【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3月10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】	ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。
②三井住友トラスト・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。
③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

（７）【申込期間】

2021年 3月11日から2021年 9月10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17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜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、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）並びに債券に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

DR(預託証券)とは

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（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。

◆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

①一般…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。

②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。

③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

①一般…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。

②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。

③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。

④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。

⑤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①から④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①から④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。

①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。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

［投資形態による属性区分］

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

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

［為替ヘッジによる属性区分］

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

(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行な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］

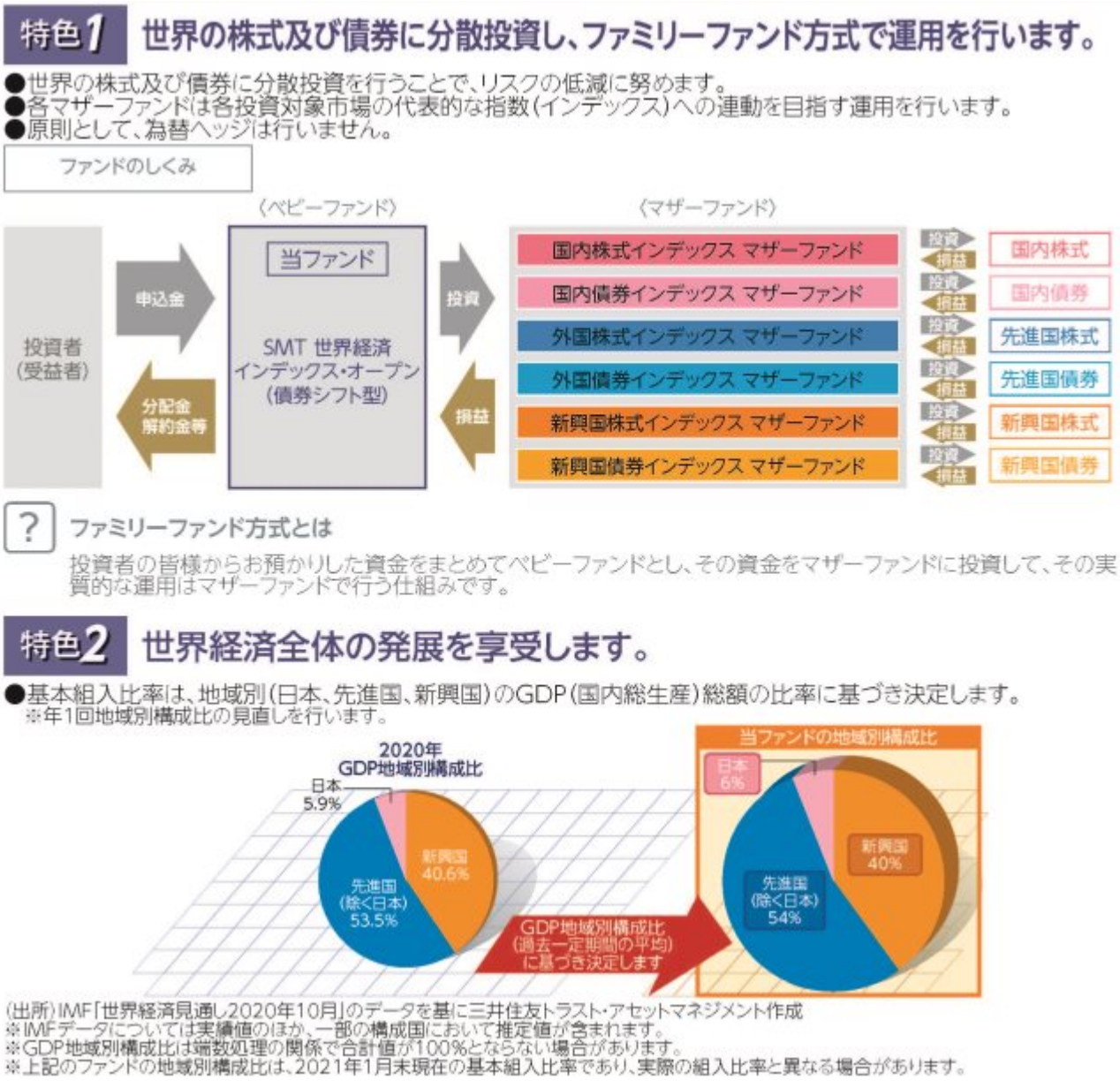
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

(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。

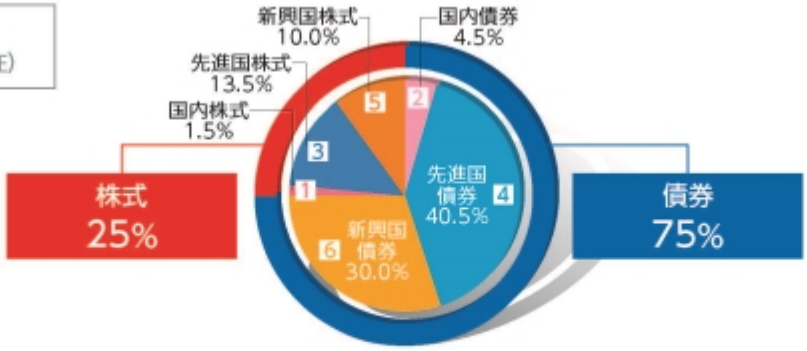
(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞



(出所)IMF「世界経済見通し2020年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
※上記のファンドの地域別構成比は、2021年1月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率
(2021年1月末現在)



●組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
●基本組入比率は年1回見直しを行います。

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

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

※1 「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。

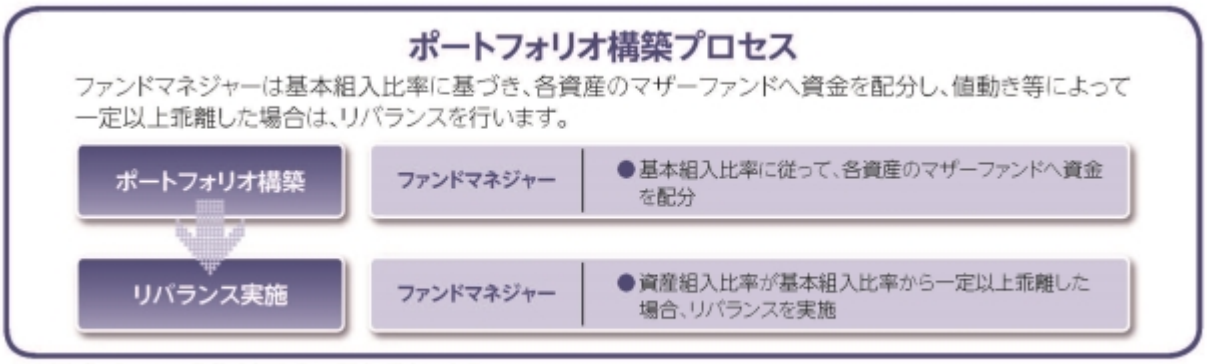
※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

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

※5 「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。

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

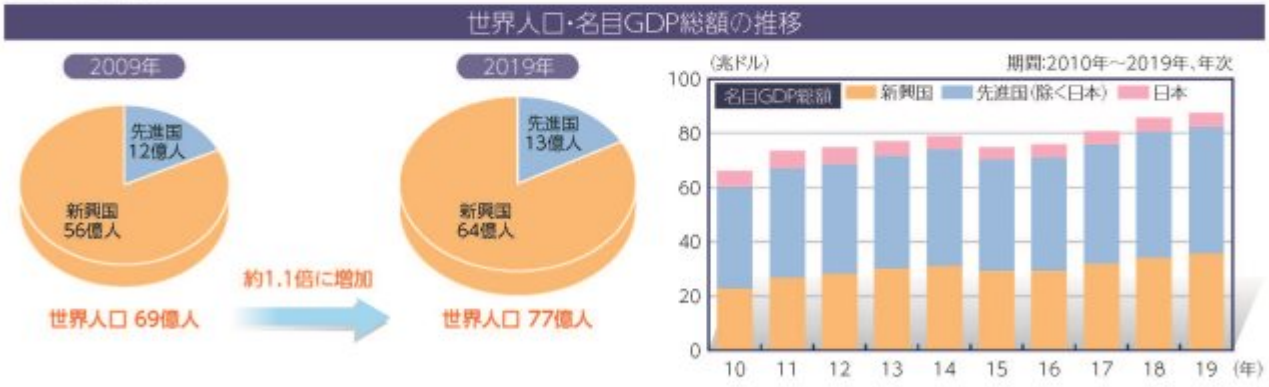
●年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

〈ご参考情報〉



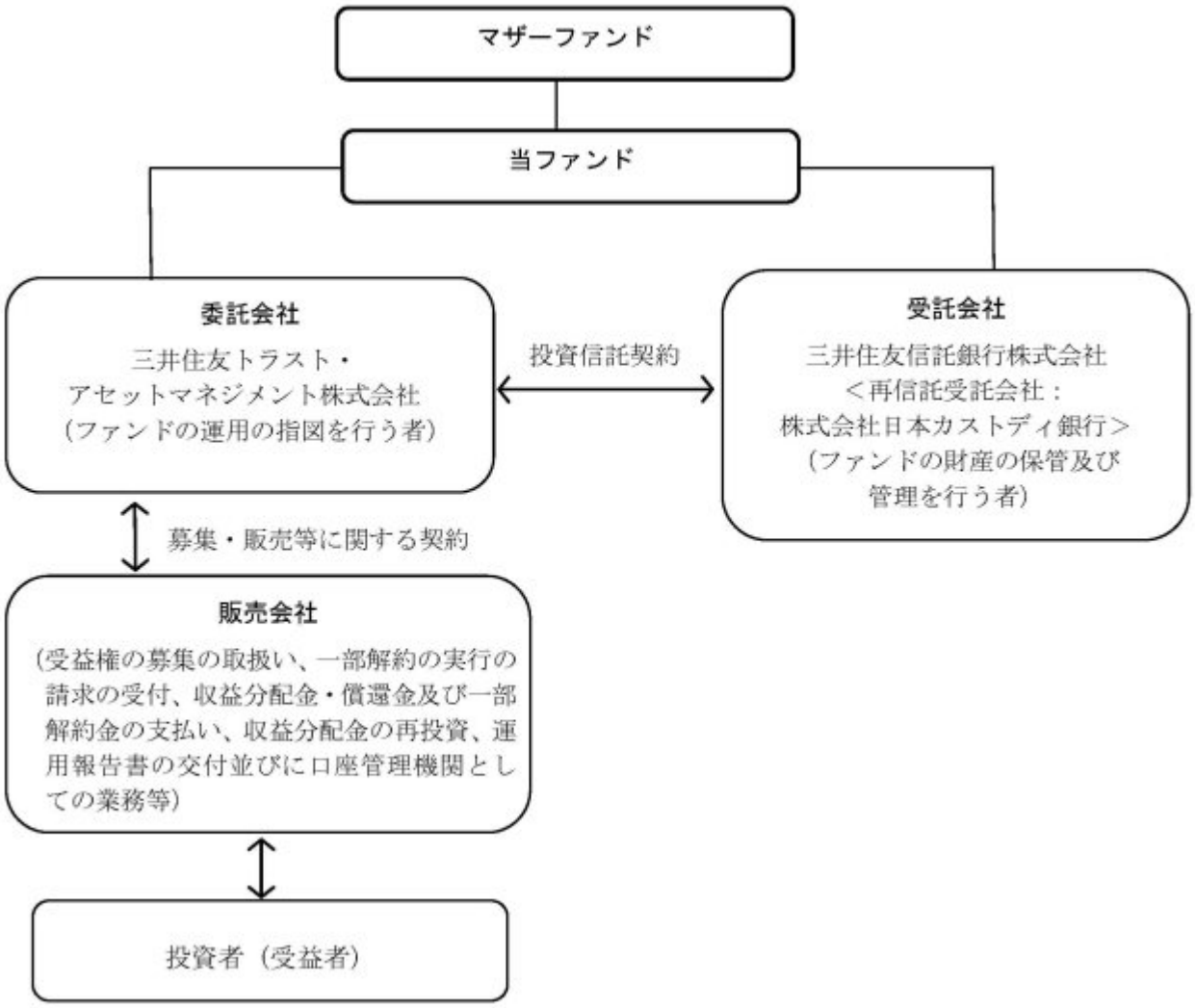
(出所)国連「World Population Prospects 2019」及びIMF「世界経済見通し2020年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2017年 8月25日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2020年12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

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

②投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

③投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。

ロ．株式と債券の基本資産配分比率は、株式25%、債券75%とします。

ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率に基づき決定します。また、各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、年1回見直しを行います。

ホ．各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

ヘ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

ト．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】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

1.有価証券
2.デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。）
3.金銭債権
4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

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

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

19.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22.外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1.預金
2.指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3.コール・ローン
4.手形割引市場において売買される手形
5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ．上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

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

２．運用方法
(1)投資対象
わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
(2)投資態度
①原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
②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。
③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。
④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。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③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。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥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。

⑦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。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-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。

②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。

③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。

④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。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②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。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③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。

④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。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥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。

⑦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。

⑧一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。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②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。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

券を活用することがあります。

(2)投資態度

①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。

②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。

③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。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①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。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③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。

④一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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②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。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

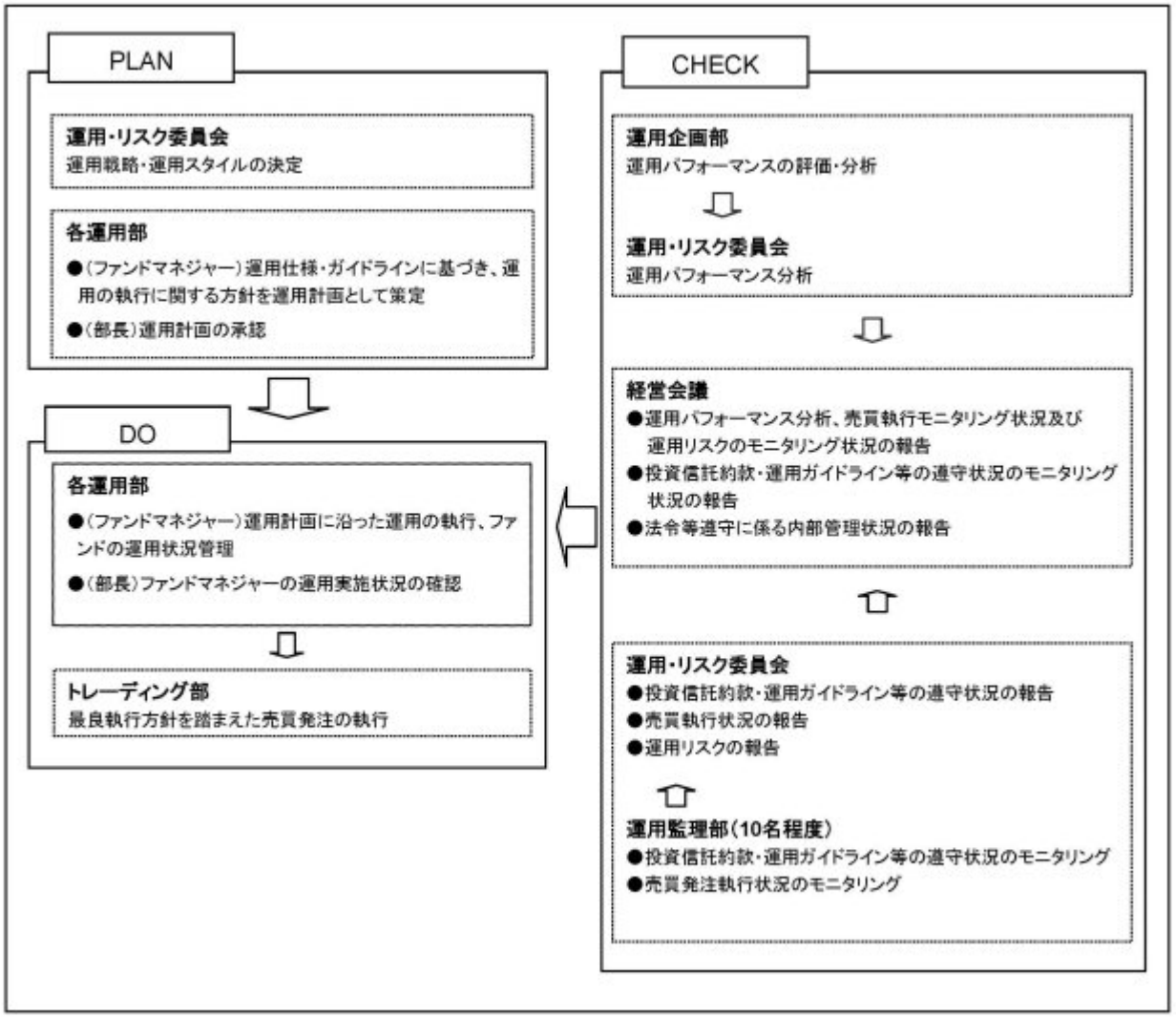
③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

④一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。

⑤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。

（３）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1.投資信託財産に属する株券及び新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び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。）の新株予約権の行使により取得可能な株券

6.投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象

資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

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

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

（ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

（ニ）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。

（ロ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

（ニ）委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

a.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

（ロ）上記（イ）a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

（ハ）委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

（ロ）上記（イ）の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

（ロ）上記（イ）において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の

借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

（ハ）収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●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。

①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。

②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。

③金利変動リスク

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

④信用リスク

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

⑤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。

⑥流動性リスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

②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。

③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

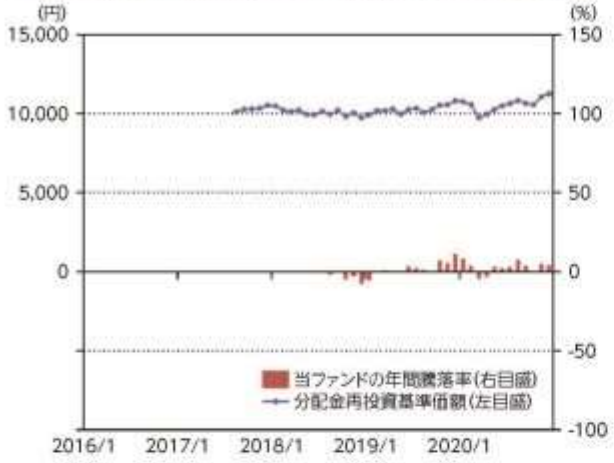
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

＊当ファンドについては2018年8月～2020年12月の2年5ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年1月～2020年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式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国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 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・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。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】

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

価として、販売会社に支払われます。

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

②「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。

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.495%（税抜　0.45%）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.198%　　（税抜　0.18%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.242%　　（税抜　0.22%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.055%　　（税抜　0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

②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。
③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
②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。
③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
④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。
⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税
収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）
ロ．一部解約金及び償還金に対する課税
一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま

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

ハ．損益通算について

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

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

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

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

②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。）

③個別元本について

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

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

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

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④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。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

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

※上記は、2020年12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

５【運用状況】

以下は、2020年12月30日現在の状況について記載してあります。

【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,711,733,425	99.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	16,311,230	0.94
合計(純資産総額)		1,728,044,655	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(％)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス　マザーファンド	224,177,260	2.9381	658,655,208	2.9967	671,791,995	38.88
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	288,887,730	1.6809	485,591,386	1.7344	501,046,878	29.00
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	80,550,184	2.7680	222,962,910	3.1417	253,064,513	14.64
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	57,987,143	2.7585	159,957,534	3.3148	192,215,781	11.12
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス　マザーファンド	47,058,953	1.4099	66,348,418	1.4103	66,367,241	3.84
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	15,806,368	1.5362	24,281,743	1.7238	27,247,017	1.58

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.06
合計	99.06

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2018年 6月11日)	545,359,273	545,359,273	10,037	10,037
第2期計算期間末 (2019年 6月10日)	823,199,920	823,199,920	10,104	10,104
第3期計算期間末 (2020年 6月10日)	1,375,543,408	1,375,543,408	10,625	10,625
2019年12月末日	1,084,269,675	—	10,808	—
2020年 1月末日	1,153,624,549	—	10,746	—
2月末日	1,192,717,155	—	10,568	—
3月末日	1,167,316,078	—	9,735	—
4月末日	1,235,328,796	—	9,959	—
5月末日	1,313,173,629	—	10,270	—
6月末日	1,382,640,197	—	10,493	—
7月末日	1,463,707,876	—	10,641	—
8月末日	1,534,813,997	—	10,818	—
9月末日	1,550,188,124	—	10,642	—
10月末日	1,585,567,840	—	10,569	—
11月末日	1,690,180,675	—	11,055	—
12月末日	1,728,044,655	—	11,256	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	0.4
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0.7
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	5.2
第4期中間計算期間	2020年 6月11日～2020年12月10日	5.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	755,925,234	212,584,152	543,341,082
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	566,171,068	294,755,895	814,756,255
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	723,541,962	243,618,762	1,294,679,455
第4期中間計算期間	2020年 6月11日～2020年12月10日	348,776,276	85,544,807	1,557,910,924

