES & MAURITZ B	77,319	136.55	10,557,909.45	
ICA GRUPPEN AB	7,959	444.70	3,539,367.30	
SWEDISH MATCH AB	16,014	661.60	10,594,862.40	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	294.70	16,822,949.50	
NORDEA BANK ABP	309,938	64.96	20,133,572.48	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	84.28	13,123,238.80	
SVENSKA HANDELSBK A	150,386	88.92	13,372,323.12	
SWEDBANK AB-A	86,716	130.70	11,333,781.20	
EQT AB	27,735	181.55	5,035,289.25	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	216.30	3,632,109.60	
INVESTOR AB-B SHS	43,938	502.40	22,074,451.20	
KINNEVIK AB - B	23,604	260.00	6,137,040.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	419.60	3,054,688.00	
ERICSSON (LM) B	263,755	85.48	22,545,777.40	
HEXAGON AB-B SHS	26,504	554.20	14,688,516.80	
TELE2 AB-B SHS	50,012	119.70	5,986,436.40	
TELIA CO AB	257,822	34.64	8,930,954.08	
スウェーデンクローナ 小計	2,468,589		363,033,803.19 (4,200,301,102)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	92,158	137.70	12,690,156.60
	NORSK HYDRO	106,150	27.10	2,876,665.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	332.00	6,132,040.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	226.00	1,575,446.00
	MOWI ASA	40,968	170.85	6,999,382.80
	ORKLA	69,804	83.94	5,859,347.76
	DNB ASA	96,834	127.40	12,336,651.60

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	183.60	3,410,186.40	
	TELENOR ASA	71,821	140.75	10,108,805.75	
	ノルウェークローネ 小計	521,750		61,988,681.91 (699,852,218)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	695.80	7,199,442.60	
	NOVOZYMES A/S	21,895	382.30	8,370,458.50	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,951	749.40	13,452,479.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	7,430.00	2,221,570.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	8,014.00	5,201,086.00	
	DSV PANALPINA A S	20,416	840.20	17,153,523.20	
	PANDORA A/S	8,431	394.80	3,328,558.80	
	CARLSBERG AS-B	10,388	871.00	9,047,948.00	
	AMBU A/S-B	18,085	234.10	4,233,698.50	
	COLOPLAST-B	11,223	1,060.50	11,901,991.50	
	DEMANT A/S	11,604	186.55	2,164,726.20	
	GN STORE NORD A/S	13,783	379.40	5,229,270.20	
	GENMAB A/S	6,320	2,334.00	14,750,880.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	246.00	1,198,266.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	166,015	432.80	71,851,292.00	
	DANSKE BANK A/S	57,713	94.70	5,465,421.10	
TRYG A/S	9,828	191.00	1,877,148.00		
ORSTED A/S	18,488	842.00	15,566,896.00		
	デンマーククローネ 小計	408,306		200,214,656.00 (3,245,479,573)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	27.92	575,961.68	
	OIL SEARCH LTD	222,327	3.13	695,883.51	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.86	970,386.70	
	SANTOS	156,437	5.29	827,551.73	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	19.92	255,234.96	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	21.65	1,966,447.85	
	BHP GROUP LTD	281,528	36.46	10,264,510.88	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	10.69	527,316.32	
	EVOLUTION MINING LTD	174,295	6.32	1,101,544.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	171,404	14.87	2,548,777.48	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	26.71	1,154,619.88	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	33.69	2,496,361.62	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	78,732	14.90	1,173,106.80	
	ORICA LTD	44,211	16.45	727,270.95	
	RIO TINTO LTD	35,522	98.67	3,504,955.74	
	SOUTH32 LTD	481,840	2.09	1,007,045.60	
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	22.98	211,875.60		
BRAMBLES LTD	160,308	10.98	1,760,181.84		

	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.77	913,412.07	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	3.61	306,850.00	
	TRANSURBAN GROUP	262,342	13.73	3,601,955.66	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	24.80	1,308,249.60	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.04	274,165.12	
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	3.24	540,581.04	
	REA GROUP LTD	5,276	106.33	560,997.08	
	SEEK LTD	26,358	21.57	568,542.06	
	WESFARMERS LTD	109,322	45.65	4,990,549.30	
	COLES GROUP LTD	128,408	17.47	2,243,287.76	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	120,802	38.21	4,615,844.42	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.53	393,488.90	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	10.95	772,391.10	
	COCHLEAR LIMITED	6,220	192.05	1,194,551.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	63.62	1,033,697.76	
	SONIC HEALTHCARE LTD	47,360	30.90	1,463,424.00	
	CSL LIMITED	42,501	280.75	11,932,155.75	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	271,505	18.49	5,020,127.45	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	169,116	70.42	11,909,148.72	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	295,326	18.06	5,333,587.56	
	WESTPAC BANKING	334,568	17.91	5,992,112.88	
	AMP LTD	343,649	1.75	603,103.99	
	ASX LTD	16,798	84.65	1,421,950.70	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	32,981	121.67	4,012,798.27	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	62.41	681,017.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	5.59	1,170,294.45	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.95	796,087.00	
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	9.37	1,191,489.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	8.83	1,053,895.82	
	AFTERPAY LTD	22,862	73.50	1,680,357.00	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	13.34	591,975.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	21.07	379,260.00	
	TELSTRA CORP	403,126	3.51	1,414,972.26	
	TPG TELECOM LTD	31,475	8.73	274,776.75	
	TUAS LTD	15,737	0.80	12,668.28	
	AGL ENERGY LTD	64,235	16.97	1,090,067.95	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.68	314,403.60	
	オーストラリアドル 小計	6,667,806		113,427,271.80 (8,436,720,476)	
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	136,010	6.25	850,062.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	20.65	1,380,535.10	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	35.20	1,919,104.00	

	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.75	463,041.75	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.60	916,081.86	
	MERCURY NZ LTD	85,000	4.68	397,800.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.69	518,451.36	
	ニュージーランドドル 小計	688,177		6,445,076.57 (452,444,375)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	51.35	13,171,069.60	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	6.72	1,095,360.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	78.95	10,618,775.00	
	MTR CORP	151,000	40.10	6,055,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	211,000	51.55	10,877,050.00	
	SANDS CHINA LTD	242,800	30.45	7,393,260.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.46	1,116,720.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	13.26	1,867,008.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	193,100	23.70	4,576,470.00	
	WH GROUP LTD	936,500	7.29	6,827,085.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	18.04	1,969,246.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	23.45	8,453,725.00	
	HANG SENG BANK	74,200	131.10	9,727,620.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	115,000	370.60	42,619,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,134,400	76.50	86,781,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	257,996	46.90	12,100,012.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	21.60	3,736,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	30.20	3,781,885.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	19.94	1,286,130.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	155,375	40.00	6,215,000.00	
	SINO LAND CO	315,400	10.06	3,172,924.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	98.15	12,955,800.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	42.55	1,723,275.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.58	1,787,396.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140,000	33.40	4,676,000.00	
	WHELOCK & CO LTD	82,000	61.30	5,026,600.00	
	PCCW LTD	357,000	4.37	1,560,090.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	40.60	2,740,500.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	74.85	11,751,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	11.84	12,202,055.36	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	43.50	5,981,250.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	100.40	2,379,480.00	
	香港ドル 小計	7,709,934		306,225,737.36 (4,232,039,690)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	116,500	6.06	705,990.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,500	3.35	366,825.00	

	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	199,900	0.94	188,905.50	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	3.81	412,744.92	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.77	473,550.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	20.48	202,752.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.26	760,836.00	
	DBS GROUP	174,800	21.65	3,784,420.00	
	OCBC BANK	315,600	9.25	2,919,300.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	105,200	21.00	2,209,200.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	8.35	653,805.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	2.91	650,385.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.71	372,788.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.89	327,275.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.76	430,732.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.51	1,888,129.93	
	シンガポールドル 小計	3,103,375		16,347,638.35	(1,256,806,436)
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	10.56	715,503.36	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	457.00	980,722.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	20.71	2,036,000.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	17.67	2,485,373.85	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	11.16	1,110,420.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	70.80	885,212.40	
	AZRIELI GROUP	4,323	156.30	675,684.90	
	NICE LTD	6,172	661.00	4,079,692.00	
	イスラエルシェケル 小計	431,365		12,968,608.61	(402,415,925)
	合 計	101,438,337		387,343,688,806	(387,343,688,806)

(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	1,253,966.48	
		LENLEASE GROUP	55,692	650,482.56	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	481,649.60	
		オーストラリアドル 小計	259,965	2,386,098.64	(177,478,016)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,733,130.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,290,000.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,023,130.00	(83,239,656)
				855,465	260,717,672

投資信託受益証券合計			(260,717,672)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	586,114.20
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,175	1,813,143.75
		AMERICAN TOWER CORPORATION	41,635	11,058,256.00
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	809,612.42
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,023,635.80
		BOSTON PROPERTIES	14,788	1,257,867.28
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	778,968.32
		CROWN CASTLE INTL CORP	39,669	6,809,183.85
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,689,129.73
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,257,936.00
		EQUINIX INC	8,137	5,929,350.53
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,062,249.32
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,011,900.67
		ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,415,174.40
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,173,653.67
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	572,359.59
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,101	1,265,132.86
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	711,621.59
		INVITATION HOMES INC	51,458	1,408,405.46
		IRON MOUNTAIN INC	27,546	721,154.28
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	901,148.36
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,228,592.40
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	545,985.40
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	635,906.10
		PROLOGIS INC	70,356	6,794,278.92
		PUBLIC STORAGE	15,009	2,932,308.33
		REALTY INCOME CORP	30,398	1,736,333.76
		REGENCY CENTERS CORP	17,800	749,736.00
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,751	3,308,942.78
		SIMON PROPERTY GROUP	27,990	1,707,949.80
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,252,420.40
		UDR INC	28,059	1,009,562.82
		VENTAS INC	33,353	1,145,008.49
		VEREIT INC	105,798	649,599.72
VICI PROPERTIES INC	44,224	875,192.96		
VORNADO REALTY TRUST	15,390	537,418.80		
WELLTOWER INC	38,031	1,871,125.20		
WP CAREY INC	16,500	1,090,320.00		
	アメリカドル 小計	1,202,181	75,326,679.96	(8,069,747,224)
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	422,310.24

	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	164,787.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	228,632.40	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	113,633.58	
	カナダドル 小計	42,473	929,363.52 (73,215,258)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	317,816.10	
	GECINA SA	4,459	475,775.30	
	ICADE	2,845	168,139.50	
	KLEPIERRE	17,225	275,513.87	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	686,393.40	
	ユーロ 小計	43,186	1,923,638.17 (232,298,545)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	298,040.74	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	319,097.50	
	SEGRO PLC	106,999	975,830.88	
	イギリスポンド 小計	244,963	1,592,969.12 (214,891,534)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	852,455.40	
	GOODMAN GROUP	162,271	2,468,141.91	
	GPT GROUP	167,884	693,360.92	
	MIRVAC GROUP	392,919	836,917.47	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,031,725.56	
	STOCKLAND	207,412	684,459.60	
	VICINITY CENTERS	291,115	387,182.95	
	オーストラリアドル 小計	1,802,354	6,954,243.81 (517,256,654)	
香港ドル	LINK REIT	199,000	12,626,550.00	
	香港ドル 小計	199,000	12,626,550.00 (174,498,921)	
シンガポー ルドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	893,240.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	427,680.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	404,606.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	431,200.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	311,900	630,038.00	
	SUNTEC REIT	173,000	249,120.00	
	シンガポールドル 小計	1,422,200	3,035,884.00 (233,398,761)	
	投資証券合計	4,956,357	9,515,306,897 (9,515,306,897)	
	合計		9,776,024,569 (9,776,024,569)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 590銘柄	97.2%			69.5%
	投資証券 38銘柄			2.8%	2.0%
カナダドル	株式 80銘柄	99.5%			3.3%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 243銘柄	99.5%			10.8%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 84銘柄	98.9%			4.7%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 36銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 55銘柄	92.4%			2.1%
	投資信託受益証券 3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.7%	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 32銘柄	94.3%			1.1%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	84.3%			0.3%
	投資証券 6銘柄			15.7%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	145,832,633
コール・ローン	3,073,443,913
国債証券	278,903,259,555
派生商品評価勘定	35,935,267
未収入金	19,546,251
未収利息	1,698,686,313
前払費用	120,170,605
差入委託証拠金	523,580,637
流動資産合計	284,520,455,174
資産合計	284,520,455,174
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,286,463
前受金	31,180,007
未払金	11,214,658
未払解約金	48,598,591
未払利息	1,650
その他未払費用	7,888
流動負債合計	101,289,257
負債合計	101,289,257
純資産の部	
元本等	
元本	96,491,687,491
剰余金	
剰余金又は欠損金()	187,927,478,426
元本等合計	284,419,165,917
純資産合計	284,419,165,917
負債純資産合計	284,520,455,174

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月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> <p>(1)先物取引</p>

	2020年 7月10日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,491,687,491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 2.9476円 (1万口当たり純資産額) (29,476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 7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。

	2020年 7月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7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>