(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	371,577,359,020	99.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,027,438,937	0.81
合計(純資産総額)		374,604,797,957	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	2,941,335,000	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	1,658,500	6,793.64	11,267,251,940	7,957.00	13,196,684,500	3.52
日本	株式	ソニー	電気機器	931,100	7,055.06	6,568,966,366	10,285.00	9,576,363,500	2.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,157,300	5,018.32	5,807,701,736	8,058.00	9,325,523,400	2.49
日本	株式	キーエンス	電気機器	134,700	44,543.76	6,000,044,472	58,000.00	7,812,600,000	2.09
日本	株式	任天堂	その他製品	91,100	45,116.59	4,110,121,349	65,830.00	5,997,113,000	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,949,800	2,439.18	4,755,913,164	2,645.50	5,158,195,900	1.38
日本	株式	日本電産	電気機器	357,800	6,944.71	2,484,817,238	12,980.00	4,644,244,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,236,700	4,150.04	5,132,354,468	3,755.00	4,643,808,500	1.24
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	10,028,700	444.54	4,458,158,298	456.10	4,574,090,070	1.22
日本	株式	第一三共	医薬品	1,276,100	3,332.93	4,253,151,973	3,535.00	4,511,013,500	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	250,000	12,756.66	3,189,165,000	18,040.00	4,510,000,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,017,500	3,760.03	3,825,830,525	4,321.00	4,396,617,500	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	189,400	16,328.75	3,092,665,250	22,920.00	4,341,048,000	1.16
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	294,900	10,228.01	3,016,240,149	14,270.00	4,208,223,000	1.12
日本	株式	村田製作所	電気機器	436,700	6,123.43	2,674,101,881	9,320.00	4,070,044,000	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	94,300	22,290.23	2,101,968,689	38,400.00	3,621,120,000	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	139,800	19,393.15	2,711,162,370	25,360.00	3,545,328,000	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,170,300	2,782.40	3,256,242,720	2,877.50	3,367,538,250	0.90
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,063,400	3,118.58	3,316,297,972	3,066.00	3,260,384,400	0.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,013,900	3,124.53	3,167,960,967	3,188.00	3,232,313,200	0.86
日本	株式	エムスリー	サービス業	313,200	4,577.79	1,433,763,828	9,743.00	3,051,507,600	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,024,000	2,354.68	2,411,192,320	2,964.00	3,035,136,000	0.81
日本	株式	ＳＭＣ	機械	46,600	54,897.13	2,558,206,258	62,950.00	2,933,470,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	714,200	3,481.43	2,486,437,306	4,065.00	2,903,223,000	0.78
日本	株式	花王	化学	355,900	8,590.41	3,057,326,919	7,970.00	2,836,523,000	0.76

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	518,300	4,704.73	2,438,461,559	5,308.00	2,751,136,400	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,992,100	1,352.47	2,694,255,487	1,307.50	2,604,670,750	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	151,100	15,524.80	2,345,797,280	17,040.00	2,574,744,000	0.69
日本	株式	中外製薬	医薬品	464,900	5,244.82	2,438,316,818	5,503.00	2,558,344,700	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	959,900	2,516.44	2,415,530,756	2,541.00	2,439,105,900	0.65

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.14
		建設業	2.33
		食料品	3.50
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.52
		医薬品	5.88
		石油・石炭製品	0.36
		ゴム製品	0.50
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.61
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.60
		機械	5.72
		電気機器	17.17
		輸送用機器	7.34
		精密機器	2.78
		その他製品	2.75
		電気・ガス業	1.29
		陸運業	3.46
		海運業	0.19
		空運業	0.38
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.08
		卸売業	4.53
		小売業	4.76
		銀行業	4.41
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	1.89

		その他金融業	1.10
		不動産業	1.93
		サービス業	5.74
		小計	99.19
合計			99.19

(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	163	円	2,895,756,650	2,941,335,000	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。

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	505,902,144,850	83.49
地方債証券	日本	33,278,136,248	5.49
特殊債券	日本	39,749,134,074	6.56
社債券	日本	24,295,931,760	4.01
	フランス	1,300,497,000	0.21
	オーストラリア	399,864,000	0.07
	小計	25,996,292,760	4.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,018,521,895	0.17
合計(純資産総額)		605,944,229,827	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	8,200,000,000	100.99	8,281,977,300	100.99	8,281,508,000	0.100	2025/9/20	1.37
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,420,000,000	100.99	7,494,153,800	100.85	7,483,589,400	0.100	2024/9/20	1.24
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	100.99	7,372,854,000	100.79	7,358,254,000	0.100	2024/6/20	1.21
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	7,050,000,000	100.91	7,114,155,000	100.69	7,099,209,000	0.100	2023/12/20	1.17
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	100.86	6,818,136,000	100.65	6,804,075,200	0.100	2023/9/20	1.12
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,720,000,000	100.98	6,786,395,200	100.98	6,786,192,000	0.100	2025/6/20	1.12
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	101.42	6,734,288,000	101.14	6,716,227,200	0.100	2026/9/20	1.11
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	6,430,000,000	100.74	6,477,914,700	100.77	6,479,832,500	0.100	2030/9/20	1.07
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	102.83	6,498,856,000	102.46	6,475,598,400	0.400	2025/9/20	1.07
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	6,380,000,000	101.31	6,463,833,200	101.07	6,448,393,600	0.100	2026/3/20	1.06
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	5,850,000,000	100.67	5,889,195,000	100.46	5,876,968,500	0.100	2022/12/20	0.97
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	5,630,000,000	101.07	5,690,241,000	100.89	5,680,388,500	0.100	2024/12/20	0.94
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	5,590,000,000	101.53	5,675,527,000	101.34	5,664,961,900	0.100	2028/3/20	0.93
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,200,000,000	101.47	5,276,596,000	101.24	5,264,896,000	0.100	2027/3/20	0.87
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	5,090,000,000	102.76	5,230,672,400	102.51	5,218,115,300	0.600	2024/6/20	0.86
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	5,030,000,000	101.24	5,092,514,500	101.27	5,094,233,100	0.100	2029/3/20	0.84
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	4,340,000,000	116.74	5,066,785,600	116.40	5,051,760,000	1.400	2034/9/20	0.83
日本	国債証券	第１３１回利付国債（５年）	4,990,000,000	100.46	5,013,403,100	100.25	5,002,924,100	0.100	2022/3/20	0.83
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	4,850,000,000	102.72	4,981,920,000	102.33	4,963,005,000	0.400	2025/6/20	0.82
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	4,870,000,000	101.22	4,929,414,000	101.23	4,929,949,700	0.100	2029/6/20	0.81
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	4,850,000,000	101.47	4,921,472,000	101.35	4,915,475,000	0.100	2028/6/20	0.81
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,840,000,000	101.50	4,912,987,200	101.31	4,903,694,400	0.100	2027/9/20	0.81
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	4,830,000,000	100.88	4,872,795,000	101.17	4,886,945,700	0.100	2029/9/20	0.81
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	4,760,000,000	100.93	4,804,713,200	100.75	4,795,985,600	0.100	2024/3/20	0.79
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	100.54	4,795,996,500	100.32	4,785,311,700	0.100	2022/6/20	0.79
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,470,000,000	101.37	4,531,462,500	101.32	4,529,004,000	0.100	2028/12/20	0.75
日本	国債証券	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	100.61	4,406,805,600	100.39	4,397,257,200	0.100	2022/9/20	0.73
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,250,000,000	102.61	4,360,940,300	102.15	4,341,502,500	0.600	2023/12/20	0.72
日本	国債証券	第４１７回利付国債（２年）	4,300,000,000	100.46	4,320,043,400	100.40	4,317,587,000	0.100	2022/10/1	0.71

日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	4,130,000,000	101.45	4,189,903,600	101.36	4,186,415,800	0.100	2027/12/20	0.69

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.49
地方債証券	5.49
特殊債券	6.56
社債券	4.29
合計	99.83

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	307,027,943,946	65.77
	イギリス	20,945,514,851	4.49
	スイス	16,065,665,630	3.44
	フランス	15,785,141,758	3.38
	カナダ	15,697,548,847	3.36
	ドイツ	14,299,289,304	3.06
	オーストラリア	9,655,954,067	2.07
	オランダ	8,377,993,384	1.79
	アイルランド	8,287,630,698	1.78
	スウェーデン	4,957,955,435	1.06
	デンマーク	3,905,691,158	0.84
	スペイン	3,823,509,340	0.82
	香港	3,595,385,219	0.77
	イタリア	2,850,031,790	0.61
	フィンランド	1,889,911,869	0.40

	バミューダ	1,432,458,627	0.31
	ベルギー	1,400,599,997	0.30
	シンガポール	1,361,488,437	0.29
	ジャージー	1,351,124,467	0.29
	イスラエル	925,014,266	0.20
	ノルウェー	889,060,598	0.19
	ケイマン	828,617,537	0.18
	ニュージーランド	593,316,979	0.13
	ルクセンブルク	409,218,362	0.09
	キュラソー	291,974,067	0.06
	オーストリア	280,074,209	0.06
	ポルトガル	272,769,415	0.06
	リベリア	125,409,584	0.03
	パナマ	107,617,603	0.02
	マン島	95,957,823	0.02
	パプアニューギニア	52,971,206	0.01
	小計	447,582,840,473	95.88
投資信託受益証券	オーストラリア	223,391,428	0.05
	香港	73,199,985	0.02
	小計	296,591,413	0.06
投資証券	アメリカ	7,967,855,745	1.71
	オーストラリア	685,978,305	0.15
	フランス	275,686,714	0.06
	イギリス	264,483,612	0.06
	シンガポール	236,605,674	0.05
	香港	188,356,485	0.04
	カナダ	57,503,475	0.01
	小計	9,676,470,010	2.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	9,249,343,294	1.98
合計(純資産総額)		466,805,245,190	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	6,891,672,735	1.48
	買建	カナダ	553,003,294	0.12
	買建	ドイツ	1,426,257,882	0.31
	買建	イギリス	476,953,984	0.10
	買建	オーストラリア	274,670,676	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	買建	—	526,053,800	0.11

(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	1,601,257	8,344.17	13,361,160,622	13,959.04	22,352,018,520	4.79
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	673,110	18,855.63	12,691,913,110	23,199.52	15,615,832,273	3.35
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	39,879	250,918.15	10,006,365,103	343,827.00	13,711,476,933	2.94
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	225,170	23,477.94	5,286,527,750	28,646.72	6,450,384,194	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,139	147,113.86	4,139,637,047	181,928.15	5,119,276,494	1.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	28,084	146,976.21	4,127,679,882	182,027.52	5,112,060,872	1.10
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	69,867	17,736.69	1,239,209,957	68,929.96	4,815,929,865	1.03
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	246,347	15,217.60	3,748,811,339	15,953.48	3,930,094,401	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	285,371	10,334.47	2,949,159,465	12,938.53	3,692,282,671	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	157,872	20,142.13	3,179,879,136	22,187.29	3,502,752,636	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	232,638	12,084.96	2,811,420,976	14,326.47	3,332,881,328	0.71
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	269,020	12,076.99	3,248,952,792	12,253.89	3,296,541,488	0.71
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	89,134	31,470.64	2,805,104,682	35,950.72	3,204,431,922	0.69

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	131,213	19,294.68	2,531,713,356	23,760.49	3,117,685,830	0.67
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	169,185	12,137.44	2,053,473,633	18,350.55	3,104,637,802	0.67
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	57,796	35,779.74	2,067,925,863	53,585.05	3,097,001,839	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	83,638	31,419.49	2,627,863,723	35,879.31	3,000,873,730	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	100,787	25,499.29	2,569,997,445	27,550.66	2,776,748,873	0.59
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	104,426	15,522.92	1,620,997,488	23,911.60	2,496,993,264	0.53
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	65,813	39,946.97	2,629,030,496	35,959.19	2,366,582,336	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	387,405	5,784.61	2,240,988,774	6,086.83	2,358,070,313	0.51
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	44,904	39,657.05	1,780,760,622	51,968.38	2,333,588,360	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	426,767	4,119.29	1,757,981,303	5,335.42	2,276,983,321	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	41,353	43,051.00	1,780,288,385	54,945.04	2,272,142,446	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	729,975	2,575.08	1,879,744,023	3,106.03	2,267,327,899	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	381,997	4,885.20	1,866,131,745	5,602.45	2,140,121,003	0.46
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	398,108	6,345.34	2,526,132,544	5,111.86	2,035,074,351	0.44
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	208,028	9,753.90	2,029,086,182	9,662.53	2,010,077,207	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	39,882	37,521.34	1,496,426,161	50,310.28	2,006,474,786	0.43
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	237,327	8,205.04	1,947,278,886	8,426.96	1,999,947,509	0.43

(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	2.86
		素材	4.38
		資本財	6.29
		商業・専門サービス	1.16
		運輸	1.98

		自動車・自動車部品	1.95
		耐久消費財・アパレル	1.96
		消費者サービス	1.56
		メディア・娯楽	6.83
		小売	5.97
		食品・生活必需品小売り	1.41
		食品・飲料・タバコ	4.12
		家庭用品・パーソナル用品	1.97
		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	7.64
		銀行	5.47
		各種金融	4.24
		保険	3.08
		不動産	0.48
		ソフトウェア・サービス	11.93
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.22
		電気通信サービス	1.84
		公益事業	3.20
		半導体・半導体製造装置	4.19
		小計	95.88
投資信託受益証券	—	—	0.06
投資証券	—	—	2.07
合計			98.02

(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	358	アメリカドル	65,507,351	6,780,010,828	66,586,210	6,891,672,735	1.48
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	33	カナダドル	6,854,412.5	554,042,162	6,841,560	553,003,294	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	34	スイスフラン	3,500,038	410,029,452	3,593,460	420,973,839	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	222	ユーロ	7,766,239	985,924,041	7,918,740	1,005,284,043	0.22
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	21	オーストラリアドル	3,460,197	272,801,931	3,483,900	274,670,676	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	52	イギリスポンド	3,376,515	472,104,327	3,411,200	476,953,984	0.10

(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	4,300,000.00	445,307,000	444,964,000	0.10
	イギリスポンド	買建	580,000.00	81,095,020	81,089,800	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	118,479,959,058	42.11
	フランス	29,637,491,349	10.53
	イタリア	26,550,303,689	9.44
	ドイツ	21,676,980,389	7.70
	イギリス	18,629,587,493	6.62
	スペイン	16,927,314,538	6.02
	オーストラリア	7,617,285,281	2.71
	ベルギー	7,063,592,222	2.51
	オランダ	5,498,120,356	1.95
	カナダ	5,458,035,613	1.94
	オーストリア	4,263,454,016	1.52
	アイルランド	2,380,127,169	0.85
	メキシコ	2,373,902,270	0.84
	フィンランド	1,779,218,901	0.63
	ポーランド	1,736,928,877	0.62
	デンマーク	1,443,550,682	0.51
	マレーシア	1,368,082,001	0.49
	イスラエル	1,231,825,069	0.44
	シンガポール	1,218,906,070	0.43
	スウェーデン	932,579,350	0.33
	ノルウェー	610,894,953	0.22

	小計	276,878,139,346	98.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,493,965,454	1.60
合計(純資産総額)		281,372,104,800	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,186,622,668	0.42
	買建	ドイツ	1,637,982,531	0.58

(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	―	2,628,937,300	0.93

(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	10,219.93	1,630,080,146	10,072.65	1,606,588,057	0.625	2030/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,302.91	1,452,711,696	10,101.76	1,424,348,409	0.625	2030/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,665.58	1,254,050,074	11,539.44	1,240,489,957	2.375	2027/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,103.03	1,209,092,822	11,867.73	1,185,586,279	2.625	2029/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,343.35	1,159,291,126	11,259.66	1,150,738,071	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,238.24	1,140,681,380	11,151.31	1,131,858,620	2.250	2024/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,555.27	1,150,842,990	13,322.25	1,131,059,870	3.000	2022/4/25	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,490,000	22,935.27	1,029,794,025	24,067.05	1,080,610,726	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,240.49	1,091,851,903	12,014.89	1,071,728,596	2.875	2028/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,802.00	1,080,200,396	10,705.78	1,070,578,125	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,651.20	1,065,120,114	10,583.27	1,058,327,927	1.500	2022/8/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	13,008.69	1,052,403,738	13,065.69	1,057,014,645	0.000	2025/3/25	0.38

アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,370.49	1,052,605,039	10,376.27	1,053,192,345	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,343.58	1,034,358,300	10,312.80	1,031,280,469	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,494.39	1,049,528,812	12,243.72	1,028,473,031	3.125	2028/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,544.29	1,033,214,224	11,435.13	1,023,444,386	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,675.05	1,019,467,722	10,589.54	1,011,301,632	1.750	2022/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,648.16	1,016,900,131	10,562.25	1,008,695,432	1.750	2022/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	10,626.91	1,009,557,011	10,593.38	1,006,371,743	1.500	2022/9/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000	15,943.85	988,519,229	16,227.76	1,006,121,405	2.500	2030/5/25	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000	19,100.38	987,490,122	19,181.51	991,684,080	5.500	2029/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,602.98	990,789,241	15,550.61	987,463,944	3.500	2026/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,609.78	992,636,964	11,470.71	980,745,784	2.250	2027/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	10,859.32	977,339,115	10,813.72	973,235,569	1.375	2025/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,300.63	978,559,898	10,205.26	969,499,868	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,100.37	974,612,925	11,033.66	968,755,878	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	10,728.82	965,594,353	10,638.06	957,425,536	1.875	2022/7/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000	13,677.14	939,619,790	13,916.63	956,073,158	0.750	2028/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 08/15/50	9,900,000	10,028.81	992,852,260	9,628.73	953,244,703	1.375	2050/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000	21,561.94	935,788,617	21,921.21	951,380,870	5.750	2032/10/25	0.34

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.40
合計	98.40

(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	34	アメリカドル	4,282,657.77	443,255,079	4,286,921.96	443,696,423	0.16
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	22	アメリカドル	3,034,717.92	314,093,304	3,034,281.36	314,048,120	0.11
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	24	アメリカドル	4,166,129.7	431,194,424	4,143,750	428,878,125	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	16	ユーロ	1,797,323.6	228,170,231	1,796,480	228,063,136	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	23	ユーロ	3,110,078.3	394,824,440	3,109,600	394,763,720	0.14

	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	45	ユーロ	7,984,074.5	1,013,578,258	7,996,500	1,015,155,675	0.36

(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	10,690,000.00	1,108,690,413	1,105,987,400	0.39
	カナダドル	買建	1,920,000.00	156,118,250	155,155,200	0.06
	ユーロ	買建	9,110,000.00	1,152,179,056	1,156,696,700	0.41
	イギリスポンド	買建	1,510,000.00	209,351,194	211,098,000	0.08

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

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

新興国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	ケイマン	20,503,916,479	23.91
	韓国	11,333,595,289	13.21
	台湾	10,536,540,175	12.28
	中国	9,733,108,936	11.35
	インド	7,893,585,595	9.20
	ブラジル	4,197,171,376	4.89
	南アフリカ	2,860,856,384	3.34
	ロシア	2,156,681,687	2.51
	サウジアラビア	2,116,129,634	2.47
	タイ	1,581,017,902	1.84
	香港	1,574,516,001	1.84
	メキシコ	1,449,919,846	1.69
	マレーシア	1,332,742,550	1.55
	インドネシア	1,165,556,049	1.36
	バミューダ	659,466,733	0.77
	フィリピン	652,620,904	0.76
	カタール	599,122,242	0.70
	ポーランド	526,839,397	0.61
	アラブ首長国連邦	471,168,912	0.55