	2020年 7月10日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	135,846,616,975円
期中追加設定元本額	20,514,549,222円
期中一部解約元本額	59,869,478,706円
期末元本額	96,491,687,491円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,615,114,821円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	635,580,596円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	427,119,141円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,031,066,074円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,930,937円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,549,317,022円
世界経済インデックスファンド	6,752,120,784円
DCマイセレクション25	1,770,271,647円
DCマイセレクション50	1,424,503,703円
DCマイセレクション75	866,808,354円
DC外国債券インデックス・オープン	2,006,573,489円
DCマイセレクションS25	750,651,336円
DCマイセレクションS50	606,284,818円
DCマイセレクションS75	277,307,938円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	44,267,693円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	69,558,162円

区分	2020年 7月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	33,780,355円
DC世界経済インデックスファンド	8,651,479,585円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	552,648,476円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	30,253,357円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,580,123円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,876,546円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	38,870,205円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	80,578,279円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	120,180,214円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	125,758,699円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	219,256,461円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,817,368,944円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	515,478,671円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,975,578,480円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	760,351,349円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	67,707,556円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	536,271,469円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	30,955,203円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	210,722,034円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	262,309,886円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	868,072,584円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	2,034,705,837円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	787,265,244円
外国債券ファンド・シリーズ1	595,518,189円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンドA	1,698,682,884円
分散投資コア戦略ファンドS	6,316,052,062円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	319,120,974円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,041,052,727円
コア投資戦略ファンド(切替型)	563,477,235円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	197,338,209円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	97,115,911円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,083,263,746円
SMT インデックスバランス・オープン	189,970,145円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	19,920,087,812円
SMT 世界経済インデックス・オープン	107,929,901円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	108,011,146円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	188,936,954円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,945,510円
グローバル経済コア	822,231,988円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	9,259,587円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	225,896円

区分	2020年 7月10日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	218,715,325円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,162,672円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	189,281円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	263,729円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	98,636円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	150,337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）	637,235,761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）	10,299,736,062円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	343,843,213円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	363,490,155円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	67,495,958円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7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	1,981,500,867
合計	1,981,500,867

(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 7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	3,160,442,055	-	3,191,622,062	31,180,007
	合計	3,160,442,055	-	3,191,622,062	31,180,007

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2020年 7月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	2,992,562,703	-	2,987,031,500	5,531,203
	アメリカドル	1,336,155,055	-	1,336,857,600	702,545
	カナダドル	144,237,016	-	143,361,400	875,616
	ユーロ	1,284,071,071	-	1,278,848,400	5,222,671
	イギリスポンド	228,099,561	-	227,964,100	135,461
	合計	2,992,562,703	-	2,987,031,500	5,531,203

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,172,203.12	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	8,039,375.04	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,299,532.84	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,950,335.95	
		T 0.625% 05/15/30	3,100,000.00	3,104,601.57	
		T 1.125% 05/15/40	5,500,000.00	5,539,531.25	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	5,051,269.55	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,833,031.26	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,698,763.66	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,143,359.40	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,178,125.00	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,593,847.65	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,153,906.24	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,137,500.00	

T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,594,042.98	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	7,019,444.56	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,074,523.41	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,145,312.52	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,281,640.60	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,963,062.50	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,951,230.49	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,675,226.60	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,642,460.95	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,871,190.21	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,041,992.19	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,577,148.45	
T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	16,030,304.68	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,156,640.65	
T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,237,500.00	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,852,917.98	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,566,707.09	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,451,875.80	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,855,833.96	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,565,185.55	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,811,692.34	
T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,658,554.71	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,911,625.00	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,855,905.86	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,836,126.97	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,219,296.91	
T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,060,750.00	
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,586,500.00	
T 1.75% 07/31/21	6,700,000.00	6,812,800.79	
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,331,859.37	
T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,184,234.37	
T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,186,894.54	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,570,263.67	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,662,529.29	
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,588,106.46	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,317,812.50	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,653,045.31	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,147,031.24	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,406,640.64	
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,761,516.39	
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,745,089.88	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,529,093.75	

T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,455,804.71
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,926,093.75
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,927,239.46
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,613,468.74
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,479,484.41
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,643,261.70
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,233,085.96
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,168,062.51
T 2.125% 08/15/21	5,370,000.00	5,485,580.87
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,547,441.43
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,634,062.48
T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,051,418.77
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,601,376.94
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,577,895.29
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,291,406.24
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	10,011,414.06
T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,147,421.88
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,541,406.25
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,066,445.32
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,619,418.01
T 2.25% 08/15/46	10,790,000.00	13,071,916.46
T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	12,549,187.50
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,841,898.46
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	11,030,591.77
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,850,484.36
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,630,753.94
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,820,449.23
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,146,812.50
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,282,031.25
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,214,275.01
T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,480,234.35
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,150,859.37
T 2.375% 05/15/29	15,010,000.00	17,367,039.06
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,594,726.62
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	9,478,125.00
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,730,292.98
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,813,843.75
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,508,593.75
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,091,128.91
T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,547,642.18
T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,748,515.62
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,306,763.68
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,592,175.80

T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	6,396,140.62	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,876,853.52	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,280,097.25	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,735,128.12	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,490,726.56	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,052,597.69	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,256,015.62	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,433,750.00	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,794,492.20	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,544,771.87	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,274,335.93	
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,674,375.00	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,860,015.61	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,168,271.89	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,168,593.75	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,078,398.44	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,312,597.67	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,915,468.75	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,605,542.99	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,763,039.09	
T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,367,265.64	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,643,307.79	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,477,390.64	
T 2.75% 11/15/47	6,050,000.00	8,089,039.05	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,497,031.24	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,584,950.00	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,851,914.06	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,700,089.87	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,301,827.33	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,167,880.48	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,586,925.00	
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,777,789.08	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,160,800.80	
T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,498,652.38	
T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	5,987,265.62	
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,655,623.02	
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,384,626.58	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,573,535.15	
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,237,890.65	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,132,834.37	
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,864,062.50	
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,652,715.21	

T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,553,125.04
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,886,718.75
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,113,671.89
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,483,455.06
T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,818,452.33
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,786,063.46
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,424,218.80
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,459,671.87
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,238,007.86
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,087,812.50
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,259,726.56
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,243,917.98
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,830,000.00
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,727,609.37
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,459,932.81
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,178,437.50
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,409,121.10
T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,494,400.00
T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	10,951,710.97
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,103,265.62
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,577,125.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,973,750.00
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,993,750.00
T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	8,331,210.96
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,190,972.66
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,891,343.76
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	6,225,132.81
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,873,281.25
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,195,226.57
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,790,625.00
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,943,591.43
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,654,695.31
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,786,359.39
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,707,031.25
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	8,255,414.06
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,407,937.50
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,724,382.81
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,571,484.38
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	3,042,375.00
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,147,421.87
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	2,007,435.94
T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,456,674.22
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,552,250.00

	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,741,914.07	
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,910,265.62	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,262,050.78	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,822,132.81	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,747,558.60	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,804,156.25	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,908,851.56	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,676,906.25	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,233,375.00	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,046,765.62	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,622,085.93	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,960,728.51	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,880,093.75	
	アメリカドル 小計	1,053,490,000.00	1,183,457,428.44	(126,783,794,308)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,048,538.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,500,000.00	2,519,987.50	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,716,510.50	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,040,000.00	3,250,930.40	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,905,126.20	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,233,764.40	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,108,546.75	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,451,310.40	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	629,586.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,762,030.70	
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	520,750.00	
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,539,687.50	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,463,530.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,970,721.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,531,256.75	
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,954,394.40	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,845,224.15	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,798,928.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	895,563.20	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,470,514.30	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,222,441.90	
	CAN 2% 12/01/51	1,830,000.00	2,286,987.60	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,308,172.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,550,000.00	2,431,508.25	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,706,719.95	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,597,816.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,330,000.00	2,192,790.95	

	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,803,175.50	
	カナダドル 小計	56,960,000.00	66,166,512.80 (5,212,597,878)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,699,478.00	
	MBONO 10% 12/05/24	25,860,000.00	30,992,692.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,261,395.05	
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,126,279.10	
	MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,099,570.00	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,256,520.60	
	MBONO 7.5% 06/03/27	41,630,000.00	46,385,603.05	
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	19,199,256.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	27,101,387.45	
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	17,925,179.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,906,595.35	
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,828,034.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,422,674.90	
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	24,599,755.20	
	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,653,982.70	
	メキシコペソ 小計	392,570,000.00	439,458,404.20 (2,074,243,667)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,060,000.00	1,087,385.10	
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,549,531.80	
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	695,254.35	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,692,567.90	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,322,800.90	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,827,084.35	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,698,379.80	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,708,572.75	
	BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,364,573.75	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	988,367.25	
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	637,963.65	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,877,890.60	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,312,945.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,647,859.20	
	BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,583,811.30	
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,668,837.25	
	BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,495,845.50	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,470,000.00	1,595,001.45	
	BGB 2.25% 06/22/57	680,000.00	1,046,659.40	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,747,269.20	
BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,303,489.50		
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,451,429.65		
BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	4,092,719.40		

BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,488,168.25
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,328,595.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,465,812.00
BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,317,593.90
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,595,959.20
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,043,301.50
BGB 5% 03/28/35	2,920,000.00	5,009,960.80
BKO 0% 03/11/22	6,040,000.00	6,108,372.80
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,025,097.55
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	574,214.50
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,594,164.20
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,195,204.55
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,249,178.75
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,232,692.60
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,039,620.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,630,426.10
BTPS 0.95% 08/01/30	650,000.00	633,470.50
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,049,426.15
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,999,998.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	1,015,180.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,965,337.00
BTPS 1.45% 03/01/36	550,000.00	537,201.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,388,527.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,080,166.50
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,494,068.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,511,448.95
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,333,228.30
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,104,393.60
BTPS 1.65% 12/01/30	1,820,000.00	1,884,555.40
BTPS 1.75% 07/01/24	1,600,000.00	1,678,880.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,106,750.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,851,227.00
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,200,435.20
BTPS 2.05% 08/01/27	1,740,000.00	1,870,108.50
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,438,576.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,578,775.00
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,472,682.80
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,504,765.35
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,780,473.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,781,450.00
BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	923,448.45
BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,163,426.00
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,227,137.75

BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,195,853.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,814,048.85	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,483,396.20	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,151,245.25	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,750,000.00	3,230,851.25	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,770,392.25	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,234,356.30	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,700,393.20	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,395,243.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,310,000.00	2,827,474.65	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,701,092.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,787,422.20	
BTPS 3.75% 08/01/21	1,660,000.00	1,727,462.40	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,430,682.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,531,335.50	
BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,753,724.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,154,250.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,506,951.20	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,007,165.60	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,575,355.60	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,167,625.25	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,671,628.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,316,533.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,557,284.20	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	4,959,256.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,840,443.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,394,125.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,873,401.25	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,578,127.40	
BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,516,743.75	
BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,282,728.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	4,877,125.20	
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,814,236.35	
BTPS 6.5% 11/01/27	5,240,000.00	7,252,448.20	
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,782,009.10	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,948,233.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,027,712.00	
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,394,113.20	
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,170,216.15	
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,332,447.40	
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,168,930.00	
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,203,070.00	

DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,598,121.20
DBR 0.5% 08/15/27	3,160,000.00	3,421,632.20
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,745,608.30
DBR 0% 05/15/35	810,000.00	842,553.90
DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,656,823.65
DBR 0% 08/15/29	4,640,000.00	4,870,793.60
DBR 0% 08/15/50	1,980,000.00	2,002,265.10
DBR 1.25% 08/15/48	3,050,000.00	4,181,809.25
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,132,434.80
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,319,193.00
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,487,878.90
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,934,806.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,798,706.25
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,191,908.40
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,142,080.00
DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,481,509.40
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,015,559.00
DBR 2.5% 07/04/44	3,320,000.00	5,452,685.00
DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,776,071.80
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,433,980.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,104,401.30
DBR 3.25% 07/04/21	4,100,000.00	4,257,419.50
DBR 3.25% 07/04/42	2,940,000.00	5,200,977.60
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,050,309.15
DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,629,648.15
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,667,116.75
DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,458,645.40
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,708,393.00
DBR 5.5% 01/04/31	3,580,000.00	5,884,428.10
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,445,409.80
DBR 6.25% 01/04/24	5,440,000.00	6,774,241.60
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,077,731.25
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,480,084.20
FRTR 0.25% 11/25/26	4,530,000.00	4,727,915.70
FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,283,365.40
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,382,904.05
FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,271,640.00
FRTR 0.5% 05/25/40	1,210,000.00	1,259,495.05
FRTR 0.75% 05/25/28	5,640,000.00	6,124,701.60
FRTR 0.75% 05/25/52	1,550,000.00	1,634,196.00
FRTR 0.75% 11/25/28	7,590,000.00	8,262,739.65
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,019,950.00
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,081,672.50

FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,189,662.65	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,376,465.05	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,078,877.00	
FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,215,392.15	
FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,096,858.50	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,364,516.20	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,975,250.75	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,213,423.35	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,393,865.60	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,330,000.00	4,233,695.40	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,902,831.45	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,569,652.50	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,446,238.40	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,402,387.60	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,099,864.25	
FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,927,935.20	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,553,460.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,118,179.90	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,160,000.00	6,548,375.40	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,790,188.50	
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,845,349.40	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,608,369.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,931,285.25	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,832,725.00	
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	9,041,637.75	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,830,905.70	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	8,947,188.60	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,243,543.20	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	5,002,284.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,960,000.00	4,316,508.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,690,025.95	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,834,437.05	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,478,622.90	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,564,297.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,256,255.00	
IRISH 0.2% 05/15/27	1,270,000.00	1,310,157.40	
IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	850,011.30	
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	495,064.80	
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	839,044.50	
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,163,924.60	
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,746.90	
IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	1,020,882.60	

IRISH 1.3% 05/15/33	630,000.00	728,223.30
IRISH 1.35% 03/18/31	630,000.00	722,465.10
IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	788,378.85
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	927,558.75
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,532,584.70
IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,742,104.00
IRISH 2% 02/18/45	1,170,000.00	1,599,407.55
IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,326,860.20
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,131,295.95
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,924,661.10
NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,502,504.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,694,008.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,250,000.00	1,390,493.75
NETHER 0.5% 07/15/26	1,860,000.00	1,978,770.30
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,296,218.05
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,778,695.20
NETHER 0% 01/15/22	980,000.00	989,261.00
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,891,486.25
NETHER 0% 01/15/27	800,000.00	826,360.00
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,662,711.40
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,282,676.20
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	698,768.40
NETHER 2.5% 01/15/33	1,930,000.00	2,605,924.60
NETHER 2.75% 01/15/47	2,220,000.00	3,859,736.40
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,202,601.65
NETHER 3.25% 07/15/21	2,740,000.00	2,846,490.10
NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,268,559.70
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,769,624.90
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,572,599.25
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,519,251.95
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	241,476.00
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,978,314.50
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,681,429.00
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,874,800.00
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,264,599.80
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,226,310.40
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,621,541.00
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,546,187.15
OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,421,087.50
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,253,497.05
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	946,795.35
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,761,288.30
RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	635,969.60

RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,305,593.20
RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,158,170.90
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,527,300.00
RAGB 0% 07/15/24	1,150,000.00	1,176,478.75
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,428.80
RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,813,699.40
RAGB 1.5% 02/20/47	830,000.00	1,102,364.50
RAGB 1.5% 11/02/86	450,000.00	698,865.75
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,086,000.30
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,433,427.45
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,530,567.80
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,382,450.55
RAGB 3.15% 06/20/44	890,000.00	1,517,396.60
RAGB 3.4% 11/22/22	2,990,000.00	3,276,651.30
RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,813,247.60
RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,248,484.80
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,093,043.75
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,073,133.70
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,714,744.15
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,738,653.30
RFGB 0.125% 04/15/36	510,000.00	520,006.20
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	413,022.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	656,282.40
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,398,228.50
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	718,179.70
RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	698,051.25
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	552,427.50
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	741,442.95
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	394,383.60
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	550,735.20
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	430,493.70
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	745,664.00
RFGB 1.375% 04/15/47	540,000.00	713,998.80
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	688,548.25
RFGB 1.625% 09/15/22	1,250,000.00	1,312,206.25
RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	888,091.35
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	526,438.50
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	802,784.65
RFGB 4% 07/04/25	1,050,000.00	1,293,657.75
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,942,844.15
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,339,051.80
SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,460,834.05

SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,425,802.20	
SPGB 0.45% 10/31/22	3,310,000.00	3,375,935.20	
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,946,762.50	
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,860,911.90	
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,228,292.00	
SPGB 0% 01/31/25	870,000.00	877,803.90	
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,402,788.50	
SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,768,952.00	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,309,661.75	
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,739,230.75	
SPGB 1.4% 04/30/28	4,430,000.00	4,861,349.10	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,626,766.00	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,158,584.00	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,853,305.00	
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,354,466.25	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,313,413.25	
SPGB 1.85% 07/30/35	1,820,000.00	2,117,096.80	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,143,223.85	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,905,099.10	
SPGB 1% 10/31/50	1,180,000.00	1,123,365.90	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,646,940.60	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,982,973.20	
SPGB 2.7% 10/31/48	2,070,000.00	2,838,508.20	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,066,542.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	3,050,010.95	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,800,000.00	3,045,222.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,914,821.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	4,184,502.40	
SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,038,558.20	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,534,025.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,518,624.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,838,192.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,590,000.00	4,481,036.70	
SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,516,887.05	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,470,017.25	
SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,329,707.50	
SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,204,003.00	
SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,701,708.40	
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,736,123.40	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,563,759.75	
ユーロ 小計	773,530,000.00	928,757,684.80	(112,156,778,016)
UKT 0.125% 01/31/23	1,090,000.00	1,094,910.45	

イギリスボ ンド	UKT 0.375% 10/22/30	480,000.00	488,577.60
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,583,117.20
	UKT 0.5% 10/22/61	340,000.00	334,871.10
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,515,005.00
	UKT 0.625% 10/22/50	800,000.00	797,892.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,984,161.35
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,956,429.20
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,252,237.95
	UKT 1.25% 10/22/41	950,000.00	1,071,785.25
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,188,190.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,620,565.90
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,488,860.00
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,446,071.00
	UKT 1.625% 10/22/71	1,530,000.00	2,332,362.60
	UKT 1.75% 01/22/49	1,840,000.00	2,376,047.20
	UKT 1.75% 07/22/57	2,030,000.00	2,822,369.90
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,244,363.20
	UKT 1.75% 09/07/37	3,530,000.00	4,244,101.35
	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,227,875.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,684,412.50
	UKT 2.5% 07/22/65	2,130,000.00	3,788,279.55
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,811,346.30
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,973,904.30
	UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,569,369.30
	UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	4,997,545.65
	UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,826,877.00
	UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	4,002,214.15
	UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,944,108.20
	UKT 4.25% 03/07/36	2,790,000.00	4,396,802.85
	UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	4,837,470.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,147,402.00
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	880,785.35
	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,871,144.50
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	4,092,034.40
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,724,859.25
	UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	5,005,677.60
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,777,545.95
	UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,466,400.60
	UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,274,803.00
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,316,497.50
UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	4,267,334.40	
UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,082,658.50	

	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,447,784.90
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,868,887.50
イギリスポンド 小計		97,130,000.00	135,125,938.50 (18,228,489,103)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,607,836.75
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,230,104.00
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,277,875.00
	SGB 1% 11/12/26	9,920,000.00	10,722,924.80
	SGB 2.5% 05/12/25	8,370,000.00	9,525,478.50
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,264,209.50
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,787,214.75
スウェーデンクローナ 小計		62,390,000.00	70,415,643.30 (814,708,992)
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	3,930,000.00	4,222,509.90
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,219,354.55
	NGB 1.75% 02/17/27	4,120,000.00	4,471,703.80
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,538,664.20
	NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,283,525.00
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,456,493.00
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,847,152.70
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	8,106,819.20
ノルウェークローネ 小計		49,170,000.00	53,146,222.35 (600,020,850)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,203,459.40
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,489,040.20
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,476,985.20
	DGB 1.5% 11/15/23	8,130,000.00	8,707,799.10
	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	10,038,570.20
	DGB 3% 11/15/21	9,800,000.00	10,272,213.00
	DGB 4.5% 11/15/39	16,940,000.00	31,982,550.60
デンマーククローネ 小計		70,130,000.00	89,170,617.70 (1,445,455,712)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	4,550,000.00	4,633,674.50
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,685,791.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,222,588.50
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,212,625.50
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,059,126.80
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,620,337.90
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,504,576.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,724,927.35
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,060,000.00	4,590,926.20
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,480,000.00	3,916,983.60
	POLGB 4% 10/25/23	3,730,000.00	4,182,150.60

	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	826,317.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,541,608.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,652,790.00	
	ポーランドズロチ 小計	57,280,000.00	62,374,423.45 (1,683,485,688)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,348,281.10	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,997,356.10	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,060,000.00	2,178,748.70	
	ACGB 1% 12/21/30	3,720,000.00	3,749,425.20	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,570,000.00	3,991,527.75	
	ACGB 2.25% 11/21/22	4,050,000.00	4,240,208.25	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,373,432.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,583,250.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	959,500.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,490,507.85	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,833,246.25	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,598,609.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,449,567.50	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,978,703.55	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,949,121.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,953,107.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,697,599.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,199,789.90	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,111,844.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,492,114.50	
ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,707,912.05		
ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,300,774.25		
ACGB 5.5% 04/21/23	3,720,000.00	4,259,139.60		
ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,718,466.50		
	オーストラリアドル 小計	72,630,000.00	83,162,233.15 (6,185,606,901)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,457,431.20	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	830,228.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	297,700.95	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	805,904.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	510,000.00	590,855.40	
	SIGB 2.375% 06/01/25	320,000.00	348,950.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	311,015.90	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,194,805.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,643,706.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	781,824.80	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,147,842.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	983,908.80	

	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	414,933.75
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	433,968.60
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	679,491.20
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,409,017.50
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,040,212.80
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,350,283.80
	シンガポールドル 小計	13,770,000.00	15,722,082.30 (1,208,713,687)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,544,580.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	736,778.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,840,000.00	2,950,447.60
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,615,556.55
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,269,586.40
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,081,408.50
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	366,299.50
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,558,387.50
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,746,959.10
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,522,607.50
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	774,075.00
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,107,213.95
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	803,792.05
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,227,903.20
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,156,726.45
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,572,811.20
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	651,027.00
	MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,773,986.05
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,104,591.50
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,045,939.00
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	790,039.00
	MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	475,057.55
	MGS 4.16% 07/15/21	2,030,000.00	2,076,943.75
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,380,761.60
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,258,700.00
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	900,027.45
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,716,317.80
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,729,205.50
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,750,957.50
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,703,147.00
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,700,238.20
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	961,416.00
MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,248,901.50	
MGS 4.935% 09/30/43	2,550,000.00	3,015,757.50	

	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,760,053.00	
	マレーシアリングット 小計	52,080,000.00	57,078,199.40 (1,431,521,240)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,843,899.25	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	930,000.00	999,375.48	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,080,000.00	1,117,457.52	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,160,000.00	2,459,228.04	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,618,043.06	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,420,000.00	3,570,887.38	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,289,750.26	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,610,691.42	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,226,198.16	
	イスラエルシェケル 小計	28,130,000.00	34,735,530.57 (1,077,843,513)	
	合計		278,903,259,555 (278,903,259,555)	

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 197銘柄	100.0%	45.5%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 318銘柄	100.0%	40.2%
イギリスポンド	国債証券 45銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 35銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 9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

項目	2020年 7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,809,485,502
コール・ローン	482,991,550
国債証券	55,684,073,438
未収利息	631,073,787
前払費用	64,127,209
流動資産合計	58,671,751,486
資産合計	58,671,751,486
負債の部	
流動負債	
未払金	271,548,585
未払解約金	22,277,410
未払利息	259
その他未払費用	1,991
流動負債合計	293,828,245
負債合計	293,828,245
純資産の部	
元本等	
元本	35,367,224,488
剰余金	
剰余金又は欠損金()	23,010,698,753
元本等合計	58,377,923,241
純資産合計	58,377,923,241
負債純資産合計	58,671,751,486

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月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> <p>為替予約取引</p>

2020年 7月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,367,224,488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 1.6506円 (1万口当たり純資産額) (16,506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 7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。

	2020年 7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 7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ぬ。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	29,419,157,992円
期中追加設定元本額	8,495,756,281円
期中一部解約元本額	2,547,689,785円
期末元本額	35,367,224,488円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国債券インデックス・オープン	4,212,436,754円
世界経済インデックスファンド	6,132,805,160円
D C 新興国債券インデックス・オープン	4,588,464,921円
D C 世界経済インデックスファンド	7,776,225,701円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,819,749,598円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（S M A 専用）	88,561,262円
分散投資コア戦略ファンドA	248,881,880円
分散投資コア戦略ファンドS	1,192,669,310円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	286,875,954円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,672,402,981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）	187,962,817円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	89,760,467円
S M T インデックスバランス・オープン	161,824,223円
外国債券S M T B セレクション（S M A 専用）	3,189,134,764円
S M T 世界経済インデックス・オープン	136,783,394円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	148,209,081円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	244,845,353円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,457,850円
グローバル経済コア	717,508,212円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	28,048,658円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,567,889円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	285,301円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	308,710円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	104,278円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	136,329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）	90,801,879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）	92,020,821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）	310,097,432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）	311,584,720円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7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		721,179,636
合計		721,179,636

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	42,145,488.00	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	98,574,980.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	61,800,000.00	63,322,443.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	111,897,194.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	47,450,000.00	49,859,511.00	
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	85,339,208.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	121,061,632.75	
		MBONO 7.75% 05/29/31	56,200,000.00	64,302,635.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	68,901,832.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	29,200,000.00	33,595,330.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	106,000,000.00	126,363,130.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	57,450,000.00	69,426,601.50	
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	82,374,113.00	
		MBONO 8% 11/07/47	68,850,000.00	78,849,774.00	
		MBONO 8% 12/07/23	112,900,000.00	124,086,696.50	
		1,087,550,000.00	1,220,100,569.25		