	チリ	425,527,944	0.50
	クウェート	394,250,162	0.46
	アメリカ	308,029,970	0.36
	トルコ	306,983,959	0.36
	オランダ	224,892,755	0.26
	ルクセンブルク	185,432,572	0.22
	ハンガリー	185,335,546	0.22
	コロンビア	158,784,666	0.19
	ギリシャ	96,184,707	0.11
	チェコ	92,318,137	0.11
	エジプト	67,188,620	0.08
	ジャージー	65,274,897	0.08
	英ヴァージン諸島	28,861,456	0.03
	マン島	21,906,524	0.03
	ペルー	21,324,943	0.02
	シンガポール	20,588,904	0.02
	アルゼンチン	18,149,837	0.02
	パキスタン	16,946,491	0.02
	小計	83,982,538,181	97.92
投資信託受益証券	ブラジル	164,514,236	0.19
	メキシコ	28,169,742	0.03
	小計	192,683,978	0.22
投資証券	メキシコ	36,637,642	0.04
	南アフリカ	26,317,248	0.03
	小計	62,954,890	0.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,530,508,299	1.78
合計(純資産総額)		85,768,685,348	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	1,876,630,950	2.19

(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	—	357,006,000	0.42

(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(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,589,389	1,687.28	4,369,024,272	1,895.20	4,907,410,033	5.72
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	199,598	30,069.85	6,001,882,918	24,452.90	4,880,751,930	5.69
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	607,900	8,310.37	5,051,876,963	7,082.17	4,305,254,183	5.02
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	501,340	5,731.03	2,873,199,593	7,454.15	3,737,068,574	4.36
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	382,700	4,474.92	1,712,551,884	3,649.89	1,396,812,903	1.63
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	46,089	23,704.24	1,092,504,865	20,627.20	950,687,021	1.11
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	306,633	2,911.99	892,913,456	2,825.87	866,505,302	1.01
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	91,224	8,783.01	801,221,305	8,915.49	813,306,660	0.95
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,144,620	78.89	800,395,302	78.63	797,686,688	0.93
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	632,500	1,120.06	708,441,112	1,246.89	788,657,925	0.92
ブラジル	株式	VALE SA	素材	395,778	1,257.48	497,683,315	1,732.69	685,761,770	0.80
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	39,763	11,901.82	473,252,466	17,200.66	683,950,042	0.80
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,504,200	350.65	527,447,866	437.88	658,659,096	0.77
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	365,523	1,613.90	589,917,935	1,775.42	648,959,038	0.76
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	134,594	4,675.32	629,271,126	4,775.48	642,752,301	0.75
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	177,443	3,055.98	542,262,614	3,576.90	634,697,464	0.74
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	57,436	8,187.19	470,240,019	11,043.19	634,277,235	0.74
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	86,705	5,236.00	453,987,380	6,873.43	595,961,615	0.69
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	29,357	14,923.66	438,114,033	20,189.74	592,710,344	0.69
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	160,804	2,583.35	415,414,621	2,701.11	434,350,900	0.51

台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,302,248	298.81	389,132,539	332.67	433,221,447	0.51
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	43,945	9,091.44	399,523,331	9,671.04	424,993,853	0.50
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,464,515	62.74	405,615,994	65.41	422,876,249	0.49
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	271,136	1,274.08	345,450,311	1,532.31	415,466,438	0.48
ケイマン	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	324,000	1,069.78	346,608,720	1,259.57	408,101,490	0.48
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	541,702	657.03	355,916,632	750.89	406,761,865	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	96,664	3,871.77	374,260,969	4,161.31	402,248,870	0.47
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	653,000	675.51	441,108,030	596.07	389,238,608	0.45
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	4,819	69,876.79	336,736,299	77,397.59	372,979,034	0.43
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	629,017	457.47	287,756,407	579.39	364,448,046	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	5.00
		素材	7.47
		資本財	2.63
		商業・専門サービス	0.27
		運輸	1.36
		自動車・自動車部品	3.26
		耐久消費財・アパレル	1.35
		消費者サービス	1.47
		メディア・娯楽	8.37
		小売	11.74
		食品・生活必需品小売り	1.25
		食品・飲料・タバコ	3.51
		家庭用品・パーソナル用品	1.05
		ヘルスケア機器・サービス	1.25
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.33
		銀行	12.80
		各種金融	2.05
		保険	2.86
		不動産	1.93
		ソフトウェア・サービス	2.33
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9.31
		電気通信サービス	2.93

		公益事業	2.02
		半導体・半導体製造装置	8.37
		小計	97.92
投資信託受益証券	—	—	0.22
投資証券	—	—	0.07
合計			98.22

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	285	アメリカドル	17,974,935	1,860,405,772	18,131,700	1,876,630,950	2.19

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,450,000.00	356,937,000	357,006,000	0.42

(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	インドネシア	6,022,271,182	9.49
	メキシコ	5,983,885,313	9.43
	中国	5,631,308,495	8.88
	ブラジル	5,548,686,822	8.75
	タイ	5,457,073,821	8.60
	ポーランド	5,135,898,277	8.10
	ロシア	4,777,387,109	7.53

	南アフリカ	4,672,647,830	7.37
	マレーシア	4,349,289,195	6.86
	コロンビア	3,444,001,972	5.43
	チェコ	2,503,613,863	3.95
	ハンガリー	2,478,424,114	3.91
	ペルー	1,783,911,074	2.81
	チリ	1,744,506,734	2.75
	トルコ	1,237,473,041	1.95
	フィリピン	116,901,468	0.18
	ドミニカ共和国	85,555,005	0.13
	ウルグアイ	84,788,782	0.13
	小計	61,057,624,097	96.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,378,356,951	3.75
合計(純資産総額)		63,435,981,048	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	88,800,000,000	3.85	3,423,182,023	3.87	3,444,001,972	9.850	2027/6/28	5.43
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	61,500,000	1,654.45	1,017,488,451	1,711.91	1,052,825,285	0.000	2024/1/1	1.66
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	114,200,000	831.63	949,729,616	830.51	948,449,089	10.500	2026/12/21	1.50
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,721.95	881,639,207	1,761.33	901,801,008	0.000	2023/7/1	1.42
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000	2,189.29	826,457,524	2,198.85	830,065,906	10.000	2023/1/1	1.31
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000	2,252.48	756,833,616	2,298.28	772,225,234	10.000	2025/1/1	1.22
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	167,100,000	422.51	706,017,086	430.14	718,779,731	3.300	2038/6/17	1.13
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	24,350,000	2,816.71	685,870,563	2,810.31	684,312,771	3.885	2029/8/15	1.08
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000	1,588.25	682,949,254	1,587.01	682,416,639	2.940	2024/10/17	1.08
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	578.08	628,092,775	591.78	642,973,924	7.500	2027/6/3	1.01
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	26,850,000	2,284.81	613,472,143	2,349.56	630,858,395	10.000	2027/1/1	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	617.85	619,396,115	621.46	623,014,632	10.000	2024/12/5	0.98
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,659.49	607,693,906	2,647.64	604,986,599	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	3,097.42	600,900,600	3,084.50	598,393,704	2.500	2026/7/25	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	19,850,000	3,028.98	601,253,161	3,004.42	596,378,466	2.500	2024/4/25	0.94
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	89,200,000	671.19	598,708,705	667.65	595,552,292	8.000	2030/1/31	0.94

メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	93,600,000	615.53	576,144,682	633.73	593,176,269	8.500	2029/5/31	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,949.01	586,854,373	2,937.66	584,594,565	2.500	2023/1/25	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	536.20	580,173,648	535.25	579,145,997	6.500	2022/6/9	0.91
中国	国債証券	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000	1,603.68	561,291,304	1,605.57	561,952,706	3.250	2026/6/6	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	569.90	558,220,498	570.14	558,454,344	8.000	2023/12/7	0.88
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	126,700,000	427.45	541,581,113	432.18	547,578,331	3.400	2036/6/17	0.86
中国	国債証券	CGB 2.68% 05/21/30	35,400,000	1,516.20	536,737,823	1,522.51	538,968,851	2.680	2030/5/21	0.85
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	570.44	509,406,635	577.80	515,982,544	8.750	2048/2/28	0.81
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	421.06	481,274,037	423.38	483,923,968	3.650	2031/6/20	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	3,188.83	479,919,176	3,180.83	478,715,263	2.750	2029/10/25	0.75
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,549.41	472,571,951	1,558.32	475,287,686	2.850	2027/6/4	0.75
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	24,050,000	1,916.92	461,019,624	1,934.61	465,273,929	0.000	2022/1/1	0.73
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000	0.84	436,925,008	0.86	451,997,624	8.375	2034/3/15	0.71
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000	3,165.67	449,525,505	3,158.73	448,540,513	2.750	2028/4/25	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	96.25
合計	96.25

(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。

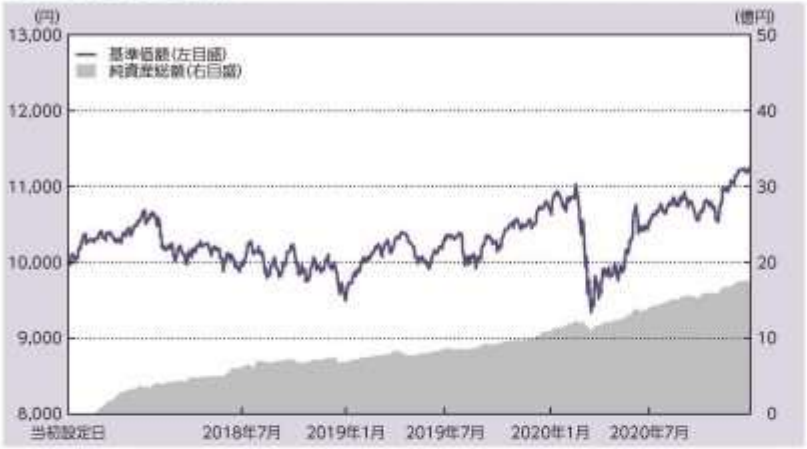
≪参考情報≫

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：2017年 8 月25日
作成基準日：2020年12月30日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	11,256円
純資産総額	17.28億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2018年６月	0円
2019年６月	0円
2020年６月	0円
－	－
－	－
設定来分配金合計額	0円

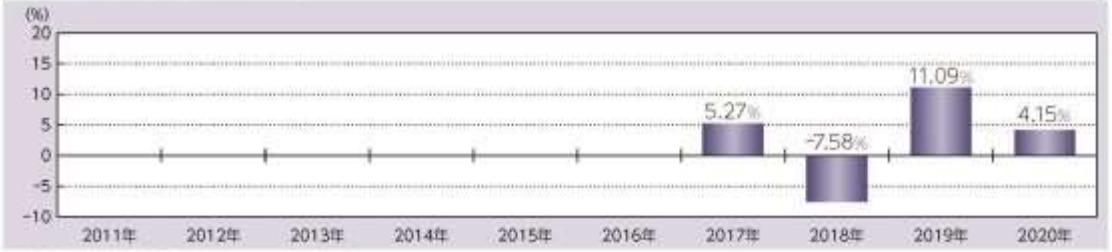
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券インデックスマザーファンド	38.9%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.2%
		T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.2%
新興国債券インデックスマザーファンド	29.0%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	1.6%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.5%
外国株式インデックスマザーファンド	14.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.7%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	11.1%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.6%
		ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	0.6%
国内債券インデックスマザーファンド	3.8%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.1%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.0%
国内株式インデックスマザーファンド	1.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。
解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞

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

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

①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。

②マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2017年 8月25日設定）
ただし、下記「(5)その他　＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとします。
ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2018年6月11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）
①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。
・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合
②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。
③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。
④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）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。
①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①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。

④上記①から③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①から③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いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①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。

④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。

⑤上記①から④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。

⑥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＞

①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。

②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＞

①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。

②上記①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。

③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。

④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

①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。

②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。

③上記②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。

④上記②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。

⑤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

①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。

②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。

③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。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2019年6月11日から2020年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2019年 6月10日現在）	第3期 （2020年 6月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,635,642	6,205,398
親投資信託受益証券	816,435,940	1,351,788,371
未収入金	1,980,000	24,747,491
流動資産合計	825,051,582	1,382,741,260
資産合計	825,051,582	1,382,741,260
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	4,252,557
未払受託者報酬	203,494	323,670
未払委託者報酬	1,627,861	2,589,287
未払利息	13	9
その他未払費用	20,294	32,329
流動負債合計	1,851,662	7,197,852
負債合計	1,851,662	7,197,852
純資産の部		
元本等		
元本	814,756,255	1,294,679,455
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,443,665	80,863,953
（分配準備積立金）	25,549,910	49,168,177
元本等合計	823,199,920	1,375,543,408
純資産合計	823,199,920	1,375,543,408
負債純資産合計	825,051,582	1,382,741,260

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　2018年 6月12日 至　2019年 6月10日	第3期 自　2019年 6月11日 至　2020年 6月10日
営業収益		
受取利息	2	38
有価証券売買等損益	10,715,901	60,130,302
営業収益合計	10,715,903	60,130,340
営業費用		
支払利息	5,791	5,759
受託者報酬	386,486	569,450
委託者報酬	3,091,725	4,555,458
その他費用	38,833	56,846
営業費用合計	3,522,835	5,187,513
営業利益又は営業損失（△）	7,193,068	54,942,827
経常利益又は経常損失（△）	7,193,068	54,942,827
当期純利益又は当期純損失（△）	7,193,068	54,942,827
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（△）	1,860,595	7,411,502
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,018,191	8,443,665
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,009,915	29,117,714
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,009,915	29,117,714
剰余金減少額又は欠損金増加額	916,914	4,228,751
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	916,914	4,228,751
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,443,665	80,863,953

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第2期 (2019年 6月10日現在)		第3期 (2020年 6月10日現在)	
１．計算期間の末日における受益権の総数		814,756,255口		1,294,679,455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	1.0104円	1口当たり純資産額	1.0625円
	(1万口当たり純資産額)	(10,104円)	(1万口当たり純資産額)	(10,625円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期
自 2018年 6月12日
至 2019年 6月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	20,667,429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	8,448,753円
分配準備積立金額	D	4,882,481円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	33,998,663円
当ファンドの期末残存口数	F	814,756,255口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	417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

第3期
自 2019年 6月11日
至 2020年 6月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	29,252,161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	35,290,537円
分配準備積立金額	D	19,916,016円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	84,458,714円
当ファンドの期末残存口数	F	1,294,679,455口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	652円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6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3期 (2020年 6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。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第2期 自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日	第3期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	543,341,082円	814,756,255円
期中追加設定元本額	566,171,068円	723,541,962円
期中一部解約元本額	294,755,895円	243,618,762円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 (2019年 6月10日現在)	第3期 (2020年 6月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	9,338,348	51,647,822
合計	9,338,348	51,647,822

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	57,626,843	156,842,978	
	国内株式インデックス　マザーファンド	13,301,270	20,401,487	
	外国株式インデックス　マザーファンド	70,550,945	194,078,594	
	国内債券インデックス　マザーファンド	39,042,936	55,081,774	
	外国債券インデックス　マザーファンド	179,380,486	525,459,257	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	236,795,714	399,924,281	
合計		596,698,194	1,351,788,371	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,973,876,480
株式	326,255,581,770
派生商品評価勘定	52,135,900
未収入金	3,926,850
未収配当金	2,558,353,487
差入委託証拠金	150,258,000
流動資産合計	341,994,132,487
資産合計	341,994,132,487
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,590,850
前受金	50,550,000
未払金	9,545,115,561
未払解約金	1,086,482,573
未払利息	19,108
その他未払費用	6,550
流動負債合計	10,683,764,642
負債合計	10,683,764,642
純資産の部	
元本等	

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
元本	216,012,632,233
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	115,297,735,612
元本等合計	331,310,367,845
純資産合計	331,310,367,845
負債純資産合計	341,994,132,487

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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)新株予約権証券 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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。
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 6月10日現在	
1．　計算期間の末日における受益権の総数		216,012,632,233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	1.5338円
	(1万口当たり純資産額)	(15,338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 6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 6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 6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	(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。 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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	193,692,560,770円
期中追加設定元本額	63,907,706,244円
期中一部解約元本額	41,587,634,781円
期末元本額	216,012,632,233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）	542,907,929円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,050,169,912円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,254,051円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,463,933,787円
世界経済インデックスファンド	2,256,721,136円
日本株式インデックス・オープン	4,165,942,335円

区分	2020年 6月10日現在
ＤＣマイセレクション２５	6,794,218,686円
ＤＣマイセレクション５０	19,234,801,214円
ＤＣマイセレクション７５	17,958,647,838円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,812,276,879円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,906,883,349円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,229,770,357円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,323,519,361円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,001,975,461円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	342,478,192円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	700,809,354円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	469,278,735円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,897,457,128円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,065,214,945円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,426,982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）	262,368,211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）	68,142,124円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	255,125,364円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	52,819,677円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	274,939,691円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,542,084,768円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	670,522,818円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,851,183,368円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	602,141,241円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	37,950,114円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	707,641,176円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	34,958,991円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	413,088,845円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	522,008,945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）	856,676,922円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	4,715,306,586円
日本株式ファンド・シリーズ２	2,082,905,592円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,952,406,845円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,608,223,828円
分散投資コア戦略ファンドＡ	5,599,750,637円
分散投資コア戦略ファンドＳ	15,160,167,055円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	325,675,940円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	345,980,602円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,536,410,555円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	208,485,418円

区分	2020年 6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）	10,921,764円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	67,879,951円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	13,589,672,309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	22,727,365円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	77,116,906円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	13,301,270円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,749,307円
グローバル経済コア	269,700,404円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	18,451,470円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	47,500,872円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	4,158,605円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	629,110,972円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	86,883,612円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	123,495円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	193,073円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	76,372円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	46,463円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	50,762,856,560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）	1,804,673,055円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	31,685,282円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,150,656円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	11,831,951,410
合計	11,831,951,410

(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 6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	4,746,000,000	－	4,796,550,000	50,550,000

合計	4,746,000,000	―	4,796,550,000	50,550,000

(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	6,800	2,760.00	18,768,000	
日本水産	194,200	521.00	101,178,200	
マルハニチロ	28,100	2,343.00	65,838,300	
カネコ種苗	5,900	1,436.00	8,472,400	
サカタのタネ	23,200	3,510.00	81,432,000	
ホクト	14,800	1,975.00	29,230,000	
ホクリヨウ	3,000	658.00	1,974,000	
住石ホールディングス	39,200	123.00	4,821,600	
日鉄鉱業	4,400	4,500.00	19,800,000	
三井松島ホールディングス	7,500	906.00	6,795,000	
国際石油開発帝石	779,000	779.80	607,464,200	
石油資源開発	25,400	2,123.00	53,924,200	
K＆Oエナジーグループ	9,400	1,549.00	14,560,600	
ヒノキヤグループ	4,800	1,831.00	8,788,800	
ショーボンドホールディングス	30,200	4,990.00	150,698,000	
ミライト・ホールディングス	57,700	1,526.00	88,050,200	
タマホーム	10,500	1,296.00	13,608,000	
サンヨーホームズ	1,700	652.00	1,108,400	
日本アクア	7,700	597.00	4,596,900	
ファーストコーポレーション	5,900	572.00	3,374,800	
ベステラ	3,300	1,069.00	3,527,700	
ＴＡＴＥＲＵ	40,000	183.00	7,320,000	
キャンディル	3,200	549.00	1,756,800	
スペースバリューホールディングス	23,700	385.00	9,124,500	
ダイセキ環境ソリューション	3,700	1,007.00	3,725,900	
第一カッター興業	2,400	2,055.00	4,932,000	
明豊ファシリティワークス	6,200	594.00	3,682,800	
安藤・間	115,600	690.00	79,764,000	

東急建設	56,900	600.00	34,140,000	
コムシスホールディングス	68,900	3,035.00	209,111,500	
ビーアールホールディングス	21,100	578.00	12,195,800	
高松コンストラクショングループ	12,100	2,393.00	28,955,300	
東建コーポレーション	6,000	7,440.00	44,640,000	
ソネック	2,000	838.00	1,676,000	
ヤマウラ	8,400	832.00	6,988,800	
大成建設	149,500	4,045.00	604,727,500	
大林組	448,400	1,063.00	476,649,200	
清水建設	455,100	921.00	419,147,100	
飛島建設	12,900	1,153.00	14,873,700	
長谷工コーポレーション	173,600	1,364.00	236,790,400	
松井建設	17,600	691.00	12,161,600	
錢高組	2,000	3,945.00	7,890,000	
鹿島建設	352,000	1,296.00	456,192,000	
不動テトラ	11,700	1,486.00	17,386,200	
大末建設	5,200	841.00	4,373,200	
鉄建建設	9,700	2,198.00	21,320,600	
西松建設	34,600	2,133.00	73,801,800	
三井住友建設	108,300	484.00	52,417,200	
大豊建設	10,100	2,461.00	24,856,100	
前田建設工業	112,300	875.00	98,262,500	
佐田建設	9,600	415.00	3,984,000	
ナカノフドー建設	12,300	385.00	4,735,500	
奥村組	24,300	2,621.00	63,690,300	
東鉄工業	19,200	2,800.00	53,760,000	
イチケン	3,200	1,599.00	5,116,800	
富士ピー・エス	6,600	577.00	3,808,200	
淺沼組	5,000	4,400.00	22,000,000	
戸田建設	186,200	704.00	131,084,800	
熊谷組	20,800	2,723.00	56,638,400	
北野建設	2,700	2,648.00	7,149,600	
植木組	2,000	2,470.00	4,940,000	
矢作建設工業	19,800	809.00	16,018,200	
ピーエス三菱	14,800	556.00	8,228,800	
日本ハウスホールディングス	30,600	305.00	9,333,000	
大東建託	49,000	11,650.00	570,850,000	
新日本建設	19,100	834.00	15,929,400	
ＮＩＰＰＯ	37,100	2,615.00	97,016,500	
東亜道路工業	2,800	3,265.00	9,142,000	
前田道路	39,600	2,182.00	86,407,200	
日本道路	4,300	7,470.00	32,121,000	

東亜建設工業	14,000	1,601.00	22,414,000	
日本国土開発	43,600	540.00	23,544,000	
若築建設	8,100	1,247.00	10,100,700	
東洋建設	50,300	419.00	21,075,700	
五洋建設	177,800	587.00	104,368,600	
世紀東急工業	21,500	760.00	16,340,000	
福田組	5,200	4,980.00	25,896,000	
住友林業	113,600	1,352.00	153,587,200	
日本基礎技術	15,100	427.00	6,447,700	
巴コーポレーション	19,900	397.00	7,900,300	
大和ハウス工業	443,700	2,916.50	1,294,051,050	
ライト工業	25,700	1,537.00	39,500,900	
積水ハウス	486,300	2,162.50	1,051,623,750	
日特建設	11,700	737.00	8,622,900	
北陸電気工事	7,800	925.00	7,215,000	
ユアテック	25,700	642.00	16,499,400	
日本リーテック	9,400	2,182.00	20,510,800	
四電工	2,400	2,519.00	6,045,600	
中電工	18,100	2,313.00	41,865,300	
関電工	63,800	973.00	62,077,400	
きんでん	106,500	1,816.00	193,404,000	
東京エネシス	14,900	818.00	12,188,200	
トーエネック	4,500	3,735.00	16,807,500	
住友電設	12,700	2,398.00	30,454,600	
日本電設工業	24,600	2,480.00	61,008,000	
協和エクシオ	68,000	2,533.00	172,244,000	
新日本空調	11,900	2,546.00	30,297,400	
九電工	31,500	3,080.00	97,020,000	
三機工業	32,300	1,312.00	42,377,600	
日揮ホールディングス	138,000	1,238.00	170,844,000	
中外炉工業	4,800	1,655.00	7,944,000	
ヤマト	14,300	665.00	9,509,500	
太平電業	10,800	2,392.00	25,833,600	
高砂熱学工業	39,000	1,815.00	70,785,000	
三晃金属工業	1,900	2,200.00	4,180,000	
朝日工業社	3,000	3,115.00	9,345,000	
明星工業	29,000	786.00	22,794,000	
大氣社	21,800	3,225.00	70,305,000	
ダイダン	10,700	2,904.00	31,072,800	
日比谷総合設備	14,400	1,852.00	26,668,800	
フィル・カンパニー	2,600	3,110.00	8,086,000	
ＯＳＪＢホールディングス	70,700	248.00	17,533,600	

東洋エンジニアリング	18,800	450.00	8,460,000	
レイズネクスト	24,000	1,236.00	29,664,000	
日本製粉	42,000	1,613.00	67,746,000	
日清製粉グループ本社	162,100	1,754.00	284,323,400	
日東富士製粉	1,000	6,200.00	6,200,000	
昭和産業	13,200	3,210.00	42,372,000	
鳥越製粉	12,700	930.00	11,811,000	
中部飼料	17,500	1,661.00	29,067,500	
フィード・ワン	96,400	202.00	19,472,800	
東洋精糖	2,400	1,265.00	3,036,000	
日本甜菜製糖	7,500	1,727.00	12,952,500	
三井製糖	12,600	2,107.00	26,548,200	
塩水港精糖	15,500	217.00	3,363,500	
日新製糖	6,800	1,954.00	13,287,200	
森永製菓	33,700	4,345.00	146,426,500	
中村屋	3,700	4,145.00	15,336,500	
江崎グリコ	42,600	5,280.00	224,928,000	
名糖産業	6,900	1,309.00	9,032,100	
井村屋グループ	8,100	2,050.00	16,605,000	
不二家	8,000	2,267.00	18,136,000	
山崎製パン	107,600	1,868.00	200,996,800	
第一屋製パン	2,500	970.00	2,425,000	
モロゾフ	2,400	5,740.00	13,776,000	
亀田製菓	8,200	5,330.00	43,706,000	
寿スピリッツ	13,800	5,270.00	72,726,000	
カルビー	65,400	3,010.00	196,854,000	
森永乳業	26,500	4,470.00	118,455,000	
六甲バター	9,500	1,566.00	14,877,000	
ヤクルト本社	98,700	6,890.00	680,043,000	
明治ホールディングス	94,900	8,260.00	783,874,000	
雪印メグミルク	34,600	2,631.00	91,032,600	
プリマハム	22,400	2,668.00	59,763,200	
日本ハム	54,800	4,330.00	237,284,000	
林兼産業	4,700	589.00	2,768,300	
丸大食品	15,300	1,980.00	30,294,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	11,500	2,724.00	31,326,000	
柿安本店	5,000	2,643.00	13,215,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	92,400	656.00	60,614,400	
サッポロホールディングス	49,000	2,226.00	109,074,000	
アサヒグループホールディングス	300,600	4,416.00	1,327,449,600	
キリンホールディングス	608,700	2,315.00	1,409,140,500	
宝ホールディングス	106,400	1,064.00	113,209,600	

オエノンホールディングス	37,900	408.00	15,463,200	
養命酒製造	4,400	1,889.00	8,311,600	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	100,700	2,274.00	228,991,800	
サントリー食品インターナショナル	96,000	4,425.00	424,800,000	
ダイドーグループホールディングス	7,400	4,765.00	35,261,000	
伊藤園	43,600	6,090.00	265,524,000	
キーコーヒー	14,100	2,297.00	32,387,700	
ユニカフェ	3,700	975.00	3,607,500	
ジャパンフーズ	2,000	1,202.00	2,404,000	
日清オイリオグループ	18,500	3,370.00	62,345,000	
不二製油グループ本社	35,000	2,904.00	101,640,000	
かどや製油	1,600	3,650.00	5,840,000	
Ｊ－オイルミルズ	7,400	4,075.00	30,155,000	
キッコーマン	103,300	5,430.00	560,919,000	
味の素	316,900	1,833.50	581,036,150	
キユーピー	79,900	2,157.00	172,344,300	
ハウス食品グループ本社	53,700	3,665.00	196,810,500	
カゴメ	54,500	3,030.00	165,135,000	
焼津水産化学工業	7,000	961.00	6,727,000	
アリアケジャパン	13,100	7,270.00	95,237,000	
ピエトロ	1,900	1,624.00	3,085,600	
エバラ食品工業	3,500	2,192.00	7,672,000	
やまみ	1,200	2,176.00	2,611,200	
ニチレイ	68,400	3,035.00	207,594,000	
東洋水産	73,800	5,570.00	411,066,000	
イートアンド	5,000	1,805.00	9,025,000	
大冷	1,900	1,979.00	3,760,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,129.00	9,032,000	
日清食品ホールディングス	61,000	8,850.00	539,850,000	
永谷園ホールディングス	7,000	2,194.00	15,358,000	
一正蒲鉾	5,600	1,049.00	5,874,400	
フジッコ	15,500	1,956.00	30,318,000	
ロック・フィールド	15,500	1,313.00	20,351,500	
日本たばこ産業	828,700	2,206.00	1,828,112,200	
ケンコーマヨネーズ	8,000	2,185.00	17,480,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,400	1,751.00	16,459,400	
なとり	8,000	1,745.00	13,960,000	
イフジ産業	2,500	826.00	2,065,000	
ピックルスコーポレーション	3,100	2,479.00	7,684,900	
北の達人コーポレーション	50,100	574.00	28,757,400	
ユーグレナ	61,900	840.00	51,996,000	
ミヨシ油脂	5,500	1,104.00	6,072,000	

理研ビタミン	13,600	2,253.00	30,640,800	
片倉工業	20,700	1,267.00	26,226,900	
グンゼ	10,400	3,890.00	40,456,000	
東洋紡	55,700	1,542.00	85,889,400	
ユニチカ	42,300	382.00	16,158,600	
富士紡ホールディングス	6,900	3,370.00	23,253,000	
倉敷紡績	14,100	2,385.00	33,628,500	
シキボウ	7,300	1,033.00	7,540,900	
日本毛織	46,600	1,051.00	48,976,600	
トーア紡コーポレーション	5,600	503.00	2,816,800	
帝国繊維	16,000	2,307.00	36,912,000	
帝人	114,500	1,813.00	207,588,500	
東レ	1,014,900	560.00	568,344,000	
サカイオーベックス	3,900	2,182.00	8,509,800	
住江織物	3,100	2,173.00	6,736,300	
日本フエルト	8,900	495.00	4,405,500	
イチカワ	2,400	1,311.00	3,146,400	
日東製網	1,600	1,360.00	2,176,000	
アツギ	11,700	634.00	7,417,800	
ダイニック	5,300	769.00	4,075,700	
セーレン	34,800	1,394.00	48,511,200	
ソトー	5,700	958.00	5,460,600	
東海染工	2,000	1,122.00	2,244,000	
小松マテーレ	23,100	757.00	17,486,700	
ワコールホールディングス	36,600	2,164.00	79,202,400	
ホギメディカル	16,000	3,410.00	54,560,000	
クラウディアホールディングス	3,700	439.00	1,624,300	
ＴＳＩホールディングス	47,200	505.00	23,836,000	
マツオカコーポレーション	4,100	2,170.00	8,897,000	
ワールド	19,900	1,673.00	33,292,700	
三陽商会	7,300	945.00	6,898,500	
ナイガイ	5,400	371.00	2,003,400	
オンワードホールディングス	84,400	391.00	33,000,400	
ルックホールディングス	4,900	867.00	4,248,300	
ゴールドウイン	25,400	6,690.00	169,926,000	
デサント	27,400	1,736.00	47,566,400	
キング	6,800	500.00	3,400,000	
ヤマトインターナショナル	12,600	380.00	4,788,000	
特種東海製紙	8,900	4,340.00	38,626,000	
王子ホールディングス	585,400	531.00	310,847,400	
日本製紙	61,900	1,635.00	101,206,500	
三菱製紙	15,900	390.00	6,201,000	

北越コーポレーション	83,500	415.00	34,652,500	
中越パルプ工業	5,900	1,486.00	8,767,400	
巴川製紙所	4,200	946.00	3,973,200	
大王製紙	61,700	1,459.00	90,020,300	
阿波製紙	3,600	525.00	1,890,000	
レンゴー	132,400	876.00	115,982,400	
トーモク	8,600	1,726.00	14,843,600	
ザ・パック	10,600	3,290.00	34,874,000	
クラレ	220,600	1,261.00	278,176,600	
旭化成	928,200	940.50	872,972,100	
共和レザー	7,600	705.00	5,358,000	
昭和電工	99,700	2,696.00	268,791,200	
住友化学	1,028,900	356.00	366,288,400	
住友精化	6,200	3,365.00	20,863,000	
日産化学	77,800	5,500.00	427,900,000	
ラサ工業	4,900	1,595.00	7,815,500	
クレハ	12,000	5,150.00	61,800,000	
多木化学	5,500	7,840.00	43,120,000	
テイカ	10,300	1,548.00	15,944,400	
石原産業	25,100	787.00	19,753,700	
片倉コープアグリ	3,600	1,231.00	4,431,600	
日本曹達	20,700	3,020.00	62,514,000	
東ソー	216,500	1,564.00	338,606,000	
トクヤマ	40,400	2,637.00	106,534,800	
セントラル硝子	28,600	2,090.00	59,774,000	
東亞合成	87,900	1,088.00	95,635,200	
大阪ソーダ	14,200	2,565.00	36,423,000	
関東電化工業	33,200	922.00	30,610,400	
デンカ	51,100	2,805.00	143,335,500	
信越化学工業	240,500	12,770.00	3,071,185,000	
日本カーバイド工業	4,700	1,418.00	6,664,600	
堺化学工業	9,100	2,075.00	18,882,500	
第一稀元素化学工業	15,200	811.00	12,327,200	
エア・ウォーター	130,300	1,595.00	207,828,500	
大陽日酸	134,600	1,979.00	266,373,400	
日本化学工業	4,400	2,371.00	10,432,400	
東邦アセチレン	2,100	1,286.00	2,700,600	
日本パーカライジング	70,600	1,189.00	83,943,400	
高圧ガス工業	22,200	775.00	17,205,000	
チタン工業	1,700	1,851.00	3,146,700	
四国化成工業	21,600	1,144.00	24,710,400	
戸田工業	3,200	1,860.00	5,952,000	

ステラ　ケミファ	7,600	2,754.00	20,930,400	
保土谷化学工業	5,200	4,045.00	21,034,000	
日本触媒	21,700	6,060.00	131,502,000	
大日精化工業	12,400	2,547.00	31,582,800	
カネカ	36,200	2,994.00	108,382,800	
三菱瓦斯化学	130,300	1,678.00	218,643,400	
三井化学	127,200	2,475.00	314,820,000	
ＪＳＲ	130,500	2,018.00	263,349,000	
東京応化工業	24,000	5,020.00	120,480,000	
大阪有機化学工業	12,900	2,046.00	26,393,400	
三菱ケミカルホールディングス	936,200	673.10	630,156,220	
ＫＨネオケム	24,700	2,204.00	54,438,800	
ダイセル	182,300	925.00	168,627,500	
住友ベークライト	22,000	3,370.00	74,140,000	
積水化学工業	301,100	1,581.00	476,039,100	
日本ゼオン	126,300	1,060.00	133,878,000	
アイカ工業	42,000	3,355.00	140,910,000	
宇部興産	70,700	2,006.00	141,824,200	
積水樹脂	25,200	2,347.00	59,144,400	
タキロンシーアイ	30,300	703.00	21,300,900	
旭有機材	7,900	1,517.00	11,984,300	
ニチバン	7,400	1,502.00	11,114,800	
リケンテクノス	35,200	433.00	15,241,600	
大倉工業	6,600	1,690.00	11,154,000	
積水化成品工業	18,800	624.00	11,731,200	
群栄化学工業	3,200	2,676.00	8,563,200	
タイガースポリマー	7,400	500.00	3,700,000	
ミライアル	4,900	1,197.00	5,865,300	
ダイキアクシス	5,000	865.00	4,325,000	
ダイキョーニシカワ	29,500	601.00	17,729,500	
竹本容器	5,000	766.00	3,830,000	
森六ホールディングス	7,500	1,731.00	12,982,500	
日本化薬	86,700	1,132.00	98,144,400	
カーリットホールディングス	14,900	551.00	8,209,900	
日本精化	11,300	1,460.00	16,498,000	
扶桑化学工業	14,200	3,920.00	55,664,000	
トリケミカル研究所	3,100	11,470.00	35,557,000	
ＡＤＥＫＡ	64,500	1,523.00	98,233,500	
日油	52,700	3,820.00	201,314,000	
新日本理化	23,200	184.00	4,268,800	
ハリマ化成グループ	11,600	1,038.00	12,040,800	
花王	342,400	8,966.00	3,069,958,400	

第一工業製薬	5,200	4,920.00	25,584,000	
石原ケミカル	3,800	1,958.00	7,440,400	
日華化学	4,700	953.00	4,479,100	
ニイタカ	2,900	4,395.00	12,745,500	
三洋化成工業	8,400	4,945.00	41,538,000	
有機合成薬品工業	10,700	383.00	4,098,100	
大日本塗料	15,800	949.00	14,994,200	
日本ペイントホールディングス	115,600	7,880.00	910,928,000	
関西ペイント	157,300	2,312.00	363,677,600	
神東塗料	11,000	202.00	2,222,000	
中国塗料	39,900	817.00	32,598,300	
日本特殊塗料	10,500	1,004.00	10,542,000	
藤倉化成	18,900	538.00	10,168,200	
太陽ホールディングス	10,300	5,020.00	51,706,000	
ＤＩＣ	59,100	2,878.00	170,089,800	
サカタインクス	30,600	1,087.00	33,262,200	
東洋インキＳＣホールディングス	29,600	2,150.00	63,640,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	10,800	830.00	8,964,000	
富士フイルムホールディングス	274,200	5,011.00	1,374,016,200	
資生堂	284,100	7,223.00	2,052,054,300	
ライオン	185,900	2,442.00	453,967,800	
高砂香料工業	8,900	2,495.00	22,205,500	
マンダム	32,100	2,135.00	68,533,500	
ミルボン	19,100	5,270.00	100,657,000	
ファンケル	57,900	3,050.00	176,595,000	
コーセー	26,900	14,870.00	400,003,000	
コタ	8,200	1,204.00	9,872,800	
シーボン	1,900	2,160.00	4,104,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	61,000	2,228.00	135,908,000	
ノエビアホールディングス	12,100	4,705.00	56,930,500	
アジュバンコスメジャパン	3,200	960.00	3,072,000	
エステー	9,200	1,655.00	15,226,000	
アグロ　カネショウ	6,000	1,360.00	8,160,000	
コニシ	23,500	1,552.00	36,472,000	
長谷川香料	24,600	2,303.00	56,653,800	
星光ＰＭＣ	8,200	751.00	6,158,200	
小林製薬	40,100	9,700.00	388,970,000	
荒川化学工業	12,800	1,279.00	16,371,200	
メック	9,800	2,021.00	19,805,800	
日本高純度化学	3,900	2,560.00	9,984,000	
タカラバイオ	37,400	3,385.00	126,599,000	
ＪＣＵ	17,300	3,185.00	55,100,500	

新田ゼラチン	9,000	735.00	6,615,000	
ＯＡＴアグリオ	2,500	1,192.00	2,980,000	
デクセリアルズ	36,900	882.00	32,545,800	
アース製薬	10,800	7,390.00	79,812,000	
北興化学工業	14,600	624.00	9,110,400	
大成ラミック	4,700	2,778.00	13,056,600	
クミアイ化学工業	59,100	900.00	53,190,000	
日本農薬	25,500	508.00	12,954,000	
アキレス	9,900	1,761.00	17,433,900	
有沢製作所	22,600	834.00	18,848,400	
日東電工	98,700	6,170.00	608,979,000	
レック	15,200	1,790.00	27,208,000	
三光合成	16,300	313.00	5,101,900	
きもと	24,300	164.00	3,985,200	
藤森工業	12,800	3,715.00	47,552,000	
前澤化成工業	9,100	1,025.00	9,327,500	
未来工業	7,700	1,998.00	15,384,600	
ウェーブロックホールディングス	4,900	762.00	3,733,800	
ＪＳＰ	8,400	1,558.00	13,087,200	
エフピコ	15,700	7,950.00	124,815,000	
天馬	9,500	1,754.00	16,663,000	
信越ポリマー	25,700	937.00	24,080,900	
東リ	35,600	278.00	9,896,800	
ニフコ	52,500	2,520.00	132,300,000	
バルカー	11,600	2,040.00	23,664,000	
ユニ・チャーム	275,600	4,049.00	1,115,904,400	
ショーエイコーポレーション	2,100	905.00	1,900,500	
協和キリン	143,800	2,829.00	406,810,200	
武田薬品工業	1,189,700	4,115.00	4,895,615,500	
アステラス製薬	1,239,800	1,839.50	2,280,612,100	
大日本住友製薬	106,000	1,617.00	171,402,000	
塩野義製薬	179,800	6,614.00	1,189,197,200	
わかもと製薬	17,000	321.00	5,457,000	
あすか製薬	16,300	1,296.00	21,124,800	
日本新薬	37,400	9,040.00	338,096,000	
ビオフェルミン製薬	2,400	2,310.00	5,544,000	
中外製薬	149,100	15,810.00	2,357,271,000	
科研製薬	24,500	5,730.00	140,385,000	
エーザイ	171,200	8,896.00	1,522,995,200	
ロート製薬	73,400	3,275.00	240,385,000	
小野薬品工業	328,400	3,027.00	994,066,800	
久光製薬	37,800	5,580.00	210,924,000	