メキシコペソ 小計			(5,758,874,686)
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	27,274,697.19
	BLTN 0% 01/01/24	29,700,000.00	24,979,487.94
	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00	25,646,256.43
	BLTN 0% 07/01/23	53,750,000.00	46,893,488.75
	BNTNF 10% 01/01/23	42,100,000.00	47,624,162.69
	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000.00	41,369,004.00
	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000.00	28,673,521.17
	BNTNF 10% 01/01/29	13,200,000.00	16,098,545.31
	BNTNF 10% 01/01/31	3,200,000.00	3,968,028.05
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,678,250.00
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	512,437.50
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,131,562.50
ブラジルレアル 小計		261,000,000.00	266,849,441.53 (5,347,662,808)
チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,855,000,000.00	2,173,984,529.32
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,470,000,000.00	1,762,546,915.28
	BTPCL 4% 03/01/23	945,000,000.00	1,035,666,925.02
	BTPCL 5% 03/01/35	2,110,000,000.00	2,665,974,017.45
	BTPCL 6% 01/01/43	1,650,000,000.00	2,458,616,404.20
チリペソ 小計		8,030,000,000.00	10,096,788,791.27 (1,372,153,596)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	11,900,000,000.00	11,993,355,500.00
	COLOM 9.85% 06/28/27	83,400,000,000.00	105,720,759,000.00
コロンビアペソ 小計		95,300,000,000.00	117,714,114,500.00 (3,484,337,789)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	4,035,616.25
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,400,000.00	5,741,820.00
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,650,000.00	4,245,114.25
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,271,441.75
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	8,085,945.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,200,000.00	9,708,964.00
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	9,083,025.00
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,700,000.00	8,216,344.00
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,330,507.75
ペルーヌエボソル 小計		55,200,000.00	64,718,778.00 (1,979,100,231)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	14,417,364.00
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,326,230.50
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	31,743,594.50 (78,089,242)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	19,622,964.00
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	23,413,875.00

ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	43,036,839.00 (78,757,415)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,849,275.00
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	7,900,996.50
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	9,210,191.25
	TURKGB 10.7% 08/17/22	8,150,000.00	8,222,290.50
	TURKGB 11% 02/24/27	9,150,000.00	8,598,621.00
	TURKGB 11% 03/02/22	6,550,000.00	6,670,127.00
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	10,255,261.50
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	5,205,460.00
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,754,140.00
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,662,243.00
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	6,310,655.00
	TURKGB 8% 03/12/25	7,100,000.00	6,234,368.00
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,600,000.00	10,598,834.00
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,990,940.00
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,741,195.00
トルコリラ 小計		107,950,000.00	105,204,597.75 (1,642,243,770)
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	47,410,180.50
	CZGB 0.45% 10/25/23	53,300,000.00	53,537,984.50
	CZGB 0.95% 05/15/30	41,600,000.00	42,149,120.00
	CZGB 1.2% 03/13/31	30,900,000.00	31,915,528.50
	CZGB 1% 06/26/26	75,100,000.00	76,742,061.50
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	56,251,647.50
	CZGB 2.5% 08/25/28	55,000,000.00	62,741,800.00
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	57,164,303.50
	CZGB 2% 10/13/33	52,350,000.00	59,318,308.50
	CZGB 3.85% 09/29/21	48,000,000.00	50,278,560.00
	CZGB 4.7% 09/12/22	44,400,000.00	48,900,384.00
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	45,613,418.50
チェココルナ 小計		587,250,000.00	632,023,297.00 (2,863,065,535)
ハンガリー フォロント	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	567,354,300.00
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	578,633,200.00
	HGB 2.5% 10/27/21	265,000,000.00	272,527,325.00
	HGB 2.75% 12/22/26	462,500,000.00	495,464,687.50
	HGB 3.25% 10/22/31	232,000,000.00	251,300,080.00
	HGB 3% 06/26/24	512,500,000.00	549,822,812.50
	HGB 3% 08/21/30	502,000,000.00	531,271,620.00
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	642,906,080.00
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	791,831,700.00

	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	618,365,430.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	452,962,540.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	315,102,200.00	
ハンガリーフォリント 小計		5,472,000,000.00	6,067,541,975.00 (2,073,279,092)	
ポーランドズロチ	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,473,400.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	8,850,000.00	9,508,882.50	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	21,097,482.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000.00	16,139,347.25	
	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000.00	17,971,049.25	
	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000.00	17,906,193.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	12,950,000.00	14,442,422.75	
	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000.00	17,018,088.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,913,802.50	
	POLGB 4% 10/25/23	16,250,000.00	18,219,825.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,198,872.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,100,000.00	7,627,885.00	
	ポーランドズロチ 小計		163,950,000.00	179,517,250.25 (4,845,170,584)
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	172,603,021.50	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	172,641,860.00	
	RFLB 6% 10/06/27	173,000,000.00	179,404,460.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	194,546,010.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	178,401,315.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	131,400,000.00	144,186,534.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	180,075,382.50	
	RFLB 7.4% 07/17/24	168,200,000.00	184,305,150.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	175,951,197.50	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	127,233,045.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	138,700,000.00	147,218,954.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	113,500,000.00	130,200,957.50	
	RFLB 7.7% 03/16/39	126,500,000.00	149,555,890.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	182,494,740.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	204,998,362.50	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	207,751,800.00	
	RFLB 7% 01/25/23	53,200,000.00	56,373,114.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	114,543,736.00	
	RFLB 7% 12/15/21	132,500,000.00	137,304,450.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	181,170,600.00	
RFLB 8.5% 09/17/31	90,150,000.00	110,161,497.00		
ロシアルーブル 小計		3,020,650,000.00	3,331,122,076.50 (5,029,994,335)	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,420,581.00	

マレーシア リンギット	MGS 3.48% 03/15/23	10,750,000.00	11,168,067.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	8,200,000.00	8,773,221.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	10,700,000.00	10,955,302.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,495,227.50	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,075,864.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	9,103,130.25	
	MGS 3.828% 07/05/34	7,200,000.00	7,806,636.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	15,650,000.00	17,231,980.25	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,779,597.50	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,792,451.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	9,114,378.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	17,200,000.00	18,719,362.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,000,000.00	7,537,670.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	10,193,904.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,700,000.00	7,934,910.50	
マレーシアリンギット 小計		148,400,000.00	160,102,283.50	(4,015,365,270)
タイバーツ	THAIGB 1.45% 12/17/24	55,300,000.00	56,949,599.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	37,400,000.00	37,392,894.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	39,500,000.00	40,641,550.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	75,300,000.00	77,344,771.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	88,100,000.00	94,283,739.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	101,000,000.00	107,118,580.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	74,001,735.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	84,500,000.00	87,546,225.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	125,400,000.00	153,261,999.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	133,500,000.00	163,948,012.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	91,482,720.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	138,591,607.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	63,100,000.00	65,992,819.50	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	99,771,174.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	82,400,000.00	95,253,164.00	
THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000.00	131,796,171.00		
タイバーツ 小計		1,331,000,000.00	1,515,376,761.00	(5,182,588,522)
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,195,900.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	37,457,250.00	
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	52,653,150.00	(114,257,335)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,935,565,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,207,530,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	35,900,000,000.00	35,622,134,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	34,071,660,000.00	

	INDOGB 6.5% 06/15/25	30,500,000,000.00	30,637,555,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	22,220,880,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	19,204,561,500.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	20,200,000,000.00	20,114,251,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	24,925,000,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,019,541,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	37,117,032,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	32,200,000,000.00	32,055,100,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	37,818,592,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	38,000,000,000.00	40,814,660,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	34,846,720,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	19,858,324,500.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000.00	77,443,872,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	55,062,020,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,498,924,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	36,300,000,000.00	39,373,339,500.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	35,718,864,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,046,388,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	33,700,000,000.00	37,677,611,000.00	
	インドネシアルピア 小計	704,900,000,000.00	735,290,125,000.00 (5,514,675,937)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	108,700,000.00	122,968,505.50	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	22,265,428.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,900,000.00	28,851,238.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	52,000,000.00	55,460,080.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	33,490,369.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	42,646,923.75	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	53,703,820.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	51,718,106.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	67,436,234.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	51,398,876.50	
	SAGB 8% 01/31/30	84,400,000.00	75,865,050.00	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	27,831,125.00	
	南アフリカランド 小計	741,650,000.00	633,635,757.75 (4,023,587,061)	
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	14,000,000.00	13,459,460.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	10,000,000.00	9,667,050.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000.00	43,198,445.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	11,000,000.00	11,059,565.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	10,000,000.00	9,982,200.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000.00	35,510,475.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,296,790.00	

	香港・オフショア人民元 小計	149,000,000.00	149,173,985.00 (2,280,870,230)	
	合計		55,684,073,438 (55,684,073,438)	

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%	10.3%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	9.6%
チリペソ	国債証券 5銘柄	100.0%	2.5%
コロンビアペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	6.3%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	3.6%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	2.9%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	5.1%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	3.7%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	8.7%
ロシアルーブル	国債証券 21銘柄	100.0%	9.0%
マレーシアリングギット	国債証券 16銘柄	100.0%	7.2%
タイバーツ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.3%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券 23銘柄	100.0%	9.9%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	7.2%
香港・オフショア人民元	国債証券 7銘柄	100.0%	4.1%

(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

該当事項はありません。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,451,367,413
投資証券	108,834,878,590
未収入金	26,247,196
未収配当金	951,218,318
前払金	180,032,400
差入委託証拠金	457,059,000
流動資産合計	112,900,802,917
資産合計	112,900,802,917
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	180,032,400
未払解約金	34,534,804
未払利息	1,316
その他未払費用	5,306
流動負債合計	214,573,826
負債合計	214,573,826
純資産の部	
元本等	
元本	67,089,596,986
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	45,596,632,105
元本等合計	112,686,229,091
純資産合計	112,686,229,091
負債純資産合計	112,900,802,917

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

	2020年 7月10日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	67,089,596,986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 1.6796円 (1万口当たり純資産額) (16,796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 7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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	58,709,917,953円

区分	2020年 7月10日現在
期中追加設定元本額	18,652,975,656円
期中一部解約元本額	10,273,296,623円
期末元本額	67,089,596,986円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	1,616,552,885円
S B I 資産設計オープン(分配型)	5,265,476円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,451,090,063円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	30,624,953,737円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,260,170,305円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,024,464,783円
分散投資コア戦略ファンドA	3,015,585,050円
分散投資コア戦略ファンドS	6,092,076,647円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,107,909,967円
S M T インデックスバランス・オープン	30,923,100円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	427,055,025円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,361,149円
グローバル経済コア	283,705,803円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	7,612,659円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	489,812,542円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	43,326,401円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	959,442,596円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4,530,955円
J - R E I T パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	313,100円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	928,576,163円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-11(適格機関投資家専用)	393,195,976円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019-03(適格機関投資家専用)	319,672,604円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 7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	26,304,006,603
合計	26,304,006,603

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

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2020年 7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	4,012,117,400	-	3,832,085,000	180,032,400
合計		4,012,117,400	-	3,832,085,000	180,032,400

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,536	173,721,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,829	182,717,100	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,813	413,511,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,195	2,827,430,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	16,197	1,130,550,600	
	森ヒルズリート投資法人	14,525	2,011,712,500	
	産業ファンド投資法人	16,259	3,064,821,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,974	4,137,017,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,236	1,638,964,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,326	2,220,426,000	
	G L P 投資法人	32,670	5,321,943,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,497	1,890,968,000	
	日本プロロジスリート投資法人	18,997	6,401,989,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,921	816,425,000	
	O n e リート投資法人	1,968	494,952,000	
	イオンリート投資法人	13,624	1,521,800,800	
	ヒューリックリート投資法人	10,737	1,329,240,600	
	日本リート投資法人	4,101	1,287,714,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	81,107	1,053,579,930	

積水ハウス・リート投資法人	36,913	2,613,440,400	
トーセイ・リート投資法人	2,748	274,800,000	
ケネディクス商業リート投資法人	4,876	925,464,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,693	330,969,700	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,527	262,302,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	40,756	5,273,826,400	
いちごホテルリート投資法人	2,091	131,105,700	
ラサールロジポート投資法人	11,738	2,089,364,000	
スターアジア不動産投資法人	4,190	357,407,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,244	120,543,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,593	1,875,546,000	
大江戸温泉リート投資法人	2,145	131,488,500	
さくら総合リート投資法人	2,731	204,278,800	
投資法人みらい	14,357	510,391,350	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,962	274,281,200	
三菱地所物流リート投資法人	2,485	1,090,915,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	2,508	392,502,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,832	161,399,200	
タカラレーベン不動産投資法人	3,583	300,972,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,627	400,354,800	
日本ビルファンド投資法人	12,225	7,310,550,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,625	6,931,125,000	
日本リテールファンド投資法人	23,860	3,020,676,000	
オリックス不動産投資法人	25,154	3,456,159,600	
日本プライムリアルティ投資法人	8,297	2,469,187,200	
プレミア投資法人	11,403	1,301,082,300	
東急リアル・エステート投資法人	8,464	1,168,032,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,766	855,561,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	28,346	3,112,390,800	
森トラスト総合リート投資法人	9,023	1,151,334,800	
インヴィンシブル投資法人	55,377	1,388,855,160	
フロンティア不動産投資法人	4,484	1,441,606,000	
平和不動産リート投資法人	7,862	773,620,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,249	2,532,443,000	
福岡リート投資法人	6,529	803,719,900	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,905	2,335,190,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,776	684,320,000	
大和証券オフィス投資法人	2,914	1,658,066,000	
阪急阪神リート投資法人	5,702	674,546,600	
スターツプロシード投資法人	1,966	420,330,800	
大和ハウスリート投資法人	18,013	4,966,184,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,669	1,779,268,750	

大和証券リビング投資法人	15,455	1,622,775,000	
ジャパンエクセレント投資法人	11,677	1,337,016,500	
合計	743,852	108,834,878,590	

(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

項目	2020年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	352,139,160
コール・ローン	29,550,460
投資証券	87,639,055,812
派生商品評価勘定	69,120
未収入金	966,174
未収配当金	383,339,549
流動資産合計	88,405,120,275
資産合計	88,405,120,275
負債の部	
流動負債	
未払解約金	27,680,469
未払利息	15
その他未払費用	219
流動負債合計	27,680,703
負債合計	27,680,703
純資産の部	
元本等	
元本	56,703,060,151
剰余金	
剰余金又は欠損金()	31,674,379,421
元本等合計	88,377,439,572
純資産合計	88,377,439,572
負債純資産合計	88,405,120,275

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月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>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,703,060,151口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.5586円
の額	(1万口当たり純資産額) (15,586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 7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 7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 7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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	40,305,811,872円
期中追加設定元本額	22,040,249,813円
期中一部解約元本額	5,643,001,534円
期末元本額	56,703,060,151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）	1,643,150,157円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,449,857円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,912,980,715円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	27,289,667,416円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,438,322,562円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,925,261,290円
分散投資コア戦略ファンドA	2,049,375,041円
分散投資コア戦略ファンドS	5,898,622,162円

区分	2020年 7月10日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	691,612,815円
SMT インデックスバランス・オープン	185,808,677円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	398,653,196円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,690,923円
グローバル経済コア	290,298,334円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	7,849,266円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	321,460,040円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	47,989,078円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,187,812,689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）	792,681,860円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	46,353,234円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	156,310,115円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	170,613,527円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7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		18,316,391,461
合計		18,316,391,461

(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 7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	90,069,920	-	90,000,800	69,120
	アメリカドル	80,340,000	-	80,340,000	-
	ユーロ	9,729,920	-	9,660,800	69,120
合計		90,069,920	-	90,000,800	69,120

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	63,440	760,645.60	
		AGREE REALTY CORP	42,156	2,652,877.08	
		ALEXANDER'S INC	1,490	353,323.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	96,250	15,616,562.50	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	35,495	938,132.85	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	106,446	3,439,270.26	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	83,590	606,863.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	193,398	5,171,462.52	
		AMERICOLD REALTY TRUST	151,800	5,619,636.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	114,625	4,213,615.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	162,263	1,461,989.63	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	112,125.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	66,030	40,773.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	107,361	16,280,222.04	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	62,460.00	
		BOSTON PROPERTIES	109,990	9,355,749.40	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,000	55,920.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	128,008	1,277,519.84	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	222,713	2,630,240.53	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	42,700	467,992.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	50,750.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	75,289	6,673,616.96	
		CARETRUST REIT INC	72,760	1,187,443.20	
		CBL & ASSOCIATES PRYS	99,840	25,089.79	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	49,565.49	
		CHATHAM LODGING TRUST	37,360	200,996.80	
		CITY OFFICE REIT INC	37,050	341,230.50	
CLIPPER REALTY INC	7,300	52,487.00			
COLONY CAPITAL INC	346,244	785,973.88			

COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	85,383	1,028,011.32
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,600	605,024.00
CORECIVIC INC	98,963	870,874.40
COREPOINT LODGING INC	22,000	94,380.00
CORESITE REALTY CORP	30,408	3,781,538.88
CORPORATE OFFICE PPTYS	88,859	2,199,260.25
COUSINS PROPERTIES INC	113,943	3,218,889.75
CUBESMART	148,897	4,082,755.74
CYRUSONE INC	87,450	6,719,658.00
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	167,540	824,296.80
DIGITAL REALTY TRUST INC	204,985	30,138,944.55
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	180,800	690,656.00
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	127,445	3,769,823.10
DUKE REALTY CORP	280,447	10,068,047.30
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	60,438	1,377,986.40
EASTGROUP PROPERTIES, INC	29,878	3,523,512.54
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	110,335	707,247.35
EPR PROPERTIES	57,652	1,772,222.48
EQUINIX INC	67,660	49,303,165.40
EQUITY COMMONWEALTH	95,089	2,970,580.36
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	138,561	8,885,916.93
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	266,820	15,131,362.20
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	69,910	1,000,412.10
ESSEX PROPERTY TRUST	49,835	11,159,053.20
EXTRA SPACE STORAGE INC	98,230	9,352,478.30
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	128,060.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	54,200	4,274,754.00
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	98,637	3,785,688.06
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	56,920	1,263,624.00
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	376,701.21
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	37,530	308,121.30
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	156,808	5,141,734.32
GEO GROUP INC/THE	100,676	1,143,679.36
GETTY REALTY CORP	25,485	724,538.55
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	450,157.50
GLADSTONE LAND CORP	11,500	174,110.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	34,430	352,563.20
GLOBAL NET LEASE INC	65,222	1,071,597.46
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	104,018	2,888,579.86
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	165,176	4,259,889.04
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	410,054	11,014,050.44

HERSHA HOSPITALITY TRUST	35,650	180,389.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	80,854	2,882,445.10	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	544,901	5,726,909.51	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	120,690	2,873,628.90	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,738	733,602.54	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	48,270	955,746.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	17,153	1,539,481.75	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,899	620,527.27	
INVITATION HOMES INC	414,250	11,338,022.50	
IRON MOUNTAIN INC	218,257	5,713,968.26	
JBG SMITH PROPERTIES	91,912	2,613,058.16	
KILROY REALTY CORPORATION	80,110	4,569,474.40	
KIMCO REALTY CORP	338,259	4,004,986.56	
KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	623,624.40	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	216,452	2,248,936.28	
LIFE STORAGE INC	36,608	3,495,331.84	
LTC PROPERTIES INC	28,586	1,048,820.34	
MACERICH CO/THE	95,047	747,069.42	
MACK-CALI REALTY CORP	70,670	1,009,167.60	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,066,564	805,255.82	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	408,717	7,360,993.17	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	87,054	9,798,798.24	
MONMOUTH REIT -CL A	71,792	979,242.88	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	132,507	4,383,331.56	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	49,810	1,428,052.70	
NATL HEALTH INVESTORS INC	34,115	1,919,992.20	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	63,000	193,410.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	17,500	585,200.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	40,330	961,467.20	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	171,819	5,206,115.70	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,000	227,630.00	
PARAMOUNT GROUP INC	142,226	994,159.74	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	178,994	1,619,895.70	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	106,965	1,191,590.10	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	61,970	76,223.10	
PHYSICIANS REALTY TRUST	156,071	2,600,142.86	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	101,955	1,531,364.10	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,300	100,347.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	28,300	197,251.00	
PRIME US REIT	295,000	234,525.00	
PROLOGIS INC	564,702	54,533,272.14	
PS BUSINESS PARKS INC	16,100	2,117,150.00	

PUBLIC STORAGE	114,770	22,422,614.90	
QTS REALTY TRUST INC	45,298	2,975,625.62	
REALTY INCOME CORP	261,941	14,962,069.92	
REGENCY CENTERS CORP	128,631	5,417,937.72	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	85,450	863,045.00	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	165,590	1,054,808.30	
RETAIL VALUE	8,969	104,578.54	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	95,973	4,019,349.24	
RLJ LODGING TRUST	123,769	1,047,085.74	
RPT REALTY	70,450	434,676.50	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	43,490	1,341,666.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	161,856	2,219,045.76	
SAFEHOLD INC	9,940	521,452.40	
SAUL CENTERS INC	8,800	263,648.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	29,200	287,620.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	125,070	771,681.90	
SIMON PROPERTY GROUP	233,208	14,230,352.16	
SITE CENTERS CORP	111,320	810,409.60	
SL GREEN REALTY CORP	58,610	2,694,301.70	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	79,349	2,513,776.32	
STAG INDUSTRIAL INC	116,030	3,346,305.20	
STORE CAPITAL CORP	174,028	3,731,160.32	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	90,470	479,491.00	
SUN COMMUNITIES INC	74,823	10,337,545.68	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	162,412	1,234,331.20	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	75,170	487,853.30	
TAUBMAN CENTERS INC	48,540	1,795,980.00	
TERRENO REALTY CORP	52,507	2,758,717.78	
UDR INC	224,280	8,069,594.40	
UMH PROPERTIES INC	27,000	321,030.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10,040	673,583.60	
URBAN EDGE PROPERTIES	92,220	999,664.80	
URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	240,075.00	
VENTAS INC	284,074	9,752,260.42	
VEREIT INC	816,510	5,013,371.40	
VICI PROPERTIES INC	356,056	7,046,348.24	
VORNADO REALTY TRUST	123,525	4,313,493.00	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	195,250	138,627.50	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	62,270	1,330,709.90	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	91,190	1,599,472.60	
WELLTOWER INC	318,484	15,669,412.80	

	WHITESTONE REIT	38,340	246,526.20	
	WP CAREY INC	131,150	8,666,392.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	95,450	813,234.00	
	アメリカドル 小計	19,252,575	611,150,421.34 (65,472,544,638)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	46,542	1,913,341.62	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	317,767.50	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	19,560	570,174.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	62,340	2,962,396.80	
	CHOICE PROPERTIES REIT	123,670	1,581,739.30	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	70,620	562,135.20	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,577	521,008.68	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	40,730	550,262.30	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	55,550	594,940.50	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	375,082.60	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	76,530	1,011,726.60	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,970	1,569,756.50	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	115,539	1,105,708.23	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	44,460	634,444.20	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	32,900	562,261.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	291,732.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	184,198.10	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	23,043	803,509.41	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	69,170	741,502.40	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	120,696	1,781,472.96	
	SLATE OFFICE REI	17,000	61,540.00	
	SLATE RETAIL REIT	10,300	93,524.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	57,576	1,161,883.68	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	58,000	653,080.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	145,512.00		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	32,500	571,350.00		
	カナダドル 小計	1,255,713	21,322,049.58 (1,679,751,065)	
ユーロ	AEDIFICA	20,946	2,023,383.60	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	120,690	1,566,556.20	
	ALTAREA	2,730	330,876.00	
	BEFIMMO S.C.A.	16,810	648,025.50	

	COFINIMMO	19,267	2,358,280.80
	COVIVIO(FP)	37,732	2,416,734.60
	EUROCOMMERCIAL	32,890	372,314.80
	GECINA SA	41,530	4,431,251.00
	HAMBORNER REIT AG	59,000	507,459.00
	HIBERNIA REIT PLC	562,550	604,178.70
	ICADE	21,380	1,263,558.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	116,575.50
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	180,802	1,400,311.49
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	18,300	416,325.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	328,021	472,350.24
	KLEPIERRE	154,860	2,476,985.70
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	54,000	255,420.00
	MERCIALYS	23,450	166,143.25
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	288,918	2,100,433.86
	MONTEA	8,100	762,210.00
	NSI NV	12,300	409,590.00
	RETAIL ESTATES	8,800	543,840.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	106,392	5,332,367.04
	VASTNED RETAIL	13,750	264,550.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	97,070	2,446,164.00
	WERELDHAVE NV	34,970	279,410.30
	ユーロ 小計	2,299,048	33,965,294.58 (4,101,648,973)
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	72,000	52,344.00
	ASSURA PLC	2,085,040	1,605,480.80
	BIG YELLOW GROUP PLC	123,746	1,220,135.56
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	615,000	364,695.00
	BRITISH LAND CO PLC	730,850	2,742,880.05
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	700,297	1,010,528.57
	CAPITAL & REGIONAL PLC	29,000	24,070.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	466,910	511,733.36
	DERWENT LONDON PLC	79,881	2,270,218.02
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	496,000	285,696.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	198,030	1,206,002.70
	HAMMERSON PLC	611,600	475,824.80
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	578,342	3,151,963.90
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	678,510	1,465,581.60
	LXI REIT PLC	415,000	460,650.00
	NEWRIVER REIT PL	218,000	134,724.00
PICTON PROPERTY INCOME LTD	450,000	306,900.00	