持田製薬	19,800	4,170.00	82,566,000	
参天製薬	266,400	2,037.00	542,656,800	
扶桑薬品工業	5,000	2,600.00	13,000,000	
日本ケミファ	1,900	2,662.00	5,057,800	
ツムラ	44,300	2,930.00	129,799,000	
日医工	40,500	1,336.00	54,108,000	
キッセイ薬品工業	25,300	2,760.00	69,828,000	
生化学工業	27,700	1,171.00	32,436,700	
栄研化学	25,100	1,849.00	46,409,900	
日水製薬	6,000	1,242.00	7,452,000	
鳥居薬品	8,900	3,265.00	29,058,500	
ＪＣＲファーマ	10,100	12,060.00	121,806,000	
東和薬品	18,300	2,211.00	40,461,300	
富士製薬工業	9,700	1,244.00	12,066,800	
沢井製薬	29,400	5,970.00	175,518,000	
ゼリア新薬工業	25,900	2,038.00	52,784,200	
第一三共	409,200	8,968.00	3,669,705,600	
キョーリン製薬ホールディングス	31,600	2,164.00	68,382,400	
大幸薬品	17,500	2,232.00	39,060,000	
ダイト	8,700	4,425.00	38,497,500	
大塚ホールディングス	272,400	4,969.00	1,353,555,600	
大正製薬ホールディングス	30,200	6,850.00	206,870,000	
ペプチドリーム	72,700	4,975.00	361,682,500	
日本コークス工業	120,800	69.00	8,335,200	
ニチレキ	16,900	1,652.00	27,918,800	
ユシロ化学工業	8,000	1,323.00	10,584,000	
ビーピー・カストロール	5,100	1,299.00	6,624,900	
富士石油	38,200	188.00	7,181,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,200	1,108.00	5,761,600	
出光興産	158,700	2,429.00	385,482,300	
ＪＸＴＧホールディングス	2,151,100	421.90	907,549,090	
コスモエネルギーホールディングス	41,400	1,749.00	72,408,600	
横浜ゴム	82,800	1,725.00	142,830,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	82,100	1,589.00	130,456,900	
ブリヂストン	411,900	3,703.00	1,525,265,700	
住友ゴム工業	128,500	1,191.00	153,043,500	
藤倉コンポジット	12,500	390.00	4,875,000	
オカモト	8,700	3,980.00	34,626,000	
フコク	6,300	692.00	4,359,600	
ニッタ	16,100	2,394.00	38,543,400	
住友理工	27,700	681.00	18,863,700	
三ツ星ベルト	18,800	1,769.00	33,257,200	

バンドー化学	25,200	656.00	16,531,200	
日東紡績	21,300	5,190.00	110,547,000	
ＡＧＣ	141,400	3,440.00	486,416,000	
日本板硝子	68,400	469.00	32,079,600	
石塚硝子	2,600	2,151.00	5,592,600	
日本山村硝子	6,000	910.00	5,460,000	
日本電気硝子	57,500	1,907.00	109,652,500	
オハラ	5,700	1,156.00	6,589,200	
住友大阪セメント	27,100	3,890.00	105,419,000	
太平洋セメント	90,300	2,620.00	236,586,000	
日本ヒューム	14,400	753.00	10,843,200	
日本コンクリート工業	30,900	280.00	8,652,000	
三谷セキサン	6,700	5,320.00	35,644,000	
アジアパイルホールディングス	20,400	488.00	9,955,200	
東海カーボン	149,800	1,055.00	158,039,000	
日本カーボン	7,400	3,730.00	27,602,000	
東洋炭素	8,400	1,777.00	14,926,800	
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	3,700.00	29,230,000	
ＴＯＴＯ	102,100	4,530.00	462,513,000	
日本碍子	171,700	1,681.00	288,627,700	
日本特殊陶業	108,800	1,762.00	191,705,600	
ＭＡＲＵＷＡ	5,500	8,240.00	45,320,000	
品川リフラクトリーズ	3,800	2,594.00	9,857,200	
黒崎播磨	2,800	4,250.00	11,900,000	
ヨータイ	11,400	740.00	8,436,000	
イソライト工業	7,400	537.00	3,973,800	
東京窯業	18,300	304.00	5,563,200	
ニッカトー	6,500	720.00	4,680,000	
フジミインコーポレーテッド	12,800	3,125.00	40,000,000	
クニミネ工業	5,800	1,008.00	5,846,400	
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,197.00	2,872,800	
ニチアス	39,200	2,446.00	95,883,200	
ニチハ	19,900	2,432.00	48,396,800	
日本製鉄	632,900	1,095.50	693,341,950	
神戸製鋼所	259,000	430.00	111,370,000	
中山製鋼所	19,800	381.00	7,543,800	
合同製鐵	7,600	2,149.00	16,332,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	382,000	894.00	341,508,000	
東京製鐵	68,900	678.00	46,714,200	
共英製鋼	16,000	1,450.00	23,200,000	
大和工業	30,100	2,297.00	69,139,700	
東京鐵鋼	5,900	1,409.00	8,313,100	

大阪製鐵	7,600	1,350.00	10,260,000	
淀川製鋼所	19,100	1,817.00	34,704,700	
丸一鋼管	45,900	2,868.00	131,641,200	
モリ工業	4,300	2,440.00	10,492,000	
大同特殊鋼	23,200	3,780.00	87,696,000	
日本高周波鋼業	5,400	392.00	2,116,800	
日本冶金工業	11,700	1,812.00	21,200,400	
山陽特殊製鋼	9,700	1,091.00	10,582,700	
愛知製鋼	8,000	3,170.00	25,360,000	
日立金属	152,400	1,332.00	202,996,800	
日本金属	3,300	715.00	2,359,500	
大平洋金属	9,600	1,870.00	17,952,000	
新日本電工	91,500	176.00	16,104,000	
栗本鐵工所	7,000	1,847.00	12,929,000	
虹技	2,100	1,257.00	2,639,700	
三菱製鋼	10,600	738.00	7,822,800	
日亜鋼業	20,900	291.00	6,081,900	
日本精線	2,300	3,580.00	8,234,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,100	693.00	4,227,300	
シンニッタン	22,200	282.00	6,260,400	
新家工業	3,300	1,185.00	3,910,500	
大紀アルミニウム工業所	23,500	618.00	14,523,000	
日本軽金属ホールディングス	358,500	196.00	70,266,000	
三井金属鉱業	38,200	2,400.00	91,680,000	
東邦亜鉛	7,300	1,678.00	12,249,400	
三菱マテリアル	93,500	2,486.00	232,441,000	
住友金属鉱山	180,800	3,186.00	576,028,800	
ＤＯＷＡホールディングス	35,800	3,615.00	129,417,000	
古河機械金属	25,300	1,147.00	29,019,100	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,800	1,130.00	16,724,000	
東邦チタニウム	25,500	747.00	19,048,500	
ＵＡＣＪ	21,500	2,083.00	44,784,500	
ＣＫサンエツ	3,000	3,330.00	9,990,000	
古河電気工業	44,000	2,720.00	119,680,000	
住友電気工業	528,800	1,377.00	728,157,600	
フジクラ	171,100	340.00	58,174,000	
昭和電線ホールディングス	16,400	1,091.00	17,892,400	
東京特殊電線	2,200	2,313.00	5,088,600	
タツタ電線	28,300	593.00	16,781,900	
カナレ電気	2,400	1,888.00	4,531,200	
平河ヒューテック	7,200	1,100.00	7,920,000	
リョービ	17,500	1,477.00	25,847,500	

アーレスティ	18,800	406.00	7,632,800	
アサヒホールディングス	24,800	2,779.00	68,919,200	
稲葉製作所	8,000	1,396.00	11,168,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,300	1,681.00	7,228,300	
トーカロ	39,300	1,089.00	42,797,700	
アルファＣｏ	5,000	978.00	4,890,000	
ＳＵＭＣＯ	168,000	1,683.00	282,744,000	
川田テクノロジーズ	2,900	5,210.00	15,109,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,000	3,625.00	14,500,000	
信和	8,100	735.00	5,953,500	
東洋製罐グループホールディングス	90,100	1,354.00	121,995,400	
ホッカンホールディングス	7,800	1,700.00	13,260,000	
コロナ	7,800	1,001.00	7,807,800	
横河ブリッジホールディングス	26,300	2,199.00	57,833,700	
駒井ハルテック	2,600	1,505.00	3,913,000	
高田機工	1,300	2,401.00	3,121,300	
三和ホールディングス	133,300	1,010.00	134,633,000	
文化シヤッター	41,700	796.00	33,193,200	
三協立山	18,200	1,054.00	19,182,800	
アルインコ	10,300	959.00	9,877,700	
東洋シヤッター	3,400	700.00	2,380,000	
ＬＩＸＩＬグループ	208,600	1,638.00	341,686,800	
日本フイルコン	10,800	542.00	5,853,600	
ノーリツ	29,300	1,306.00	38,265,800	
長府製作所	14,400	2,325.00	33,480,000	
リンナイ	27,500	9,350.00	257,125,000	
ダイニチ工業	7,600	670.00	5,092,000	
日東精工	19,500	497.00	9,691,500	
三洋工業	1,900	1,831.00	3,478,900	
岡部	28,700	855.00	24,538,500	
ジーテクト	17,600	1,229.00	21,630,400	
東プレ	26,400	1,384.00	36,537,600	
高周波熱錬	27,200	581.00	15,803,200	
東京製綱	10,100	620.00	6,262,000	
サンコール	10,600	479.00	5,077,400	
モリテック　スチール	11,000	326.00	3,586,000	
パイオラックス	20,900	1,737.00	36,303,300	
エイチワン	13,900	629.00	8,743,100	
日本発條	151,700	796.00	120,753,200	
中央発條	1,700	2,811.00	4,778,700	
アドバネクス	2,000	1,308.00	2,616,000	
立川ブラインド工業	6,200	1,283.00	7,954,600	

三益半導体工業	11,000	2,264.00	24,904,000	
日本ドライケミカル	3,600	1,719.00	6,188,400	
日本製鋼所	43,000	1,656.00	71,208,000	
三浦工業	61,200	4,480.00	274,176,000	
タクマ	48,000	1,442.00	69,216,000	
ツガミ	29,400	1,018.00	29,929,200	
オークマ	16,500	5,070.00	83,655,000	
芝浦機械	16,000	2,411.00	38,576,000	
アマダ	175,500	1,012.00	177,606,000	
アイダエンジニアリング	37,200	782.00	29,090,400	
滝澤鉄工所	4,500	1,059.00	4,765,500	
ＦＵＪＩ	60,900	1,953.00	118,937,700	
牧野フライス製作所	16,600	3,685.00	61,171,000	
オーエスジー	65,400	1,745.00	114,123,000	
ダイジェット工業	1,700	1,339.00	2,276,300	
旭ダイヤモンド工業	37,300	545.00	20,328,500	
ＤＭＧ森精機	89,600	1,438.00	128,844,800	
ソディック	33,300	875.00	29,137,500	
ディスコ	19,200	26,730.00	513,216,000	
日東工器	7,800	2,016.00	15,724,800	
日進工具	5,600	2,692.00	15,075,200	
パンチ工業	13,000	442.00	5,746,000	
冨士ダイス	6,400	675.00	4,320,000	
豊和工業	8,000	815.00	6,520,000	
ＯＫＫ	5,800	446.00	2,586,800	
東洋機械金属	10,300	445.00	4,583,500	
津田駒工業	2,900	1,008.00	2,923,200	
エンシュウ	3,500	1,014.00	3,549,000	
島精機製作所	22,300	1,640.00	36,572,000	
オプトラン	15,800	2,570.00	40,606,000	
ＮＣホールディングス	4,500	544.00	2,448,000	
イワキポンプ	9,100	1,061.00	9,655,100	
フリュー	13,900	957.00	13,302,300	
ヤマシンフィルタ	30,800	1,068.00	32,894,400	
日阪製作所	17,600	804.00	14,150,400	
やまびこ	27,500	1,011.00	27,802,500	
平田機工	6,700	6,190.00	41,473,000	
ペガサスミシン製造	14,600	375.00	5,475,000	
マルマエ	5,300	1,012.00	5,363,600	
タツモ	6,700	1,752.00	11,738,400	
ナブテスコ	83,400	3,420.00	285,228,000	
三井海洋開発	15,100	1,739.00	26,258,900	

レオン自動機	13,900	1,384.00	19,237,600	
ＳＭＣ	44,900	55,890.00	2,509,461,000	
ホソカワミクロン	5,000	5,960.00	29,800,000	
ユニオンツール	5,300	2,894.00	15,338,200	
オイレス工業	18,300	1,464.00	26,791,200	
日精エー・エス・ビー機械	4,100	3,520.00	14,432,000	
サトーホールディングス	20,200	2,568.00	51,873,600	
技研製作所	12,500	5,020.00	62,750,000	
日本エアーテック	5,100	1,036.00	5,283,600	
カワタ	4,300	813.00	3,495,900	
日精樹脂工業	12,000	880.00	10,560,000	
オカダアイヨン	4,600	1,003.00	4,613,800	
ワイエイシイホールディングス	6,100	527.00	3,214,700	
小松製作所	647,700	2,306.00	1,493,596,200	
住友重機械工業	81,900	2,695.00	220,720,500	
日立建機	57,300	3,055.00	175,051,500	
日工	19,700	671.00	13,218,700	
巴工業	6,100	1,874.00	11,431,400	
井関農機	14,400	1,258.00	18,115,200	
ＴＯＷＡ	14,500	1,244.00	18,038,000	
丸山製作所	3,000	1,281.00	3,843,000	
北川鉄工所	6,500	1,804.00	11,726,000	
ローツェ	6,300	5,380.00	33,894,000	
タカキタ	5,100	593.00	3,024,300	
クボタ	758,700	1,613.50	1,224,162,450	
荏原実業	3,600	2,605.00	9,378,000	
三菱化工機	5,000	1,761.00	8,805,000	
月島機械	26,400	1,300.00	34,320,000	
帝国電機製作所	11,900	1,273.00	15,148,700	
新東工業	34,100	814.00	27,757,400	
澁谷工業	12,500	3,140.00	39,250,000	
アイチ　コーポレーション	24,900	754.00	18,774,600	
小森コーポレーション	36,400	734.00	26,717,600	
鶴見製作所	11,100	1,883.00	20,901,300	
住友精密工業	2,200	2,459.00	5,409,800	
日本ギア工業	6,100	292.00	1,781,200	
酒井重工業	2,700	2,500.00	6,750,000	
荏原製作所	59,200	2,729.00	161,556,800	
石井鐵工所	1,900	2,530.00	4,807,000	
西島製作所	14,600	838.00	12,234,800	
北越工業	14,800	1,104.00	16,339,200	
ダイキン工業	182,200	16,760.00	3,053,672,000	

オルガノ	5,200	5,880.00	30,576,000	
トーヨーカネツ	6,300	2,225.00	14,017,500	
栗田工業	77,400	3,075.00	238,005,000	
椿本チエイン	20,400	2,960.00	60,384,000	
大同工業	7,000	707.00	4,949,000	
木村化工機	12,200	478.00	5,831,600	
アネスト岩田	22,400	876.00	19,622,400	
ダイフク	73,100	8,860.00	647,666,000	
サムコ	3,600	2,150.00	7,740,000	
加藤製作所	7,900	1,282.00	10,127,800	
油研工業	2,500	1,534.00	3,835,000	
タダノ	69,100	939.00	64,884,900	
フジテック	52,000	1,809.00	94,068,000	
ＣＫＤ	39,200	1,969.00	77,184,800	
キトー	10,900	1,288.00	14,039,200	
平和	39,900	1,895.00	75,610,500	
理想科学工業	12,700	1,495.00	18,986,500	
ＳＡＮＫＹＯ	31,900	2,886.00	92,063,400	
日本金銭機械	16,000	659.00	10,544,000	
マースグループホールディングス	9,100	1,652.00	15,033,200	
フクシマガリレイ	8,800	3,590.00	31,592,000	
オーイズミ	6,200	413.00	2,560,600	
ダイコク電機	6,600	1,271.00	8,388,600	
竹内製作所	24,000	1,808.00	43,392,000	
アマノ	37,500	2,458.00	92,175,000	
ＪＵＫＩ	19,900	661.00	13,153,900	
蛇の目ミシン工業	13,200	489.00	6,454,800	
マックス	21,900	1,677.00	36,726,300	
グローリー	36,800	2,641.00	97,188,800	
新晃工業	13,400	1,505.00	20,167,000	
大和冷機工業	20,800	1,038.00	21,590,400	
セガサミーホールディングス	141,900	1,389.00	197,099,100	
日本ピストンリング	5,300	1,245.00	6,598,500	
リケン	6,700	3,050.00	20,435,000	
ＴＰＲ	19,300	1,589.00	30,667,700	
ツバキ・ナカシマ	29,300	1,050.00	30,765,000	
ホシザキ	41,800	9,220.00	385,396,000	
大豊工業	11,800	612.00	7,221,600	
日本精工	269,300	898.00	241,831,400	
ＮＴＮ	331,300	253.00	83,818,900	
ジェイテクト	137,300	964.00	132,357,200	
不二越	13,300	3,740.00	49,742,000	

日本トムソン	42,700	401.00	17,122,700	
ＴＨＫ	83,200	2,959.00	246,188,800	
ユーシン精機	11,200	796.00	8,915,200	
前澤給装工業	5,200	1,994.00	10,368,800	
イーグル工業	17,800	795.00	14,151,000	
前澤工業	9,800	353.00	3,459,400	
日本ピラー工業	14,500	1,474.00	21,373,000	
キッツ	58,100	736.00	42,761,600	
マキタ	186,500	3,920.00	731,080,000	
日立造船	113,700	411.00	46,730,700	
三菱重工業	239,700	2,971.00	712,148,700	
ＩＨＩ	103,100	1,820.00	187,642,000	
スター精密	22,100	1,342.00	29,658,200	
日清紡ホールディングス	95,400	889.00	84,810,600	
イビデン	87,800	2,969.00	260,678,200	
コニカミノルタ	313,700	453.00	142,106,100	
ブラザー工業	174,900	2,116.00	370,088,400	
ミネベアミツミ	265,700	2,115.00	561,955,500	
日立製作所	687,100	3,709.00	2,548,453,900	
三菱電機	1,430,000	1,483.50	2,121,405,000	
富士電機	86,200	3,055.00	263,341,000	
東洋電機製造	5,300	1,252.00	6,635,600	
安川電機	153,900	3,895.00	599,440,500	
シンフォニアテクノロジー	18,600	1,126.00	20,943,600	
明電舎	26,300	1,824.00	47,971,200	
オリジン	4,000	1,538.00	6,152,000	
山洋電気	7,000	4,695.00	32,865,000	
デンヨー	12,200	1,933.00	23,582,600	
東芝テック	17,900	3,990.00	71,421,000	
芝浦メカトロニクス	2,700	3,020.00	8,154,000	
マブチモーター	39,700	3,600.00	142,920,000	
日本電産	344,200	7,000.00	2,409,400,000	
トレックス・セミコンダクター	8,700	1,280.00	11,136,000	
東光高岳	8,500	1,059.00	9,001,500	
ダイヘン	15,700	3,605.00	56,598,500	
ヤーマン	24,100	781.00	18,822,100	
ＪＶＣケンウッド	119,700	190.00	22,743,000	
ミマキエンジニアリング	14,300	401.00	5,734,300	
第一精工	6,100	2,529.00	15,426,900	
日新電機	33,600	1,154.00	38,774,400	
大崎電気工業	28,700	527.00	15,124,900	
オムロン	128,200	7,440.00	953,808,000	

日東工業	21,100	1,886.00	39,794,600	
ＩＤＥＣ	20,700	1,750.00	36,225,000	
正興電機製作所	4,000	1,032.00	4,128,000	
不二電機工業	2,800	1,314.00	3,679,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	48,000	1,969.00	94,512,000	
サクサホールディングス	3,400	1,803.00	6,130,200	
メルコホールディングス	5,200	2,840.00	14,768,000	
テクノメディカ	3,500	1,840.00	6,440,000	
日本電気	173,500	5,040.00	874,440,000	
富士通	137,900	11,925.00	1,644,457,500	
沖電気工業	58,200	1,111.00	64,660,200	
岩崎通信機	6,300	850.00	5,355,000	
電気興業	6,900	2,765.00	19,078,500	
サンケン電気	15,600	2,494.00	38,906,400	
ナカヨ	2,900	1,468.00	4,257,200	
アイホン	8,200	1,598.00	13,103,600	
ルネサスエレクトロニクス	684,900	647.00	443,130,300	
セイコーエプソン	177,500	1,423.00	252,582,500	
ワコム	97,300	595.00	57,893,500	
アルバック	26,300	3,320.00	87,316,000	
アクセル	6,700	815.00	5,460,500	
ＥＩＺＯ	11,100	4,300.00	47,730,000	
日本信号	36,500	1,223.00	44,639,500	
京三製作所	33,700	535.00	18,029,500	
能美防災	19,200	2,073.00	39,801,600	
ホーチキ	10,800	1,441.00	15,562,800	
星和電機	7,900	670.00	5,293,000	
エレコム	15,900	5,130.00	81,567,000	
パナソニック	1,633,800	987.00	1,612,560,600	
シャープ	165,600	1,276.00	211,305,600	
アンリツ	92,100	2,403.00	221,316,300	
富士通ゼネラル	38,900	2,256.00	87,758,400	
ソニー	895,800	7,496.00	6,714,916,800	
ＴＤＫ	69,100	11,140.00	769,774,000	
帝国通信工業	6,800	1,225.00	8,330,000	
タムラ製作所	48,000	484.00	23,232,000	
アルプスアルパイン	126,900	1,583.00	200,882,700	
池上通信機	4,500	928.00	4,176,000	
鈴木	7,800	788.00	6,146,400	
日本トリム	2,100	3,250.00	6,825,000	
ローランド　ディー．ジー．	8,300	1,344.00	11,155,200	
フォスター電機	15,100	1,289.00	19,463,900	

ＳＭＫ	3,700	2,638.00	9,760,600	
ヨコオ	9,500	2,808.00	26,676,000	
ホシデン	39,700	984.00	39,064,800	
ヒロセ電機	22,200	12,430.00	275,946,000	
日本航空電子工業	32,900	1,676.00	55,140,400	
ＴＯＡ	15,500	796.00	12,338,000	
マクセルホールディングス	31,300	1,122.00	35,118,600	
古野電気	19,000	1,043.00	19,817,000	
ユニデンホールディングス	4,000	1,870.00	7,480,000	
スミダコーポレーション	11,700	870.00	10,179,000	
アイコム	8,000	3,015.00	24,120,000	
リオン	6,300	2,380.00	14,994,000	
本多通信工業	13,500	467.00	6,304,500	
横河電機	131,300	1,711.00	224,654,300	
新電元工業	5,100	2,644.00	13,484,400	
アズビル	90,300	3,010.00	271,803,000	
東亜ディーケーケー	7,800	884.00	6,895,200	
日本光電工業	59,300	3,445.00	204,288,500	
チノー	5,000	1,405.00	7,025,000	
共和電業	15,300	411.00	6,288,300	
日本電子材料	5,800	996.00	5,776,800	
堀場製作所	28,300	5,890.00	166,687,000	
アドバンテスト	106,300	6,070.00	645,241,000	
小野測器	7,100	542.00	3,848,200	
エスペック	13,000	1,828.00	23,764,000	
キーエンス	129,600	44,780.00	5,803,488,000	
日置電機	7,600	3,350.00	25,460,000	
シスメックス	102,300	8,325.00	851,647,500	
日本マイクロニクス	25,400	1,120.00	28,448,000	
メガチップス	13,600	2,067.00	28,111,200	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,500	3,455.00	29,367,500	
澤藤電機	2,100	1,613.00	3,387,300	
原田工業	7,500	855.00	6,412,500	
コーセル	19,700	947.00	18,655,900	
イリソ電子工業	12,200	3,950.00	48,190,000	
オプテックスグループ	23,900	1,413.00	33,770,700	
千代田インテグレ	6,900	1,772.00	12,226,800	
アイ・オー・データ機器	5,200	1,025.00	5,330,000	
レーザーテック	62,900	9,690.00	609,501,000	
スタンレー電気	100,700	2,823.00	284,276,100	
岩崎電気	5,800	2,171.00	12,591,800	
ウシオ電機	79,300	1,520.00	120,536,000	

岡谷電機産業	13,000	337.00	4,381,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	14,800	383.00	5,668,400	
エノモト	4,800	1,075.00	5,160,000	
日本セラミック	14,800	2,405.00	35,594,000	
遠藤照明	8,200	657.00	5,387,400	
古河電池	11,100	918.00	10,189,800	
双信電機	8,500	395.00	3,357,500	
山一電機	10,700	1,626.00	17,398,200	
図研	9,500	2,747.00	26,096,500	
日本電子	28,400	2,929.00	83,183,600	
カシオ計算機	126,600	1,982.00	250,921,200	
ファナック	135,900	20,440.00	2,777,796,000	
日本シイエムケイ	34,900	450.00	15,705,000	
エンプラス	7,500	2,605.00	19,537,500	
大真空	5,500	2,063.00	11,346,500	
ローム	63,600	7,680.00	488,448,000	
浜松ホトニクス	102,700	4,825.00	495,527,500	
三井ハイテック	16,200	1,651.00	26,746,200	
新光電気工業	48,400	1,432.00	69,308,800	
京セラ	201,300	6,156.00	1,239,202,800	
太陽誘電	63,800	3,415.00	217,877,000	
村田製作所	420,100	6,508.00	2,734,010,800	
双葉電子工業	23,200	1,012.00	23,478,400	
北陸電気工業	6,400	975.00	6,240,000	
ニチコン	49,200	812.00	39,950,400	
日本ケミコン	10,900	1,832.00	19,968,800	
ＫＯＡ	22,100	1,116.00	24,663,600	
市光工業	22,500	563.00	12,667,500	
小糸製作所	85,800	4,825.00	413,985,000	
ミツバ	27,500	522.00	14,355,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	24,800	5,490.00	136,152,000	
キヤノン電子	15,300	1,752.00	26,805,600	
キヤノン	769,800	2,347.50	1,807,105,500	
リコー	363,900	926.00	336,971,400	
象印マホービン	42,300	1,747.00	73,898,100	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,200	1,538.00	3,383,600	
東京エレクトロン	90,700	23,880.00	2,165,916,000	
トヨタ紡織	41,700	1,535.00	64,009,500	
芦森工業	3,000	938.00	2,814,000	
ユニプレス	27,800	1,076.00	29,912,800	
豊田自動織機	115,700	5,920.00	684,944,000	
モリタホールディングス	25,000	1,753.00	43,825,000	

三櫻工業	18,200	771.00	14,032,200	
デンソー	314,800	4,237.00	1,333,807,600	
東海理化電機製作所	37,700	1,677.00	63,222,900	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	51,600	642.00	33,127,200	
川崎重工業	111,300	1,925.00	214,252,500	
名村造船所	46,000	183.00	8,418,000	
日本車輌製造	5,200	2,822.00	14,674,400	
三菱ロジスネクスト	18,900	1,092.00	20,638,800	
近畿車輛	2,100	1,332.00	2,797,200	
日産自動車	1,686,400	463.90	782,320,960	
いすゞ自動車	414,300	1,070.00	443,301,000	
トヨタ自動車	1,595,500	7,094.00	11,318,477,000	
日野自動車	178,600	816.00	145,737,600	
三菱自動車工業	529,300	337.00	178,374,100	
エフテック	10,100	575.00	5,807,500	
レシップホールディングス	5,600	577.00	3,231,200	
ＧＭＢ	2,700	708.00	1,911,600	
ファルテック	2,600	736.00	1,913,600	
武蔵精密工業	31,900	1,158.00	36,940,200	
日産車体	27,900	1,028.00	28,681,200	
新明和工業	38,500	1,104.00	42,504,000	
極東開発工業	26,600	1,400.00	37,240,000	
日信工業	29,100	2,211.00	64,340,100	
トピー工業	11,800	1,465.00	17,287,000	
ティラド	5,200	1,509.00	7,846,800	
曙ブレーキ工業	78,500	206.00	16,171,000	
タチエス	23,500	987.00	23,194,500	
ＮＯＫ	76,900	1,471.00	113,119,900	
フタバ産業	39,900	531.00	21,186,900	
ＫＹＢ	16,000	2,407.00	38,512,000	
大同メタル工業	27,600	589.00	16,256,400	
プレス工業	71,100	305.00	21,685,500	
ミクニ	18,400	299.00	5,501,600	
太平洋工業	30,000	1,106.00	33,180,000	
ケーヒン	32,900	2,551.00	83,927,900	
河西工業	19,400	504.00	9,777,600	
アイシン精機	117,800	3,635.00	428,203,000	
マツダ	420,700	815.00	342,870,500	
今仙電機製作所	13,400	779.00	10,438,600	
本田技研工業	1,125,800	3,039.00	3,421,306,200	
スズキ	283,400	4,155.00	1,177,527,000	
ＳＵＢＡＲＵ	443,900	2,593.50	1,151,254,650	

安永	7,000	1,085.00	7,595,000	
ヤマハ発動機	186,500	1,773.00	330,664,500	
ショーワ	33,800	2,253.00	76,151,400	
ＴＢＫ	17,200	470.00	8,084,000	
エクセディ	19,500	1,841.00	35,899,500	
豊田合成	46,200	2,441.00	112,774,200	
愛三工業	22,500	623.00	14,017,500	
盟和産業	2,300	978.00	2,249,400	
日本プラスト	11,400	520.00	5,928,000	
ヨロズ	13,400	1,226.00	16,428,400	
エフ・シー・シー	23,400	2,066.00	48,344,400	
シマノ	53,500	19,730.00	1,055,555,000	
テイ・エス　テック	33,200	3,210.00	106,572,000	
ジャムコ	7,200	901.00	6,487,200	
テルモ	404,600	4,171.00	1,687,586,600	
クリエートメディック	4,800	999.00	4,795,200	
日機装	42,900	1,056.00	45,302,400	
日本エム・ディ・エム	8,300	1,758.00	14,591,400	
島津製作所	170,900	2,914.00	498,002,600	
ＪＭＳ	12,100	851.00	10,297,100	
長野計器	10,400	1,025.00	10,660,000	
ブイ・テクノロジー	6,700	3,950.00	26,465,000	
東京計器	9,100	973.00	8,854,300	
愛知時計電機	1,900	4,380.00	8,322,000	
インターアクション	7,700	2,274.00	17,509,800	
オーバル	13,000	237.00	3,081,000	
東京精密	25,900	3,745.00	96,995,500	
マニー	57,000	2,966.00	169,062,000	
ニコン	218,400	1,018.00	222,331,200	
トプコン	72,000	1,031.00	74,232,000	
オリンパス	791,200	1,921.00	1,519,895,200	
理研計器	12,600	2,473.00	31,159,800	
タムロン	11,500	2,026.00	23,299,000	
ＨＯＹＡ	285,500	10,050.00	2,869,275,000	
シード	6,100	794.00	4,843,400	
ノーリツ鋼機	9,700	1,515.00	14,695,500	
エー・アンド・デイ	13,100	741.00	9,707,100	
朝日インテック	161,900	3,065.00	496,223,500	
シチズン時計	167,600	407.00	68,213,200	
リズム時計工業	4,500	685.00	3,082,500	
大研医器	10,000	619.00	6,190,000	
メニコン	20,300	4,845.00	98,353,500	

シンシア	1,600	483.00	772,800	
松風	6,500	1,608.00	10,452,000	
セイコーホールディングス	20,200	1,959.00	39,571,800	
ニプロ	99,000	1,241.00	122,859,000	
中本パックス	3,600	1,523.00	5,482,800	
スノーピーク	7,600	1,084.00	8,238,400	
パラマウントベッドホールディングス	15,100	4,180.00	63,118,000	
トランザクション	7,800	1,085.00	8,463,000	
粧美堂	4,200	363.00	1,524,600	
ニホンフラッシュ	13,400	1,420.00	19,028,000	
前田工繊	15,800	2,468.00	38,994,400	
永大産業	18,700	329.00	6,152,300	
アートネイチャー	15,300	620.00	9,486,000	
バンダイナムコホールディングス	147,800	6,205.00	917,099,000	
アイフィスジャパン	3,600	733.00	2,638,800	
共立印刷	23,800	145.00	3,451,000	
ＳＨＯＥＩ	12,500	2,517.00	31,462,500	
フランスベッドホールディングス	20,200	874.00	17,654,800	
パイロットコーポレーション	23,300	3,670.00	85,511,000	
萩原工業	7,900	1,448.00	11,439,200	
トッパン・フォームズ	30,600	1,124.00	34,394,400	
フジシールインターナショナル	32,100	2,165.00	69,496,500	
タカラトミー	64,100	937.00	60,061,700	
廣済堂	10,000	847.00	8,470,000	
エステールホールディングス	3,800	620.00	2,356,000	
アーク	54,600	126.00	6,879,600	
タカノ	5,600	760.00	4,256,000	
プロネクサス	12,300	1,196.00	14,710,800	
ホクシン	8,800	130.00	1,144,000	
ウッドワン	4,800	1,170.00	5,616,000	
大建工業	9,600	1,756.00	16,857,600	
凸版印刷	201,800	1,941.00	391,693,800	
大日本印刷	187,100	2,637.00	493,382,700	
共同印刷	4,400	2,960.00	13,024,000	
ＮＩＳＳＨＡ	29,400	1,075.00	31,605,000	
光村印刷	1,200	1,499.00	1,798,800	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	6,900	1,916.00	13,220,400	
アシックス	118,000	1,380.00	162,840,000	
ツツミ	4,500	1,848.00	8,316,000	
小松ウオール工業	4,400	1,889.00	8,311,600	
ヤマハ	85,000	5,650.00	480,250,000	
河合楽器製作所	4,400	2,823.00	12,421,200	

クリナップ	13,300	556.00	7,394,800	
ピジョン	86,400	4,120.00	355,968,000	
オリバー	3,000	2,965.00	8,895,000	
兼松サステック	900	1,434.00	1,290,600	
キングジム	11,900	954.00	11,352,600	
リンテック	34,000	2,624.00	89,216,000	
イトーキ	30,400	388.00	11,795,200	
任天堂	87,700	45,340.00	3,976,318,000	
三菱鉛筆	23,500	1,525.00	35,837,500	
タカラスタンダード	29,500	1,557.00	45,931,500	
コクヨ	68,600	1,333.00	91,443,800	
ナカバヤシ	14,100	603.00	8,502,300	
グローブライド	6,400	2,336.00	14,950,400	
オカムラ	49,900	843.00	42,065,700	
美津濃	13,000	2,167.00	28,171,000	
東京電力ホールディングス	1,141,500	373.00	425,779,500	
中部電力	437,500	1,411.50	617,531,250	
関西電力	541,800	1,126.50	610,337,700	
中国電力	206,300	1,464.00	302,023,200	
北陸電力	130,700	728.00	95,149,600	
東北電力	357,200	1,094.00	390,776,800	
四国電力	128,700	839.00	107,979,300	
九州電力	294,700	925.00	272,597,500	
北海道電力	133,800	453.00	60,611,400	
沖縄電力	27,790	1,884.00	52,356,360	
電源開発	113,800	2,109.00	240,004,200	
エフオン	7,700	610.00	4,697,000	
イーレックス	20,400	1,482.00	30,232,800	
レノバ	23,900	975.00	23,302,500	
東京瓦斯	275,000	2,562.50	704,687,500	
大阪瓦斯	277,500	2,121.00	588,577,500	
東邦瓦斯	70,300	5,260.00	369,778,000	
北海道瓦斯	7,700	1,604.00	12,350,800	
広島ガス	29,400	358.00	10,525,200	
西部瓦斯	16,100	2,590.00	41,699,000	
静岡ガス	40,600	997.00	40,478,200	
メタウォーター	6,900	4,760.00	32,844,000	
ＳＢＳホールディングス	12,300	2,380.00	29,274,000	
東武鉄道	149,000	3,865.00	575,885,000	
相鉄ホールディングス	45,700	3,005.00	137,328,500	
東急	360,600	1,721.00	620,592,600	
京浜急行電鉄	183,600	1,789.00	328,460,400	

小田急電鉄	212,700	2,677.00	569,397,900	
京王電鉄	74,200	6,350.00	471,170,000	
京成電鉄	99,500	3,690.00	367,155,000	
富士急行	19,500	3,425.00	66,787,500	
新京成電鉄	3,700	2,200.00	8,140,000	
東日本旅客鉄道	251,700	8,618.00	2,169,150,600	
西日本旅客鉄道	127,400	6,807.00	867,211,800	
東海旅客鉄道	118,900	18,715.00	2,225,213,500	
西武ホールディングス	191,900	1,393.00	267,316,700	
鴻池運輸	22,800	1,234.00	28,135,200	
西日本鉄道	39,600	2,940.00	116,424,000	
ハマキョウレックス	11,000	3,250.00	35,750,000	
サカイ引越センター	7,500	6,020.00	45,150,000	
近鉄グループホールディングス	135,400	5,240.00	709,496,000	
阪急阪神ホールディングス	180,600	3,935.00	710,661,000	
南海電気鉄道	64,200	2,644.00	169,744,800	
京阪ホールディングス	60,300	5,050.00	304,515,000	
神戸電鉄	3,200	3,715.00	11,888,000	
名古屋鉄道	111,300	3,235.00	360,055,500	
山陽電気鉄道	9,700	2,248.00	21,805,600	
日本通運	46,900	5,960.00	279,524,000	
ヤマトホールディングス	237,400	2,463.00	584,716,200	
山九	37,600	4,410.00	165,816,000	
丸運	7,700	249.00	1,917,300	
丸全昭和運輸	11,000	2,969.00	32,659,000	
センコーグループホールディングス	74,600	821.00	61,246,600	
トナミホールディングス	3,300	6,470.00	21,351,000	
ニッコンホールディングス	48,500	2,316.00	112,326,000	
日本石油輸送	1,500	3,080.00	4,620,000	
福山通運	17,300	3,805.00	65,826,500	
セイノーホールディングス	101,400	1,492.00	151,288,800	
エスライン	4,100	996.00	4,083,600	
神奈川中央交通	3,400	4,220.00	14,348,000	
日立物流	24,800	2,929.00	72,639,200	
丸和運輸機関	14,300	2,874.00	41,098,200	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	13,700	1,540.00	21,098,000	
九州旅客鉄道	118,700	3,105.00	368,563,500	
ＳＧホールディングス	142,200	3,460.00	492,012,000	
日本郵船	113,900	1,627.00	185,315,300	
商船三井	86,200	2,085.00	179,727,000	
川崎汽船	41,700	1,161.00	48,413,700	
ＮＳユナイテッド海運	8,100	1,598.00	12,943,800	

飯野海運	66,900	354.00	23,682,600	
共栄タンカー	3,600	856.00	3,081,600	
乾汽船	7,800	1,032.00	8,049,600	
日本航空	239,500	2,403.00	575,518,500	
ＡＮＡホールディングス	247,500	2,832.00	700,920,000	
パスコ	2,600	1,587.00	4,126,200	
トランコム	3,800	7,190.00	27,322,000	
日新	11,700	1,671.00	19,550,700	
三菱倉庫	43,000	2,944.00	126,592,000	
三井倉庫ホールディングス	15,500	1,593.00	24,691,500	
住友倉庫	48,700	1,389.00	67,644,300	
澁澤倉庫	7,400	2,125.00	15,725,000	
東陽倉庫	24,400	335.00	8,174,000	
日本トランスシティ	29,800	541.00	16,121,800	
ケイヒン	2,600	1,315.00	3,419,000	
中央倉庫	8,300	1,030.00	8,549,000	
川西倉庫	2,500	1,028.00	2,570,000	
安田倉庫	11,100	907.00	10,067,700	
ファイズホールディングス	2,900	1,165.00	3,378,500	
東洋埠頭	4,100	1,393.00	5,711,300	
宇徳	11,600	522.00	6,055,200	
上組	75,600	2,196.00	166,017,600	
サンリツ	3,200	604.00	1,932,800	
キムラユニティー	3,600	1,030.00	3,708,000	
キユーソー流通システム	3,400	1,713.00	5,824,200	
近鉄エクスプレス	28,800	1,822.00	52,473,600	
東海運	7,700	271.00	2,086,700	
エーアイテイー	9,600	812.00	7,795,200	
内外トランスライン	4,700	1,047.00	4,920,900	
日本コンセプト	4,300	1,430.00	6,149,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	40,000	1,993.00	79,720,000	
クロスキャット	4,000	1,184.00	4,736,000	
システナ	50,300	1,576.00	79,272,800	
デジタルアーツ	6,900	8,660.00	59,754,000	
日鉄ソリューションズ	21,100	2,989.00	63,067,900	
キューブシステム	7,900	795.00	6,280,500	
エイジア	2,800	1,388.00	3,886,400	
コア	6,200	1,246.00	7,725,200	
ラクーンホールディングス	6,700	874.00	5,855,800	
ソリトンシステムズ	6,400	1,606.00	10,278,400	
ソフトクリエイトホールディングス	6,300	2,215.00	13,954,500	
ＴＩＳ	140,500	2,259.00	317,389,500	