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	970,207	1,455,310.50	
	RDI REIT PLC	154,400	126,608.00	
	REGIONAL REIT LTD	292,000	213,452.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	160,426	1,201,590.74	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	115,850.00	
	SEGRO PLC	906,710	8,269,195.20	
	SHAFTESBURY PLC	181,483	916,489.15	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	273,286	278,751.72	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,276,748	1,861,498.58	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	652,000	404,240.00	
	UNITE GROUP PLC	299,962	2,714,656.10	
	WORKSPACE GROUP PLC	94,047	574,156.93	
	イギリスポンド 小計	14,681,435	35,430,497.28 (4,779,574,083)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	266,440	682,086.40	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	180,750.00	
	ARENA REIT	241,053	539,958.72	
	BWP TRUST	393,160	1,497,939.60	
	CENTURIA OFFICE REIT	319,000	633,215.00	
	CHARTER HALL GROUP	350,960	3,313,062.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	307,112	1,311,368.24	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	369,160	1,177,620.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	242,250	562,020.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,462,633	1,287,117.04	
	DEXUS	842,026	7,628,755.56	
	GDI PROPERTY GROUP	446,500	477,755.00	
	GOODMAN GROUP	1,236,039	18,800,153.19	
	GPT GROUP	1,465,047	6,050,644.11	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	243,760	799,532.80	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	148,000	421,800.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	202,588	889,361.32	
	MIRVAC GROUP	2,961,230	6,307,419.90	
	NATIONAL STORAGE REIT	795,670	1,479,946.20	
	RURAL FUNDS GROUP	272,766	542,804.34	
SCENTRE GROUP	3,918,823	8,307,904.76		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	851,060	1,855,310.80		
STOCKLAND	1,792,524	5,915,329.20		
VICINITY CENTERS	2,984,280	3,969,092.40		
WAYPOINT REIT LTD	568,970	1,445,183.80		
	オーストラリアドル 小計	22,756,051	76,076,131.18 (5,658,542,637)	
ニュージ ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	652,278	766,426.65	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	840,300	1,794,040.50	

	KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,288,490	1,314,259.80	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	800,000	1,320,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	295,460	753,423.00	
	ニュージーランドドル 小計	3,876,528	5,948,149.95 (417,560,126)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,523,000	6,427,060.00	
	FORTUNE REIT	1,034,000	7,186,300.00	
	LINK REIT	1,562,900	99,166,005.00	
	PROSPERITY REIT	952,000	2,246,720.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	791,000	3,140,270.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,208,000	4,409,200.00	
	香港ドル 小計	7,070,900	122,575,555.00 (1,693,994,170)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	442,500.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	881,000	533,005.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,310,400	7,531,904.00	
	ASCOTT TRUST	1,442,077	1,485,339.31	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	2,125,328	3,740,577.28	
	CAPITALAND MALL TRUST	2,212,000	4,468,240.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	637,729	816,293.12	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	712,300	762,161.00	
	ESR REIT	1,854,065	723,085.35	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	780,000	409,500.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	390,122.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	562,529	1,333,193.73	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	223,100.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,894,296	2,311,041.12	
	KEPPEL DC REIT	952,903	2,496,605.86	
	KEPPEL REIT	1,439,900	1,569,491.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	363,525.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	131,652.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,592,773	3,121,835.08	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,127,260	3,347,962.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,333,552	4,713,775.04	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,652,100	1,561,234.50	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,903,644	751,939.38	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	288,000	970,560.00	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	478,540	172,274.40		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	465,800	358,666.00		

	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	282,701.56	
	SPH REIT	572,300	503,624.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	587,982.00	
	SUNTEC REIT	1,761,900	2,537,136.00	
	シンガポールドル 小計	34,661,412	48,641,026.43 (3,739,522,111)	
韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	69,030	360,336,600.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	124,868,220.00	
	韓国ウォン 小計	88,123	485,204,820.00 (43,280,269)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	131,500	1,696,350.00	
	イスラエルシェケル 小計	131,500	1,696,350.00 (52,637,740)	
	合計	106,073,285	87,639,055,812 (87,639,055,812)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 157銘柄	100.0%	74.7%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	4.7%
イギリスポンド	投資証券 30銘柄	100.0%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.5%
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%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	4.3%
韓国ウォン	投資証券 2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 7月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	216,091,691
コール・ローン	260,689,817
社債券	20,798,734,566
流動資産合計	21,275,516,074
資産合計	21,275,516,074
負債の部	
流動負債	
未払金	107,879,910
未払解約金	7,106,000
未払利息	139
その他未払費用	475
流動負債合計	114,986,524
負債合計	114,986,524
純資産の部	
元本等	
元本	80,389,097,985
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,228,568,435
元本等合計	21,160,529,550
純資産合計	21,160,529,550
負債純資産合計	21,275,516,074

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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取場の仲値によって計算しております。

2020年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,389,097,985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 59,228,568,435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 0.2632円 (1万口当たり純資産額) (2,632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 7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。

	2020年 7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 7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ぬ。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	73,105,674,107円
期中追加設定元本額	16,443,493,103円
期中一部解約元本額	9,160,069,225円
期末元本額	80,389,097,985円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	45,820,309,696円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,926,757,616円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,963,663,537円
分散投資コア戦略ファンドA	5,546,884,577円
分散投資コア戦略ファンドS	9,846,932,520円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,038,753,933円
SMTAMコモディティ・オープン	1,430,571,471円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	715,062,330円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	58,282,069円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	3,236,243,252円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,805,636,984円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	1,220,904,902
合計	1,220,904,902

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 037 09/30/20	8,000,000.00	7,280,320.00	
		CS USD COM 016 08/28/20	12,000,000.00	10,951,200.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	2,740,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	2,712,000.00	
		SG ISSUER 016 07/31/20	33,000,000.00	30,558,000.00	
		SG ISSUER 017 12/30/20	15,000,000.00	12,940,500.00	
		SG ISSUER 018 02/26/21	16,000,000.00	15,270,400.00	
		SG ISSUER 019 04/30/21	23,000,000.00	24,708,900.00	
		SG ISSUER 020 06/30/21	1,000,000.00	1,008,500.00	
		STAR HELIOS 007 10/30/20	95,000,000.00	85,975,000.00	
			アメリカドル 小計		258,000,000.00
	合計			20,798,734,566 (20,798,734,566)	

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	社債券 10銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2020年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	27,005,517
コール・ローン	23,125,476
投資信託受益証券	28,662,628,671
派生商品評価勘定	258,260,258
未収入金	285,100
流動資産合計	28,971,305,022
資産合計	28,971,305,022
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,673,956
未払利息	12
その他未払費用	150
流動負債合計	4,674,118
負債合計	4,674,118
純資産の部	
元本等	
元本	22,572,469,512
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,394,161,392
元本等合計	28,966,630,904
純資産合計	28,966,630,904
負債純資産合計	28,971,305,022

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2020年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,572,469,512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 1.2833円 (1万口当たり純資産額) (12,833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 7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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2020年 7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 7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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	26,646,828,989円
期中追加設定元本額	4,641,820,948円
期中一部解約元本額	8,716,180,425円
期末元本額	22,572,469,512円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,957,446,265円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,286,036,417円
分散投資コア戦略ファンドA	3,371,188,673円
分散投資コア戦略ファンドS	6,802,087,287円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,493,024,102円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	559,538,834円
グローバル経済コア	1,440,542,122円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	815,601,714円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	600,116,874円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	45,204,254円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	201,682,970円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	6,184,743,542
合計	6,184,743,542

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 7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	28,416,806,773	-	28,158,546,515	258,260,258
	アメリカドル	28,416,806,773	-	28,158,546,515	258,260,258
合計		28,416,806,773	-	28,158,546,515	258,260,258

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	15,519,140	267,549,973.60	
		アメリカドル 小計	15,519,140	267,549,973.60 (28,662,628,671)	
合計			15,519,140	28,662,628,671 (28,662,628,671)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	649,551,962
社債券	23,391,942,630
派生商品評価勘定	125,950,000
流動資産合計	24,167,444,592
資産合計	24,167,444,592
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,670,032
未払利息	348
その他未払費用	938
流動負債合計	4,671,318
負債合計	4,671,318
純資産の部	
元本等	
元本	23,891,809,833
剰余金	
剰余金又は欠損金()	270,963,441
元本等合計	24,162,773,274
純資産合計	24,162,773,274
負債純資産合計	24,167,444,592

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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> <p>為替予約取引</p>

2020年 7月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,891,809,833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 1.0113円 (1万口当たり純資産額) (10,113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 7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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2020年 7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 7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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	25,568,959,929円
期中追加設定元本額	4,162,174,144円
期中一部解約元本額	5,839,324,240円
期末元本額	23,891,809,833円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,342,510,220円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,648,358,125円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,172,838,484円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	557,771,429円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	14,994,798,706円
米国株式LSファンド（SMA専用）	811,656,496円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	483,326,772円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	23,128,251円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	857,421,350円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		710,553,223
合計		710,553,223

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式LS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 7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)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	23,681,350,000	-	23,555,400,000	125,950,000
	アメリカドル	23,681,350,000	-	23,555,400,000	125,950,000
合計	23,681,350,000	-	23,555,400,000	125,950,000	

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/22	200,000,000.00	218,351,000.00	
		アメリカドル 小計	200,000,000.00	218,351,000.00 (23,391,942,630)	
合計				23,391,942,630 (23,391,942,630)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	737,645,313
社債券	13,922,435,000
流動資産合計	14,660,080,313
資産合計	14,660,080,313
負債の部	
流動負債	
未払金	528,985,000
未払解約金	2,428,506
未払利息	396
その他未払費用	362
流動負債合計	531,414,264
負債合計	531,414,264
純資産の部	
元本等	
元本	12,609,230,404
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,519,435,645
元本等合計	14,128,666,049
純資産合計	14,128,666,049
負債純資産合計	14,660,080,313

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		12,609,230,404口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1205円 (11,205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 7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、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。
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 7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 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 7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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	2,500,000,000円
期中追加設定元本額	10,924,818,337円
期中一部解約元本額	815,587,933円
期末元本額	12,609,230,404円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,606,984,095円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,722,766,852円
コア投資戦略ファンド（切替型）	831,055,128円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	152,098,966円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	6,894,207,786円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	358,048,566円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	18,380,316円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	298,671,451円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	727,017,244円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		97,431,000
合計		97,431,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「コモディティL Sアルファ・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
社債券	STAR HELIOS 0% 07 / 13 / 21	12,370,000,000	13,922,435,000	
	合計	12,370,000,000	13,922,435,000	

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。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間(2020年7月11日から2021年1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （2020年 7月10日現在）	第8期中間計算期間 （2021年 1月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	851,936,471	456,456,084
投資信託受益証券	10,005,709,730	8,344,512,170
投資証券	795,918,333	697,775,864
親投資信託受益証券	17,057,216,938	20,123,140,046
未収入金	-	46,129,986
流動資産合計	28,710,781,472	29,668,014,150
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,644,402	86,758,442
未払受託者報酬	7,697,483	8,066,218
未払委託者報酬	204,753,010	214,561,305
未払利息	457	843
その他未払費用	770,046	806,562
流動負債合計	220,865,398	310,193,370
負債合計	220,865,398	310,193,370
純資産の部		
元本等		
元本	26,675,763,100	25,533,497,409
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,814,152,974	3,824,323,371
（分配準備積立金）	239,238,064	220,699,398
元本等合計	28,489,916,074	29,357,820,780
純資産合計	28,489,916,074	29,357,820,780
負債純資産合計	28,710,781,472	29,668,014,150

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日	第8期中間計算期間 自 2020年 7月11日 至 2021年 1月10日
営業収益		
受取配当金	19,499,538	-
受取利息	-	1,410
有価証券売買等損益	1,584,536,360	2,370,470,080
営業収益合計	1,604,035,898	2,370,471,490
営業費用		
支払利息	116,471	99,597
受託者報酬	8,557,180	8,066,218
委託者報酬	227,620,991	214,561,305
その他費用	826,203	806,562
営業費用合計	237,120,845	223,533,682
営業利益又は営業損失（ ）	1,366,915,053	2,146,937,808
経常利益又は経常損失（ ）	1,366,915,053	2,146,937,808
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,366,915,053	2,146,937,808
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	100,461,734	88,599,788
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,508,843,627	1,814,152,974
剰余金増加額又は欠損金減少額	244,240,534	97,144,380
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	244,240,534	97,144,380
剰余金減少額又は欠損金増加額	425,708,223	145,312,003
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	425,708,223	145,312,003
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,593,829,257	3,824,323,371

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)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>(3)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。</p>
-----------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第7期 (2020年 7月10日現在)	第8期中間計算期間 (2021年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,675,763,100口	25,533,497,409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 1.0680円 (1万口当たり純資産額) (10,680円)	1口当たり純資産額 1.1498円 (1万口当たり純資産額) (11,498円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第8期中間計算期間 (2021年 1月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

	第8期中間計算期間 (2021年 1月10日現在)
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的 に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条 件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なること もあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第7期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第8期中間計算期間 自 2020年 7月11日 至 2021年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	29,103,280,048円	26,675,763,100円
期中追加設定元本額	4,135,234,340円	975,907,239円
期中一部解約元本額	6,562,751,288円	2,118,172,930円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,319,946,647
株式	376,580,817,690
派生商品評価勘定	107,537,800
未収入金	4,688,841,066
未収配当金	484,939,679
差入委託証拠金	172,249,600
流動資産合計	384,354,332,482
資産合計	384,354,332,482
負債の部	
流動負債	
前受金	107,553,200
未払解約金	331,233,816
未払利息	1,429
流動負債合計	438,788,445
負債合計	438,788,445
純資産の部	
元本等	
元本	216,685,346,105
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	167,230,197,932
元本等合計	383,915,544,037
純資産合計	383,915,544,037
負債純資産合計	384,354,332,482