ネオス	5,600	770.00	4,312,000	
電算システム	5,500	3,515.00	19,332,500	
グリー	86,800	461.00	40,014,800	
コーエーテクモホールディングス	28,800	3,230.00	93,024,000	
三菱総合研究所	6,100	4,090.00	24,949,000	
電算	1,700	2,218.00	3,770,600	
ＡＧＳ	8,400	814.00	6,837,600	
ファインデックス	12,200	993.00	12,114,600	
ブレインパッド	3,700	5,080.00	18,796,000	
ＫＬａｂ	27,200	774.00	21,052,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,300	945.00	16,348,500	
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	2,588.00	5,693,600	
ネクソン	391,500	2,319.00	907,888,500	
アイスタイル	40,400	328.00	13,251,200	
エムアップホールディングス	4,200	2,518.00	10,575,600	
エイチーム	10,100	811.00	8,191,100	
エニグモ	13,600	1,038.00	14,116,800	
テクノスジャパン	11,400	607.00	6,919,800	
コロプラ	46,400	1,047.00	48,580,800	
ブロードリーフ	70,200	559.00	39,241,800	
クロス・マーケティンググループ	7,200	365.00	2,628,000	
デジタルハーツホールディングス	7,800	911.00	7,105,800	
システム情報	10,800	1,343.00	14,504,400	
メディアドゥ	4,500	4,490.00	20,205,000	
じげん	35,600	400.00	14,240,000	
エンカレッジ・テクノロジ	3,500	859.00	3,006,500	
サイバーリンクス	2,400	1,728.00	4,147,200	
フィックスターズ	15,200	1,406.00	21,371,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,100	1,196.00	8,491,600	
オプティム	7,500	3,005.00	22,537,500	
セレス	4,900	1,301.00	6,374,900	
ＳＨＩＦＴ	5,700	10,580.00	60,306,000	
ティーガイア	12,600	2,165.00	27,279,000	
セック	2,100	3,435.00	7,213,500	
日本アジアグループ	14,800	332.00	4,913,600	
テクマトリックス	10,000	3,680.00	36,800,000	
プロシップ	4,300	1,360.00	5,848,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,000	1,869.00	63,546,000	
GMOペイメントゲートウェイ	29,700	11,250.00	334,125,000	
ザッパラス	7,000	401.00	2,807,000	
システムリサーチ	3,900	2,050.00	7,995,000	
インターネットイニシアティブ	20,800	3,905.00	81,224,000	

さくらインターネット	15,600	658.00	10,264,800	
ヴィンクス	4,200	1,221.00	5,128,200	
GMOクラウド	2,600	6,890.00	17,914,000	
ＳＲＡホールディングス	7,600	2,491.00	18,931,600	
システムインテグレータ	4,800	912.00	4,377,600	
朝日ネット	10,200	1,392.00	14,198,400	
ｅＢＡＳＥ	17,000	1,310.00	22,270,000	
アバント	13,700	1,183.00	16,207,100	
アドソル日進	5,100	2,558.00	13,045,800	
フリービット	7,700	879.00	6,768,300	
コムチュア	15,900	2,814.00	44,742,600	
サイバーコム	2,700	1,894.00	5,113,800	
アステリア	9,200	551.00	5,069,200	
アイル	8,000	1,806.00	14,448,000	
マークラインズ	7,200	2,101.00	15,127,200	
メディカル・データ・ビジョン	11,000	1,122.00	12,342,000	
ショーケース	3,900	658.00	2,566,200	
モバイルファクトリー	3,400	1,215.00	4,131,000	
テラスカイ	5,200	3,030.00	15,756,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,700	1,527.00	8,703,900	
ＰＣＩホールディングス	5,600	1,352.00	7,571,200	
パイプドＨＤ	2,000	1,610.00	3,220,000	
アイビーシー	2,600	1,041.00	2,706,600	
ネオジャパン	2,900	1,527.00	4,428,300	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,300	2,692.00	3,499,600	
ランドコンピュータ	2,400	1,115.00	2,676,000	
ダブルスタンダード	1,900	4,575.00	8,692,500	
オープンドア	7,200	1,327.00	9,554,400	
マイネット	4,500	1,109.00	4,990,500	
アカツキ	5,000	4,250.00	21,250,000	
ベネフィットジャパン	1,300	1,650.00	2,145,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,300	1,878.00	6,197,400	
ＬＩＮＥ	32,200	5,360.00	172,592,000	
カナミックネットワーク	13,200	924.00	12,196,800	
ノムラシステムコーポレーション	3,700	534.00	1,975,800	
チェンジ	5,000	5,770.00	28,850,000	
シンクロ・フード	6,900	371.00	2,559,900	
オークネット	8,900	1,096.00	9,754,400	
セグエグループ	3,500	897.00	3,139,500	
エイトレッド	2,500	1,985.00	4,962,500	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	14,900	495.00	7,375,500	
マクロミル	29,100	829.00	24,123,900	

ビーグリー	3,000	1,639.00	4,917,000	
オロ	3,800	2,845.00	10,811,000	
ユーザーローカル	1,500	3,550.00	5,325,000	
テモナ	3,400	856.00	2,910,400	
ニーズウェル	3,100	726.00	2,250,600	
サインポスト	3,100	1,919.00	5,948,900	
ソルクシーズ	6,400	754.00	4,825,600	
フェイス	5,400	700.00	3,780,000	
プロトコーポレーション	12,900	1,093.00	14,099,700	
ハイマックス	1,800	1,976.00	3,556,800	
野村総合研究所	199,000	2,784.00	554,016,000	
サイバネットシステム	10,500	703.00	7,381,500	
ＣＥホールディングス	8,100	502.00	4,066,200	
日本システム技術	2,500	1,495.00	3,737,500	
インテージホールディングス	17,900	886.00	15,859,400	
東邦システムサイエンス	4,100	925.00	3,792,500	
ソースネクスト	67,600	320.00	21,632,000	
インフォコム	15,500	3,120.00	48,360,000	
ＨＥＲＯＺ	2,100	4,250.00	8,925,000	
ラクスル	11,400	2,668.00	30,415,200	
ＦＩＧ	16,400	294.00	4,821,600	
システムサポート	3,300	2,349.00	7,751,700	
イーソル	6,900	1,451.00	10,011,900	
アルテリア・ネットワークス	15,700	2,005.00	31,478,500	
東海ソフト	1,200	1,375.00	1,650,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,083.00	2,924,100	
トビラシステムズ	1,800	2,157.00	3,882,600	
フォーカスシステムズ	9,100	888.00	8,080,800	
クレスコ	8,700	1,552.00	13,502,400	
フジ・メディア・ホールディングス	135,500	1,148.00	155,554,000	
オービック	48,700	18,220.00	887,314,000	
ジャストシステム	22,900	7,520.00	172,208,000	
ＴＤＣソフト	12,600	998.00	12,574,800	
Ｚホールディングス	1,927,600	453.00	873,202,800	
トレンドマイクロ	62,400	6,210.00	387,504,000	
ＩＤホールディングス	5,600	1,499.00	8,394,400	
日本オラクル	28,500	12,350.00	351,975,000	
アルファシステムズ	4,500	4,080.00	18,360,000	
フューチャー	17,100	1,811.00	30,968,100	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,400	1,351.00	12,699,400	
ＳＢテクノロジー	5,200	2,815.00	14,638,000	
トーセ	4,200	851.00	3,574,200	

オービックビジネスコンサルタント	14,400	6,070.00	87,408,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	64,000	3,760.00	240,640,000	
アイティフォー	17,500	727.00	12,722,500	
東計電算	2,200	4,105.00	9,031,000	
エックスネット	2,600	999.00	2,597,400	
大塚商会	76,000	5,450.00	414,200,000	
サイボウズ	16,500	3,170.00	52,305,000	
ソフトブレーン	8,900	525.00	4,672,500	
電通国際情報サービス	8,800	5,000.00	44,000,000	
ＡＣＣＥＳＳ	13,400	1,154.00	15,463,600	
デジタルガレージ	25,300	3,850.00	97,405,000	
ＥＭシステムズ	20,100	899.00	18,069,900	
ウェザーニューズ	4,800	3,775.00	18,120,000	
ＣＩＪ	9,900	928.00	9,187,200	
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,864.00	4,868,800	
日本エンタープライズ	15,500	281.00	4,355,500	
ＷＯＷＯＷ	6,900	2,543.00	17,546,700	
スカラ	9,800	779.00	7,634,200	
インテリジェント　ウェイブ	8,600	816.00	7,017,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	12,700	428.00	5,435,600	
ネットワンシステムズ	53,600	3,400.00	182,240,000	
システムソフト	33,500	101.00	3,383,500	
アルゴグラフィックス	12,000	3,680.00	44,160,000	
マーベラス	21,900	772.00	16,906,800	
エイベックス	24,500	937.00	22,956,500	
日本ユニシス	43,900	3,385.00	148,601,500	
兼松エレクトロニクス	7,700	3,810.00	29,337,000	
東京放送ホールディングス	85,500	1,800.00	153,900,000	
日本テレビホールディングス	117,400	1,265.00	148,511,000	
朝日放送グループホールディングス	14,300	812.00	11,611,600	
テレビ朝日ホールディングス	38,800	1,665.00	64,602,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	93,100	459.00	42,732,900	
テレビ東京ホールディングス	11,600	2,504.00	29,046,400	
日本ＢＳ放送	5,000	1,140.00	5,700,000	
ビジョン	13,500	875.00	11,812,500	
スマートバリュー	3,900	1,152.00	4,492,800	
ワイヤレスゲート	7,200	720.00	5,184,000	
コネクシオ	8,200	1,470.00	12,054,000	
クロップス	3,000	745.00	2,235,000	
日本電信電話	1,875,700	2,512.00	4,711,758,400	
ＫＤＤＩ	1,045,800	3,191.00	3,337,147,800	
ソフトバンク	1,275,400	1,374.00	1,752,399,600	

光通信	14,500	25,060.00	363,370,000	
ＮＴＴドコモ	1,003,500	2,890.00	2,900,115,000	
エムティーアイ	14,100	619.00	8,727,900	
GMOインターネット	55,400	2,837.00	157,169,800	
ファイバーゲート	4,700	1,505.00	7,073,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,800	566.00	2,716,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	38,000	1,777.00	67,526,000	
学研ホールディングス	19,000	1,557.00	29,583,000	
ゼンリン	28,200	1,360.00	38,352,000	
昭文社ホールディングス	7,300	424.00	3,095,200	
インプレスホールディングス	11,600	154.00	1,786,400	
アイネット	7,400	1,513.00	11,196,200	
松竹	9,300	14,890.00	138,477,000	
東宝	82,900	4,060.00	336,574,000	
東映	5,300	14,600.00	77,380,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	373,800	1,322.00	494,163,600	
ピー・シー・エー	2,500	4,510.00	11,275,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,500	2,691.00	6,727,500	
ＤＴＳ	31,500	2,383.00	75,064,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	59,900	5,460.00	327,054,000	
シーイーシー	15,200	1,937.00	29,442,400	
カプコン	66,200	3,930.00	260,166,000	
アイ・エス・ビー	2,900	2,158.00	6,258,200	
ジャステック	9,200	1,216.00	11,187,200	
ＳＣＳＫ	32,400	5,510.00	178,524,000	
日本システムウエア	4,800	2,348.00	11,270,400	
アイネス	14,000	1,357.00	18,998,000	
ＴＫＣ	11,900	5,730.00	68,187,000	
富士ソフト	18,000	4,410.00	79,380,000	
ＮＳＤ	45,300	1,735.00	78,595,500	
コナミホールディングス	51,100	3,905.00	199,545,500	
福井コンピュータホールディングス	5,600	2,885.00	16,156,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,700	1,639.00	15,898,300	
ミロク情報サービス	12,500	2,523.00	31,537,500	
ソフトバンクグループ	1,113,400	5,355.00	5,962,257,000	
ホウスイ	1,100	924.00	1,016,400	
高千穂交易	5,400	982.00	5,302,800	
カワニシホールディングス	1,700	1,487.00	2,527,900	
伊藤忠食品	3,500	5,210.00	18,235,000	
エレマテック	13,200	927.00	12,236,400	
ＪＡＬＵＸ	4,000	1,895.00	7,580,000	
あらた	11,200	4,590.00	51,408,000	

トーメンデバイス	2,100	3,540.00	7,434,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,100	2,870.00	14,637,000	
フィールズ	10,800	370.00	3,996,000	
双日	777,800	261.00	203,005,800	
アルフレッサ　ホールディングス	156,500	2,260.00	353,690,000	
横浜冷凍	36,900	914.00	33,726,600	
ラサ商事	7,500	915.00	6,862,500	
アルコニックス	15,000	1,273.00	19,095,000	
神戸物産	48,600	6,220.00	302,292,000	
ハイパー	2,200	614.00	1,350,800	
あい　ホールディングス	20,100	1,569.00	31,536,900	
ディーブイエックス	5,000	878.00	4,390,000	
ダイワボウホールディングス	12,000	7,890.00	94,680,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	33,600	1,674.00	56,246,400	
ラクト・ジャパン	5,300	3,900.00	20,670,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,500	1,074.00	28,461,000	
八洲電機	10,900	903.00	9,842,700	
メディアスホールディングス	8,000	983.00	7,864,000	
レスターホールディングス	14,700	2,267.00	33,324,900	
ジューテックホールディングス	3,200	994.00	3,180,800	
大光	6,000	688.00	4,128,000	
ＯＣＨＩホールディングス	4,100	1,482.00	6,076,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	74,400	990.00	73,656,000	
黒谷	3,900	491.00	1,914,900	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,500	733.00	1,832,500	
三洋貿易	14,200	1,083.00	15,378,600	
ビューティガレージ	2,300	1,744.00	4,011,200	
ウイン・パートナーズ	10,200	1,006.00	10,261,200	
ミタチ産業	4,300	610.00	2,623,000	
シップヘルスケアホールディングス	22,600	4,510.00	101,926,000	
明治電機工業	4,400	1,438.00	6,327,200	
デリカフーズホールディングス	5,000	638.00	3,190,000	
スターティアホールディングス	3,200	728.00	2,329,600	
コメダホールディングス	30,700	1,924.00	59,066,800	
ピーバンドットコム	1,400	1,010.00	1,414,000	
アセンテック	1,500	3,475.00	5,212,500	
富士興産	4,300	509.00	2,188,700	
協栄産業	1,600	1,256.00	2,009,600	
小野建	12,600	1,269.00	15,989,400	
南陽	3,100	1,494.00	4,631,400	
佐鳥電機	9,600	883.00	8,476,800	
エコートレーディング	3,300	528.00	1,742,400	

伯東	8,600	1,072.00	9,219,200	
コンドーテック	10,900	1,148.00	12,513,200	
中山福	8,100	533.00	4,317,300	
ナガイレーベン	18,700	2,644.00	49,442,800	
三菱食品	15,500	2,891.00	44,810,500	
松田産業	10,300	1,391.00	14,327,300	
第一興商	21,000	3,970.00	83,370,000	
メディパルホールディングス	152,000	2,178.00	331,056,000	
ＳＰＫ	6,100	1,445.00	8,814,500	
萩原電気ホールディングス	5,200	2,251.00	11,705,200	
アズワン	9,200	11,580.00	106,536,000	
スズデン	4,900	1,187.00	5,816,300	
尾家産業	4,100	1,510.00	6,191,000	
シモジマ	8,600	1,287.00	11,068,200	
ドウシシャ	13,300	1,567.00	20,841,100	
小津産業	3,100	1,783.00	5,527,300	
高速	8,400	1,480.00	12,432,000	
たけびし	4,900	1,495.00	7,325,500	
リックス	3,200	1,550.00	4,960,000	
丸文	12,500	510.00	6,375,000	
ハピネット	11,800	1,164.00	13,735,200	
橋本総業ホールディングス	2,900	1,941.00	5,628,900	
日本ライフライン	41,700	1,465.00	61,090,500	
タカショー	9,200	475.00	4,370,000	
マルカ	5,000	1,855.00	9,275,000	
ＩＤＯＭ	38,000	519.00	19,722,000	
進和	8,300	2,045.00	16,973,500	
エスケイジャパン	3,100	334.00	1,035,400	
ダイトロン	6,000	1,810.00	10,860,000	
シークス	17,900	1,147.00	20,531,300	
田中商事	4,400	706.00	3,106,400	
オーハシテクニカ	7,900	1,659.00	13,106,100	
白銅	5,100	1,390.00	7,089,000	
伊藤忠商事	985,000	2,353.00	2,317,705,000	
丸紅	1,466,000	549.20	805,127,200	
高島	2,200	1,800.00	3,960,000	
長瀬産業	79,200	1,375.00	108,900,000	
蝶理	9,000	1,998.00	17,982,000	
豊田通商	157,200	3,015.00	473,958,000	
三共生興	21,400	471.00	10,079,400	
兼松	52,500	1,343.00	70,507,500	
ツカモトコーポレーション	2,500	1,136.00	2,840,000	

三井物産	1,219,400	1,748.00	2,131,511,200	
日本紙パルプ商事	8,000	4,110.00	32,880,000	
カメイ	18,400	1,065.00	19,596,000	
東都水産	1,800	3,400.00	6,120,000	
ＯＵＧホールディングス	2,200	2,677.00	5,889,400	
スターゼン	5,200	4,525.00	23,530,000	
山善	55,000	928.00	51,040,000	
椿本興業	2,600	3,730.00	9,698,000	
住友商事	888,600	1,333.00	1,184,503,800	
内田洋行	5,600	6,950.00	38,920,000	
三菱商事	988,300	2,491.50	2,462,349,450	
第一実業	6,900	3,865.00	26,668,500	
キヤノンマーケティングジャパン	34,900	2,330.00	81,317,000	
西華産業	8,000	1,298.00	10,384,000	
佐藤商事	11,600	943.00	10,938,800	
菱洋エレクトロ	14,300	2,710.00	38,753,000	
東京産業	12,800	566.00	7,244,800	
ユアサ商事	13,400	3,065.00	41,071,000	
神鋼商事	3,600	1,999.00	7,196,400	
トルク	8,500	340.00	2,890,000	
阪和興業	26,300	2,006.00	52,757,800	
正栄食品工業	9,100	4,440.00	40,404,000	
カナデン	11,400	1,300.00	14,820,000	
菱電商事	10,200	1,537.00	15,677,400	
フルサト工業	7,800	1,511.00	11,785,800	
岩谷産業	31,300	3,765.00	117,844,500	
ナイス	6,000	830.00	4,980,000	
昭光通商	4,500	634.00	2,853,000	
ニチモウ	2,200	1,817.00	3,997,400	
極東貿易	4,100	1,605.00	6,580,500	
イワキ	18,500	478.00	8,843,000	
三愛石油	34,700	1,099.00	38,135,300	
稲畑産業	31,000	1,326.00	41,106,000	
ＧＳＩクレオス	3,500	1,233.00	4,315,500	
明和産業	13,000	489.00	6,357,000	
クワザワ	5,100	523.00	2,667,300	
ヤマエ久野	10,300	1,259.00	12,967,700	
ワキタ	30,000	998.00	29,940,000	
東邦ホールディングス	45,200	2,091.00	94,513,200	
サンゲツ	38,400	1,578.00	60,595,200	
ミツウロコグループホールディングス	20,800	1,153.00	23,982,400	
シナネンホールディングス	5,800	2,679.00	15,538,200	