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1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。

	2021年 1月10日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	216,685,346,105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 1.7718円 (1万口当たり純資産額) (17,718円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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>

	2021年 1月10日現在

（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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	217,285,082,423円
期中追加設定元本額	25,332,447,988円
期中一部解約元本額	25,932,184,306円
期末元本額	216,685,346,105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）	473,223,757円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,975,420,175円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,087,425円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,810,912,318円
世界経済インデックスファンド	2,429,963,008円
日本株式インデックス・オープン	3,766,995,151円
D C マイセレクション 2 5	6,728,155,495円
D C マイセレクション 5 0	18,759,598,360円
D C マイセレクション 7 5	17,838,258,013円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,769,205,804円
D C マイセレクション S 2 5	2,951,624,117円
D C マイセレクション S 5 0	8,165,731,321円
D C マイセレクション S 7 5	5,465,635,282円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,208,802,197円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	313,895,525円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	714,719,353円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	491,988,219円
D C 世界経済インデックスファンド	3,078,498,470円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,614,666,276円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,569,524円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	28,518,251円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	30,422,250円

区分	2021年 1月10日現在
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	244,150,913円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,499,588円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	60,074,262円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	208,995,474円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	41,980,971円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	148,712,359円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,336,372,461円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	569,378,115円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,508,247,005円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	491,745,392円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	31,131,426円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	643,306,585円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	363,024,549円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	442,937,120円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	47,073,561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）	727,575,749円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,230,850,883円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,797,321,826円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,179,683,259円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,174,850,793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）	359,914,662円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	369,683,621円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,291,530,119円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	202,867,327円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,458,675円
SMT インデックスバランス・オープン	62,068,647円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,885,978,780円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	719,569,057円
SMT 世界経済インデックス・オープン	29,439,369円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	91,622,128円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	16,104,977円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,847,920円
グローバル経済コア	241,736,527円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,309,723円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	42,206,560円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,857,480円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,205,588,025円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	115,034,928円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	497,859円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	510,189円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	243,275円

区分	2021年 1月10日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	348,121円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	46,057,466,188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）	1,481,482,923円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	87,127,894円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,406,958円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	510,493,394円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 1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	2,735,951,800	-	2,843,505,000	107,553,200
	合計	2,735,951,800	-	2,843,505,000	107,553,200

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	972,718,034
国債証券	15,652,727,900
社債券	26,341,823,000
コール・オプション(買)	19,686,000
プット・オプション(買)	16,024,000
派生商品評価勘定	13,322,840
未収入金	500,644,000
未収利息	69,628,682
前払費用	1,278,485
差入委託証拠金	38,480,000
流動資産合計	43,626,332,941
資産合計	43,626,332,941
負債の部	
流動負債	
コール・オプション(売)	2,334,000
プット・オプション(売)	45,876,000

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
前受金	13,340,000
未払解約金	140,778,068
未払利息	599
流動負債合計	202,328,667
負債合計	202,328,667
純資産の部	
元本等	
元本	43,832,604,109
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	408,599,835
元本等合計	43,424,004,274
純資産合計	43,424,004,274
負債純資産合計	43,626,332,941

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 1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、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>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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> <p>(2)債券店頭オプション取引</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、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。</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)

	2021年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		43,832,604,109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	408,599,835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)	0.9907円 (9,907円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	31,218,365,178円
期中追加設定元本額	15,800,522,258円
期中一部解約元本額	3,186,283,327円
期末元本額	43,832,604,109円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,098,250,690円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,393,064,992円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	30,961,626,664円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,058,663,225円
債券コア戦略ファンド	447,389,319円
債券コア・セレクション	3,078,824,004円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	157,775,414円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	12,506,920円
日本債券ツイン戦略ファンド（SMA専用）	148,687,876円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	316,848,925円
FOFs用 日本債券ツイン戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	1,158,966,080円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2021年 1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				
	売建	7,905,900,000	-	7,892,560,000	13,340,000
市場取引以外 の取引	債券店頭オプション取 引				
	買建				
	コール	6,723,853,000	-	19,686,000	13,957,000
	プット	20,425,744,000	-	16,024,000	5,406,000
	売建				
	コール	20,425,744,000	-	2,334,000	8,986,000
	プット	6,723,853,000	-	45,876,000	4,734,000
	合計	62,205,094,000	-	7,976,480,000	1,771,000

(注)1. 時価の算定方法

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

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,223,831,314
コール・ローン	442,908,979
株式	458,823,279,749
投資信託受益証券	294,651,277
投資証券	9,502,189,106
派生商品評価勘定	301,476,581
未収入金	3,452,510
未収配当金	416,292,113
差入委託証拠金	4,899,283,682
流動資産合計	478,907,365,311
資産合計	478,907,365,311
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,290
前受金	301,476,581
未払金	108,457,337
未払解約金	439,020,812
未払利息	272
流動負債合計	849,011,292
負債合計	849,011,292
純資産の部	
元本等	
元本	148,489,775,153
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	329,568,578,866
元本等合計	478,058,354,019
純資産合計	478,058,354,019
負債純資産合計	478,907,365,311

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2021年 1月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2021年 1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。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	148,489,775,153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 3.2195円 (1万口当たり純資産額) (32,195円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	150,285,284,851円
期中追加設定元本額	12,175,920,063円
期中一部解約元本額	13,971,429,761円
期末元本額	148,489,775,153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）	2,183,640,165円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,547,093円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,893,509,578円
世界経済インデックスファンド	8,030,941,713円
外国株式インデックス・オープン	813,523,635円
D C マイセレクション 2 5	999,966,840円
D C マイセレクション 5 0	4,486,318,996円
D C マイセレクション 7 5	4,989,020,931円
D C 外国株式インデックス・オープン	10,160,350,574円
D C マイセレクション S 2 5	428,504,089円
D C マイセレクション S 5 0	1,911,032,247円
D C マイセレクション S 7 5	1,520,713,172円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	84,240,622円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	190,179,236円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	130,945,476円
D C 世界経済インデックスファンド	10,227,953,967円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,983,730,564円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,838,373円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	31,825,883円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	32,637,613円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	115,253,812円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	23,157,013円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	82,022,607円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	506,455,303円

区分	2021年 1月10日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	276,039,460円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,917,296,083円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,363,989,135円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	51,792,667円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	268,867,784円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	92,393,906円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,573,648,640円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,670,527,095円
外国株式ファンド・シリーズ1	976,926,333円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,695,063,836円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,433,731,173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	10,925,720,315円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,219,537,605円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,153,988,581円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,279,704,559円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	683,196,652円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,903,332円
S M T インデックスバランス・オープン	192,174,749円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	938,261,793円
外国株式S M T B セレクション（S M A 専用）	31,706,396,124円
S M T 世界経済インデックス・オープン	148,096,109円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	461,849,911円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	82,025,186円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	2,813,483円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	84,137,859円
グローバル経済コア	818,142,209円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	11,869,721円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	1,564,158円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	756,356,126円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	72,032,595円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2030	1,594,013円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2040	1,617,206円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2050	781,425円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2060	1,122,801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）	821,577,668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）	1,507,719,204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）	1,718,646,185円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	428,880,895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）	115,349,202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）	527,559,511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）	348,459,009円

区分	2021年 1月10日現在
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	336,222,094円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	335,075,728円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 1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	8,391,599,300	-	8,693,075,881	301,476,581
	合計	8,391,599,300	-	8,693,075,881	301,476,581

（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

（2021年 1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	506,974,110	-	507,030,400	56,290
	アメリカドル	415,360,000	-	415,360,000	-
	ユーロ	91,614,110	-	91,670,400	56,290
	合計	506,974,110	-	507,030,400	56,290

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	128,248,939
コール・ローン	3,483,422,928
国債証券	276,299,484,978
派生商品評価勘定	19,119,750
未収入金	440,198
未収利息	1,712,746,090
前払金	19,605,626
前払費用	43,510,079
差入委託証拠金	488,817,673
流動資産合計	282,195,396,261
資産合計	282,195,396,261
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,091,050
未払金	1,287,982
未払解約金	149,438,896
未払利息	2,146
流動負債合計	170,820,074
負債合計	170,820,074
純資産の部	
元本等	
元本	94,268,590,962
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	187,755,985,225
元本等合計	282,024,576,187
純資産合計	282,024,576,187
負債純資産合計	282,195,396,261

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1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>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2021年 1月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 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)

	2021年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,268,590,962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 2.9917円 (1万口当たり純資産額) (29,917円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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</p>

	2021年 1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>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	96,491,687,491円
期中追加設定元本額	7,019,916,701円
期中一部解約元本額	9,243,013,230円
期末元本額	94,268,590,962円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,505,832,550円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	611,913,754円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,028,498,942円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,351,531円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,768,541,451円
世界経済インデックスファンド	7,835,850,546円
DCマイセレクション25	1,780,880,906円
DCマイセレクション50	1,515,829,898円
DCマイセレクション75	888,075,363円

区分	2021年 1月10日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	2,102,642,032円
D C マイセレクション S 2 5	774,495,381円
D C マイセレクション S 5 0	652,537,731円
D C マイセレクション S 7 5	288,760,461円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	40,242,577円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	72,832,652円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	35,849,793円
D C 世界経済インデックスファンド	9,844,852,865円
外国債券インデックス・オープン (SMA 専用)	682,862,726円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA 専用)	8,380,282円
マイセレクション 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,301,429円
マイセレクション 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)	34,208,274円
バランス 3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	74,244,377円
バランス 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	111,132,267円
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	116,752,610円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	137,852,419円
バランス A (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,661,409,117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)	1,868,211,535円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	712,228,227円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	63,127,080円
バランス D (3 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	522,889,523円
バランス E (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	194,681,766円
バランス F (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	242,659,043円
F O F s 用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	832,589,391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)	932,134,280円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	797,530,803円
外国債券ファンド・シリーズ 1	591,217,700円
コア投資戦略ファンド (安定型)	1,005,426,797円
コア投資戦略ファンド (成長型)	2,530,527,298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	2,217,866,231円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	364,708,155円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	3,273,741,058円
コア投資戦略ファンド (切替型)	824,670,942円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	198,983,058円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	96,704,135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)	1,154,836,612円
S M T インデックスバランス・オープン	183,475,130円
外国債券 S M T B セレクション (SMA 専用)	20,468,759,461円
S M T 世界経済インデックス・オープン	143,310,674円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	132,883,058円

区分	2021年 1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)	228,725,244円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,530,354円
グローバル経済コア	739,994,376円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,839,211円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	333,181円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	240,627,943円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	22,210,575円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	474,705円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	563,735円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	298,765円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	466,328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)	569,118,007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)	10,399,684,028円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	340,369,556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)	362,159,540円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	137,147,138円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	261,638,053円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2021年 1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	債券先物取引 買建	3,716,787,372	-	3,697,181,746	19,605,626
	合計	3,716,787,372	-	3,697,181,746	19,605,626

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年 1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)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	3,534,343,174	-	3,552,977,500	18,634,326
	アメリカドル	1,520,656,962	-	1,524,371,200	3,714,238
	カナダドル	189,321,539	-	190,710,500	1,388,961
	ユーロ	1,555,969,960	-	1,566,036,000	10,066,040
	イギリスポンド	268,394,713	-	271,859,800	3,465,087
合計	3,534,343,174	-	3,552,977,500	18,634,326	

(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。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,726,186,241
コール・ローン	124,244,046
国債証券	61,795,565,482
未収利息	758,284,696
前払費用	38,304,454
流動資産合計	64,442,584,919
資産合計	64,442,584,919
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,867
未払金	911,291,416
未払解約金	29,054,977
未払利息	76
流動負債合計	940,348,336
負債合計	940,348,336
純資産の部	
元本等	
元本	36,761,768,631
剰余金	
剰余金又は欠損金()	26,740,467,952
元本等合計	63,502,236,583
純資産合計	63,502,236,583
負債純資産合計	64,442,584,919

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2021年 1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、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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）

2021年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	36,761,768,631口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7274円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,274円)</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p>

	2021年 1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>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	35,367,224,488円
期中追加設定元本額	2,955,359,438円
期中一部解約元本額	1,560,815,295円
期末元本額	36,761,768,631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	4,275,199,770円
世界経済インデックスファンド	6,502,860,150円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,747,876,116円
DC世界経済インデックスファンド	8,277,273,654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)	1,811,632,577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	2021年 1月10日現在
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	84,695,500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
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	312,733,130円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,872,748,880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）	182,686,045円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	85,785,745円
SMT インデックスバランス・オープン	153,240,735円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,156,704,000円
SMT 世界経済インデックス・オープン	179,245,995円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	174,141,322円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	294,698,781円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,384,747円
グローバル経済コア	644,017,058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
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	708,518円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	675,039円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	306,085円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	422,878円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	86,921,616円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	183,502,199円
SMTAM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
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	313,596,985円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	302,592,728円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	298,009,298円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 1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	3,687,368	-	3,689,235	1,867
	マレーシアリン ギット	3,687,368	-	3,689,235	1,867
合計		3,687,368	-	3,689,235	1,867

(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。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,274,028,375
投資証券	97,364,740,380
派生商品評価勘定	203,404,000
未収入金	345,747,164
未収配当金	790,762,749
差入委託証拠金	530,200,000
流動資産合計	101,508,882,668
資産合計	101,508,882,668
負債の部	
流動負債	
前受金	203,404,000
未払金	23,610,346
未払解約金	505,215,877
未払利息	1,401
流動負債合計	732,231,624
負債合計	732,231,624
純資産の部	
元本等	
元本	54,789,286,544
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	45,987,364,500
元本等合計	100,776,651,044
純資産合計	100,776,651,044
負債純資産合計	101,508,882,668

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

	2021年 1月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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。 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 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。 (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）

	2021年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	54,789,286,544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 1.8393円 (1万口当たり純資産額) (18,393円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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

	2021年 1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> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	67,089,596,986円
期中追加設定元本額	3,624,789,523円
期中一部解約元本額	15,925,099,965円
期末元本額	54,789,286,544円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,614,812,536円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,607,939円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,507,780,094円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	26,151,622,372円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,832,299,649円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,603,962,980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
S M T インデックスバランス・オープン	28,313,827円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	376,801,860円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	4,246,815円
グローバル経済コア	252,289,772円

区分	2021年 1月10日現在
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	8,953,336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）	709,889,804円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,731,431円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	909,612,775円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	385,195,526円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	313,147,612円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2021年 1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	不動産投信指数先物 取引 買建	3,201,444,000	-	3,404,848,000	203,404,000
合計		3,201,444,000	-	3,404,848,000	203,404,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 1月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	341,963,084
コール・ローン	142,314,272
投資証券	78,481,490,327
派生商品評価勘定	646,280
未収配当金	309,942,415
流動資産合計	79,276,356,378
資産合計	79,276,356,378
負債の部	
流動負債	
未払金	180,815
未払株式払込金	7,177,438
未払解約金	21,695,280

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
未払利息	87
流動負債合計	29,053,620
負債合計	29,053,620
純資産の部	
元本等	
元本	46,029,811,754
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,217,491,004
元本等合計	79,247,302,758
純資産合計	79,247,302,758
負債純資産合計	79,276,356,378

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1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）

	2021年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		46,029,811,754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 (1万口当たり純資産額)	1.7217円 (17,217円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	56,703,060,151円
期中追加設定元本額	3,746,494,991円
期中一部解約元本額	14,419,743,388円
期末元本額	46,029,811,754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	92,122,201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）	1,642,261,430円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,803,049円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,458,674,140円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	22,664,209,409円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,312,318,632円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,752,980,983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	169,625,358円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	379,019,920円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,625,600円
グローバル経済コア	257,741,111円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,282,318円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	452,724,230円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	47,414,341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）	720,629,122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）	631,202,803円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	84,312,627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）	149,699,569円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	144,350,561円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	145,433,392円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 1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	112,366,200	-	113,011,000	644,800
	アメリカドル	56,639,000	-	57,112,000	473,000
	ユーロ	19,052,700	-	19,098,000	45,300
	イギリスポンド	21,040,500	-	21,129,000	88,500
	シンガポールドル	15,634,000	-	15,672,000	38,000
	売建	48,128,330	-	48,126,850	1,480
	アメリカドル	33,228,800	-	33,228,800	-
	オーストラリアドル	14,899,530	-	14,898,050	1,480
合計	160,494,530	-	161,137,850	646,280	

(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。

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	302,115,054
コール・ローン	122,942,478
社債券	18,888,427,007
未収入金	229,051,560
流動資産合計	19,542,536,099
資産合計	19,542,536,099
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	200,000
未払解約金	13,631,000
未払利息	75
流動負債合計	13,831,075
負債合計	13,831,075
純資産の部	
元本等	
元本	63,307,474,381
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	43,778,769,357
元本等合計	19,528,705,024
純資産合計	19,528,705,024
負債純資産合計	19,542,536,099

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	63,307,474,381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 43,778,769,357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 0.3085円 (1万口当たり純資産額) (3,085円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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>

(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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	80,389,097,985円
期中追加設定元本額	3,391,480,668円
期中一部解約元本額	20,473,104,272円
期末元本額	63,307,474,381円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン(SMA専用)	44,763,634,381円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,926,757,616円

区分	2021年 1月10日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,963,663,537円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,038,753,933円
SMTAMコモディティ・オープン	1,409,921,117円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	715,062,330円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	69,866,902円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	2,968,849,541円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,450,965,024円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 1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	415,160,000	-	415,360,000	200,000
	アメリカドル	415,160,000	-	415,360,000	200,000
合計		415,160,000	-	415,360,000	200,000

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	19,061,067
コール・ローン	190,366,631
投資信託受益証券	34,337,337,195
未収入金	123,109,526
流動資産合計	34,669,874,419
資産合計	34,669,874,419
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	254,665,037

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
未払金	1,020,370
未払解約金	100,891,210
未払利息	117
流動負債合計	356,576,734
負債合計	356,576,734
純資産の部	
元本等	
元本	25,428,160,278
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,885,137,407
元本等合計	34,313,297,685
純資産合計	34,313,297,685
負債純資産合計	34,669,874,419

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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)

	2021年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		25,428,160,278口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3494円 (13,494円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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>

（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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	22,572,469,512円
期中追加設定元本額	5,449,431,383円
期中一部解約元本額	2,593,740,617円
期末元本額	25,428,160,278円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,593,921,792円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,650,255,978円
分散投資コア戦略ファンドA	2,811,648,756円
分散投資コア戦略ファンドS	10,395,875,190円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,352,454,083円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	574,558,988円
グローバル経済コア	1,217,664,101円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,284,220,726円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	560,450,923円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	48,936,119円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	167,583,755円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	770,589,867円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 1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	33,699,035,007	-	33,953,700,044	254,665,037
	アメリカドル	33,699,035,007	-	33,953,700,044	254,665,037
合計		33,699,035,007	-	33,953,700,044	254,665,037

（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。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	751,062,922
社債券	23,317,360,535
未収入金	198,450,000
流動資産合計	24,266,873,457
資産合計	24,266,873,457
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,537,500
未払解約金	3,714,416
未払利息	462
流動負債合計	119,252,378
負債合計	119,252,378
純資産の部	
元本等	
元本	25,018,457,947
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	870,836,868
元本等合計	24,147,621,079
純資産合計	24,147,621,079
負債純資産合計	24,266,873,457

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

2021年 1月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,018,457,947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 870,836,868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 0.9652円 (1万口当たり純資産額) (9,652円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1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。

	2021年 1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>

（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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	23,891,809,833円
期中追加設定元本額	2,744,623,667円
期中一部解約元本額	1,617,975,553円
期末元本額	25,018,457,947円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,543,091,907円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,949,230,656円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,173,686,209円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	506,203,772円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	15,797,441,967円
米国株式LSファンド（SMA専用）	686,547,520円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	398,514,846円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,843,249円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	931,897,821円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 1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)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	23,239,462,500	-	23,355,000,000	115,537,500
	アメリカドル	23,239,462,500	-	23,355,000,000	115,537,500
合計		23,239,462,500	-	23,355,000,000	115,537,500

(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。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

貸借対照表

2021年 1月10日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	224,977,687
社債券	17,406,844,000
流動資産合計	17,631,821,687
資産合計	17,631,821,687
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,892,663
未払利息	138
流動負債合計	1,892,801
負債合計	1,892,801
純資産の部	
元本等	
元本	15,735,071,676
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,894,857,210
元本等合計	17,629,928,886
純資産合計	17,629,928,886
負債純資産合計	17,631,821,687

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2021年 1月10日現在	
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券

	2021年 1月10日現在
	<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>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,735,071,676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 1.1204円 (1万口当たり純資産額) (11,204円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	12,609,230,404円
期中追加設定元本額	4,244,042,378円
期中一部解約元本額	1,118,201,106円
期末元本額	15,735,071,676円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,693,478,087円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,977,914,243円
コア投資戦略ファンド（切替型）	756,907,863円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	277,389,820円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	9,837,998,573円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	268,196,538円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,300,195円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	321,325,162円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	580,561,195円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	286,420,445
社債券	17,176,950,000
流動資産合計	17,463,370,445
資産合計	17,463,370,445
負債の部	
流動負債	
未払解約金	70,142,389
未払利息	176
流動負債合計	70,142,565
負債合計	70,142,565

	2021年 1月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	18,831,907,506
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,438,679,626
元本等合計	17,393,227,880
純資産合計	17,393,227,880
負債純資産合計	17,463,370,445

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 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。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,831,907,506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 1,438,679,626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 0.9236円 (1万口当たり純資産額) (9,236円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1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。

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年10月6日
期首元本額	495,000円
期中追加設定元本額	18,935,214,187円
期中一部解約元本額	103,801,681円
期末元本額	18,831,907,506円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	620,000,000円
コア投資戦略ファンド（成長型）	755,000,000円
分散投資コア戦略ファンドA	1,900,000,000円
分散投資コア戦略ファンドS	7,830,000,000円
コア投資戦略ファンド（切替型）	280,000,000円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	159,246,941円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	6,500,000,000円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	100,000,000円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	8,000,000円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（SMA専用）	266,296,449円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	206,805,621円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	206,558,495円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

【純資産額計算書】

（2021年 1月29日現在）

資産総額	28,968,907,020円
負債総額	179,979,823円
純資産総額（ - ）	28,788,927,197円
発行済口数	25,131,794,579口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1455円
（1万口当たり純資産額）	（11,455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

（2021年 1月29日現在）

資産総額	373,017,480,788円
負債総額	8,428,190,845円
純資産総額（ - ）	364,589,289,943円
発行済口数	211,025,713,113口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7277円
（1万口当たり純資産額）	（17,277円）

日本債券ツイン戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 1月29日現在）

資産総額	44,528,478,384円
負債総額	878,248,243円
純資産総額（ - ）	43,650,230,141円
発行済口数	44,129,955,427口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9891円
（1万口当たり純資産額）	（9,891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

(2021年 1月29日現在)

資産総額	469,601,292,735円
負債総額	1,042,545,242円
純資産総額(-)	468,558,747,493円
発行済口数	146,125,337,780口
1口当たり純資産額(/)	3.2066円
(1万口当たり純資産額)	(32,066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

(2021年 1月29日現在)

資産総額	287,035,185,422円
負債総額	298,605,842円
純資産総額(-)	286,736,579,580円
発行済口数	95,821,960,191口
1口当たり純資産額(/)	2.9924円
(1万口当たり純資産額)	(29,924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

(2021年 1月29日現在)

資産総額	64,104,233,637円
負債総額	21,529,007円
純資産総額(-)	64,082,704,630円
発行済口数	37,224,637,124口
1口当たり純資産額(/)	1.7215円
(1万口当たり純資産額)	(17,215円)

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 1月29日現在)

資産総額	105,361,115,059円
負債総額	763,623,258円
純資産総額（ - ）	104,597,491,801円
発行済口数	54,741,832,229口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9107円
（1万口当たり純資産額）	（19,107円）

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 1月29日現在)

資産総額	81,688,858,332円
負債総額	266,840,233円
純資産総額（ - ）	81,422,018,099円
発行済口数	45,614,799,421口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7850円
（1万口当たり純資産額）	（17,850円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 1月29日現在)

資産総額	18,869,416,265円
負債総額	42,834,068円
純資産総額（ - ）	18,826,582,197円
発行済口数	61,107,339,965口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3081円
（1万口当たり純資産額）	（3,081円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2021年 1月29日現在)

資産総額	33,797,071,329円
負債総額	794,511,830円
純資産総額（ - ）	33,002,559,499円

発行済口数	25,435,504,671口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2975円
（1万口当たり純資産額）	（12,975円）

米国株式LSマザーファンド

純資産額計算書

（2021年 1月29日現在）

資産総額	24,891,584,083円
負債総額	1,304,047,546円
純資産総額（ - ）	23,587,536,537円
発行済口数	25,735,966,346口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9165円
（1万口当たり純資産額）	（9,165円）

コモディティLSアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 1月29日現在）

資産総額	17,478,128,280円
負債総額	2,646,759円
純資産総額（ - ）	17,475,481,521円
発行済口数	15,713,541,020口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1121円
（1万口当たり純資産額）	（11,121円）

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 1月29日現在）

資産総額	17,740,865,632円
負債総額	736,166円
純資産総額（ - ）	17,740,129,466円
発行済口数	19,044,549,971口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9315円
（1万口当たり純資産額）	（9,315円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 1月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2021年 4月 9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。

2021年1月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	525	13,857,438
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	301,269
単位型公社債投資信託	42	288,550
合計	646	14,447,256

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2020年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

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 4月 9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。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

ファンド名を「コア投資戦略ファンド」と表示する場合があります。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載すること
があります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用すること
があります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示する
ことがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等による
レーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することが
あります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型）の2019年7月11日から2020年7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、コア投資戦略ファンド（切替型）の2020年7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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型）の2020年7月11日から2021年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、コア投資戦略ファンド（切替型）の2021年1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中間計算期間（2020年7月11日から2021年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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、継続企業の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。

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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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

以 上

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

2. 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。