伊藤忠エネクス	31,200	868.00	27,081,600	
サンリオ	39,600	1,932.00	76,507,200	
サンワテクノス	10,000	876.00	8,760,000	
リョーサン	15,500	2,416.00	37,448,000	
新光商事	22,100	899.00	19,867,900	
トーホー	6,400	1,896.00	12,134,400	
三信電気	7,600	1,769.00	13,444,400	
東陽テクニカ	15,100	1,075.00	16,232,500	
モスフードサービス	18,500	2,939.00	54,371,500	
加賀電子	14,000	2,181.00	30,534,000	
ソーダニッカ	14,600	538.00	7,854,800	
立花エレテック	10,400	1,740.00	18,096,000	
フォーバル	6,200	1,116.00	6,919,200	
ＰＡＬＴＡＣ	22,600	5,000.00	113,000,000	
三谷産業	18,600	374.00	6,956,400	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,600	2,135.00	5,551,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,908.00	2,480,400	
国際紙パルプ商事	33,400	304.00	10,153,600	
ヤマタネ	7,100	1,252.00	8,889,200	
丸紅建材リース	1,400	1,593.00	2,230,200	
日鉄物産	10,000	3,740.00	37,400,000	
泉州電業	4,300	2,826.00	12,151,800	
トラスコ中山	29,300	2,655.00	77,791,500	
オートバックスセブン	52,300	1,457.00	76,201,100	
モリト	10,300	729.00	7,508,700	
加藤産業	20,300	3,795.00	77,038,500	
北恵	3,600	954.00	3,434,400	
イノテック	7,300	1,111.00	8,110,300	
イエローハット	26,600	1,510.00	40,166,000	
ＪＫホールディングス	12,800	865.00	11,072,000	
日伝	12,800	2,293.00	29,350,400	
北沢産業	10,700	290.00	3,103,000	
杉本商事	7,600	1,904.00	14,470,400	
因幡電機産業	40,100	2,502.00	100,330,200	
東テク	4,700	2,266.00	10,650,200	
ミスミグループ本社	176,500	2,943.00	519,439,500	
アルテック	11,300	240.00	2,712,000	
タキヒヨー	4,300	1,800.00	7,740,000	
蔵王産業	2,700	1,459.00	3,939,300	
スズケン	59,600	4,020.00	239,592,000	
ジェコス	9,700	989.00	9,593,300	
グローセル	14,100	455.00	6,415,500	

ローソン	35,700	5,940.00	212,058,000	
サンエー	11,800	4,300.00	50,740,000	
カワチ薬品	11,000	2,669.00	29,359,000	
エービーシー・マート	22,000	6,620.00	145,640,000	
ハードオフコーポレーション	5,900	760.00	4,484,000	
アスクル	14,800	3,770.00	55,796,000	
ゲオホールディングス	25,500	1,375.00	35,062,500	
アダストリア	19,600	1,803.00	35,338,800	
ジーフット	8,500	503.00	4,275,500	
くら寿司	7,400	4,990.00	36,926,000	
キャンドゥ	6,800	1,927.00	13,103,600	
パルグループホールディングス	14,500	1,414.00	20,503,000	
エディオン	64,900	1,011.00	65,613,900	
サーラコーポレーション	29,000	598.00	17,342,000	
ワッツ	6,500	896.00	5,824,000	
ハローズ	5,400	3,340.00	18,036,000	
フジオフードシステム	12,000	1,601.00	19,212,000	
あみやき亭	3,100	3,230.00	10,013,000	
ひらまつ	25,900	198.00	5,128,200	
大黒天物産	3,400	4,505.00	15,317,000	
ハニーズホールディングス	12,600	1,196.00	15,069,600	
ファーマライズホールディングス	3,700	675.00	2,497,500	
アルペン	10,900	1,851.00	20,175,900	
ハブ	4,300	740.00	3,182,000	
クオールホールディングス	20,900	1,242.00	25,957,800	
ジンズホールディングス	7,500	6,850.00	51,375,000	
ビックカメラ	83,700	1,167.00	97,677,900	
ＤＣＭホールディングス	78,200	1,114.00	87,114,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	100,200	4,015.00	402,303,000	
東京一番フーズ	4,000	512.00	2,048,000	
ＤＤホールディングス	5,600	1,024.00	5,734,400	
きちりホールディングス	4,100	656.00	2,689,600	
アークランドサービスホールディングス	10,400	1,960.00	20,384,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	168,400	956.00	160,990,400	
ドトール・日レスホールディングス	20,400	1,832.00	37,372,800	
マツモトキヨシホールディングス	58,300	3,845.00	224,163,500	
ブロンコビリー	7,500	2,618.00	19,635,000	
ＺＯＺＯ	96,900	2,344.00	227,133,600	
トレジャー・ファクトリー	4,400	780.00	3,432,000	
物語コーポレーション	3,800	8,750.00	33,250,000	
ココカラファイン	14,700	5,800.00	85,260,000	
三越伊勢丹ホールディングス	246,500	739.00	182,163,500	

Ｈａｍｅｅ	5,200	1,605.00	8,346,000	
ウエルシアホールディングス	41,900	8,800.00	368,720,000	
クリエイトＳＤホールディングス	23,800	3,515.00	83,657,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	16,400	396.00	6,494,400	
ティーライフ	2,300	1,101.00	2,532,300	
チムニー	4,400	1,833.00	8,065,200	
シュッピン	9,800	854.00	8,369,200	
オイシックス・ラ・大地	14,000	2,154.00	30,156,000	
ネクステージ	20,400	902.00	18,400,800	
ジョイフル本田	41,400	1,384.00	57,297,600	
鳥貴族	4,300	1,795.00	7,718,500	
キリン堂ホールディングス	5,600	2,245.00	12,572,000	
ホットランド	9,600	1,271.00	12,201,600	
すかいらーくホールディングス	157,900	1,808.00	285,483,200	
ＳＦＰホールディングス	8,100	1,707.00	13,826,700	
綿半ホールディングス	5,400	1,875.00	10,125,000	
ヨシックス	2,400	2,312.00	5,548,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,100	1,139.00	46,812,900	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,900	591.00	4,077,900	
ＢＥＥＮＯＳ	6,700	1,076.00	7,209,200	
あさひ	10,600	1,459.00	15,465,400	
日本調剤	8,700	1,715.00	14,920,500	
コスモス薬品	12,400	16,120.00	199,888,000	
トーエル	7,100	736.00	5,225,600	
オンリー	2,800	621.00	1,738,800	
セブン&アイ・ホールディングス	551,000	3,889.00	2,142,839,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	76,000	824.00	62,624,000	
ツルハホールディングス	30,600	15,930.00	487,458,000	
サンマルクホールディングス	11,200	1,861.00	20,843,200	
フェリシモ	3,300	1,080.00	3,564,000	
トリドールホールディングス	35,000	1,279.00	44,765,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13,300	397.00	5,280,100	
ウイルプラスホールディングス	2,100	757.00	1,589,700	
ＪＭホールディングス	10,700	2,698.00	28,868,600	
サツドラホールディングス	2,200	2,027.00	4,459,400	
アレンザホールディングス	7,300	935.00	6,825,500	
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,745.00	5,235,000	
バロックジャパンリミテッド	10,100	691.00	6,979,100	
クスリのアオキホールディングス	12,600	8,800.00	110,880,000	
力の源ホールディングス	6,700	764.00	5,118,800	
スシローグローバルホールディングス	77,400	2,390.00	184,986,000	

ＬＩＸＩＬビバ	14,000	2,593.00	36,302,000	
メディカルシステムネットワーク	14,100	506.00	7,134,600	
はるやまホールディングス	6,900	778.00	5,368,200	
ノジマ	25,100	2,478.00	62,197,800	
カッパ・クリエイト	19,700	1,505.00	29,648,500	
ライトオン	10,500	587.00	6,163,500	
良品計画	187,100	1,587.00	296,927,700	
三城ホールディングス	15,700	298.00	4,678,600	
アドヴァン	21,700	1,340.00	29,078,000	
アルビス	5,400	2,157.00	11,647,800	
コナカ	17,300	329.00	5,691,700	
ハウス　オブ　ローゼ	1,900	1,613.00	3,064,700	
Ｇ－７ホールディングス	8,400	2,468.00	20,731,200	
イオン北海道	18,800	800.00	15,040,000	
コジマ	24,700	513.00	12,671,100	
ヒマラヤ	5,200	822.00	4,274,400	
コーナン商事	20,100	3,130.00	62,913,000	
エコス	5,300	1,901.00	10,075,300	
ワタミ	16,900	1,048.00	17,711,200	
マルシェ	4,100	649.00	2,660,900	
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	309,600	2,208.00	683,596,800	
西松屋チェーン	31,100	948.00	29,482,800	
ゼンショーホールディングス	67,600	2,280.00	154,128,000	
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,616.00	14,705,600	
ハークスレイ	3,200	1,018.00	3,257,600	
サイゼリヤ	21,000	2,264.00	47,544,000	
ＶＴホールディングス	58,900	348.00	20,497,200	
魚力	4,000	1,590.00	6,360,000	
フジ・コーポレーション	3,800	2,065.00	7,847,000	
ユナイテッドアローズ	14,900	2,108.00	31,409,200	
ハイデイ日高	20,400	1,902.00	38,800,800	
京都きもの友禅	9,900	235.00	2,326,500	
コロワイド	46,800	1,697.00	79,419,600	
ピーシーデポコーポレーション	19,100	701.00	13,389,100	
壱番屋	10,000	5,410.00	54,100,000	
ＰＬＡＮＴ	4,000	598.00	2,392,000	
スギホールディングス	28,100	7,000.00	196,700,000	
薬王堂ホールディングス	6,200	2,558.00	15,859,600	
スクロール	22,200	381.00	8,458,200	
ヨンドシーホールディングス	14,400	1,955.00	28,152,000	
ファミリーマート	112,600	2,103.00	236,797,800	
木曽路	18,500	2,568.00	47,508,000	

ＳＲＳホールディングス	16,800	926.00	15,556,800	
タカキュー	10,900	149.00	1,624,100	
リテールパートナーズ	18,800	1,611.00	30,286,800	
ケーヨー	29,200	652.00	19,038,400	
上新電機	16,700	2,174.00	36,305,800	
日本瓦斯	22,300	4,420.00	98,566,000	
ロイヤルホールディングス	24,700	2,034.00	50,239,800	
いなげや	17,500	1,660.00	29,050,000	
島忠	26,600	2,901.00	77,166,600	
チヨダ	15,000	1,159.00	17,385,000	
ライフコーポレーション	10,700	3,365.00	36,005,500	
リンガーハット	17,500	2,446.00	42,805,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,800	491.00	9,721,800	
テンアライド	13,000	393.00	5,109,000	
ＡＯＫＩホールディングス	28,500	699.00	19,921,500	
オークワ	22,200	1,551.00	34,432,200	
コメリ	21,800	2,626.00	57,246,800	
青山商事	29,300	882.00	25,842,600	
しまむら	16,400	7,730.00	126,772,000	
はせがわ	8,100	345.00	2,794,500	
高島屋	102,700	1,047.00	107,526,900	
松屋	28,600	707.00	20,220,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	66,900	849.00	56,798,100	
近鉄百貨店	5,500	3,440.00	18,920,000	
丸井グループ	129,200	2,139.00	276,358,800	
アクシアル　リテイリング	11,700	4,215.00	49,315,500	
イオン	542,000	2,419.50	1,311,369,000	
イズミ	28,700	3,450.00	99,015,000	
平和堂	28,700	1,948.00	55,907,600	
フジ	17,100	1,890.00	32,319,000	
ヤオコー	16,000	7,450.00	119,200,000	
ゼビオホールディングス	17,300	915.00	15,829,500	
ケーズホールディングス	136,100	1,457.00	198,297,700	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,500	834.00	6,255,000	
日産東京販売ホールディングス	21,700	236.00	5,121,200	
シルバーライフ	2,000	2,249.00	4,498,000	
一家ダイニングプロジェクト	1,400	677.00	947,800	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,300	3,385.00	21,325,500	
ナルミヤ・インターナショナル	3,500	750.00	2,625,000	
ブックオフグループホールディングス	8,200	838.00	6,871,600	
アインホールディングス	17,300	6,940.00	120,062,000	
元気寿司	3,600	2,578.00	9,280,800	

ヤマダ電機	429,500	571.00	245,244,500	
アークランドサカモト	22,200	1,436.00	31,879,200	
ニトリホールディングス	61,000	19,320.00	1,178,520,000	
グルメ杵屋	10,300	995.00	10,248,500	
愛眼	11,200	217.00	2,430,400	
ケーユーホールディングス	7,600	830.00	6,308,000	
吉野家ホールディングス	46,400	2,424.00	112,473,600	
松屋フーズホールディングス	6,800	3,910.00	26,588,000	
サガミホールディングス	19,000	1,274.00	24,206,000	
関西スーパーマーケット	11,900	1,109.00	13,197,100	
王将フードサービス	10,400	6,270.00	65,208,000	
プレナス	15,900	1,844.00	29,319,600	
ミニストップ	10,500	1,567.00	16,453,500	
アークス	28,900	2,201.00	63,608,900	
バローホールディングス	31,300	2,200.00	68,860,000	
ベルク	7,000	6,710.00	46,970,000	
大庄	7,700	1,398.00	10,764,600	
ファーストリテイリング	18,800	66,040.00	1,241,552,000	
サンドラッグ	53,000	3,555.00	188,415,000	
サックスバー　ホールディングス	12,300	634.00	7,798,200	
ヤマザワ	3,400	1,720.00	5,848,000	
やまや	3,000	2,330.00	6,990,000	
ベルーナ	30,600	641.00	19,614,600	
島根銀行	3,700	519.00	1,920,300	
じもとホールディングス	95,300	98.00	9,339,400	
めぶきフィナンシャルグループ	732,800	257.00	188,329,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,000	1,157.00	21,983,000	
九州フィナンシャルグループ	308,600	469.00	144,733,400	
ゆうちょ銀行	399,600	921.00	368,031,600	
富山第一銀行	33,600	276.00	9,273,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	805,500	373.00	300,451,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,800	791.00	74,195,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	82,800	435.00	36,018,000	
三十三フィナンシャルグループ	13,100	1,526.00	19,990,600	
第四北越フィナンシャルグループ	24,500	2,326.00	56,987,000	
新生銀行	103,500	1,489.00	154,111,500	
あおぞら銀行	84,000	2,138.00	179,592,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,647,500	469.00	4,524,677,500	
りそなホールディングス	1,547,700	399.90	618,925,230	
三井住友トラスト・ホールディングス	266,600	3,277.00	873,648,200	
三井住友フィナンシャルグループ	975,400	3,326.00	3,244,180,400	
千葉銀行	470,700	548.00	257,943,600	

群馬銀行	270,900	352.00	95,356,800	
武蔵野銀行	21,000	1,652.00	34,692,000	
千葉興業銀行	38,700	269.00	10,410,300	
筑波銀行	58,600	184.00	10,782,400	
七十七銀行	47,600	1,643.00	78,206,800	
青森銀行	10,900	2,277.00	24,819,300	
秋田銀行	9,000	1,614.00	14,526,000	
山形銀行	15,800	1,380.00	21,804,000	
岩手銀行	9,200	2,688.00	24,729,600	
東邦銀行	126,100	236.00	29,759,600	
東北銀行	6,800	950.00	6,460,000	
みちのく銀行	9,100	1,193.00	10,856,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	118,800	1,866.00	221,680,800	
静岡銀行	349,200	735.00	256,662,000	
十六銀行	17,700	2,133.00	37,754,100	
スルガ銀行	144,300	440.00	63,492,000	
八十二銀行	340,400	423.00	143,989,200	
山梨中央銀行	16,400	926.00	15,186,400	
大垣共立銀行	27,900	2,316.00	64,616,400	
福井銀行	12,100	1,689.00	20,436,900	
北國銀行	14,000	2,994.00	41,916,000	
清水銀行	5,800	1,801.00	10,445,800	
富山銀行	2,700	2,325.00	6,277,500	
滋賀銀行	28,300	2,572.00	72,787,600	
南都銀行	23,500	2,241.00	52,663,500	
百五銀行	126,900	333.00	42,257,700	
京都銀行	50,500	4,100.00	207,050,000	
紀陽銀行	49,900	1,693.00	84,480,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	93,900	949.00	89,111,100	
広島銀行	208,200	529.00	110,137,800	
山陰合同銀行	83,600	555.00	46,398,000	
中国銀行	121,400	1,029.00	124,920,600	
鳥取銀行	4,800	1,287.00	6,177,600	
伊予銀行	201,200	656.00	131,987,200	
百十四銀行	15,000	2,013.00	30,195,000	
四国銀行	21,400	847.00	18,125,800	
阿波銀行	23,000	2,699.00	62,077,000	
大分銀行	8,100	2,455.00	19,885,500	
宮崎銀行	9,400	2,411.00	22,663,400	
佐賀銀行	8,600	1,247.00	10,724,200	
沖縄銀行	12,900	3,265.00	42,118,500	
琉球銀行	32,500	960.00	31,200,000	

セブン銀行	471,100	302.00	142,272,200	
みずほフィナンシャルグループ	19,163,900	143.00	2,740,437,700	
高知銀行	5,100	719.00	3,666,900	
山口フィナンシャルグループ	176,000	672.00	118,272,000	
長野銀行	4,600	1,146.00	5,271,600	
名古屋銀行	10,500	2,523.00	26,491,500	
北洋銀行	212,600	227.00	48,260,200	
愛知銀行	5,100	2,985.00	15,223,500	
中京銀行	5,800	2,178.00	12,632,400	
大光銀行	4,800	1,468.00	7,046,400	
愛媛銀行	19,700	1,174.00	23,127,800	
トマト銀行	5,400	1,089.00	5,880,600	
京葉銀行	60,100	532.00	31,973,200	
栃木銀行	68,100	179.00	12,189,900	
北日本銀行	4,400	1,998.00	8,791,200	
東和銀行	24,800	729.00	18,079,200	
福島銀行	13,300	193.00	2,566,900	
大東銀行	7,300	624.00	4,555,200	
トモニホールディングス	109,000	358.00	39,022,000	
フィデアホールディングス	136,900	112.00	15,332,800	
池田泉州ホールディングス	162,200	174.00	28,222,800	
ＦＰＧ	43,800	706.00	30,922,800	
マーキュリアインベストメント	6,600	614.00	4,052,400	
ＳＢＩホールディングス	157,600	2,345.00	369,572,000	
ジャフコ	21,700	3,820.00	82,894,000	
大和証券グループ本社	1,132,100	480.70	544,200,470	
野村ホールディングス	2,481,900	506.40	1,256,834,160	
岡三証券グループ	120,700	362.00	43,693,400	
丸三証券	42,300	473.00	20,007,900	
東洋証券	51,800	138.00	7,148,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	162,700	273.00	44,417,100	
光世証券	3,700	550.00	2,035,000	
水戸証券	41,700	214.00	8,923,800	
いちよし証券	26,800	487.00	13,051,600	
松井証券	80,800	884.00	71,427,200	
だいこう証券ビジネス	6,800	920.00	6,256,000	
マネックスグループ	104,300	240.00	25,032,000	
極東証券	19,300	574.00	11,078,200	
岩井コスモホールディングス	13,500	1,066.00	14,391,000	
藍澤證券	25,600	716.00	18,329,600	
マネーパートナーズグループ	15,900	215.00	3,418,500	
スパークス・グループ	66,000	230.00	15,180,000	

かんぽ生命保険	50,000	1,511.00	75,550,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	265,200	3,876.00	1,027,915,200	
アニコム　ホールディングス	11,700	5,000.00	58,500,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	368,700	3,300.00	1,216,710,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	115,900	2,596.00	300,876,400	
第一生命ホールディングス	798,100	1,523.50	1,215,905,350	
東京海上ホールディングス	498,600	5,091.00	2,538,372,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	421,500	1,078.00	454,377,000	
アドバンスクリエイト	2,900	2,296.00	6,658,400	
全国保証	39,700	4,350.00	172,695,000	
ジェイリース	3,900	399.00	1,556,100	
イントラスト	4,900	791.00	3,875,900	
日本モーゲージサービス	2,900	1,989.00	5,768,100	
Ｃａｓａ	4,900	1,305.00	6,394,500	
アルヒ	22,400	1,694.00	37,945,600	
プレミアグループ	7,700	1,937.00	14,914,900	
クレディセゾン	98,800	1,431.00	141,382,800	
芙蓉総合リース	14,800	6,330.00	93,684,000	
みずほリース	21,800	2,520.00	54,936,000	
東京センチュリー	28,400	5,520.00	156,768,000	
日本証券金融	62,200	528.00	32,841,600	
アイフル	215,100	266.00	57,216,600	
リコーリース	11,100	3,190.00	35,409,000	
イオンフィナンシャルサービス	86,300	1,329.00	114,692,700	
アコム	283,500	461.00	130,693,500	
ジャックス	15,600	1,978.00	30,856,800	
オリエントコーポレーション	381,500	137.00	52,265,500	
日立キャピタル	33,200	2,493.00	82,767,600	
アプラスフィナンシャル	67,700	76.00	5,145,200	
オリックス	882,100	1,550.00	1,367,255,000	
三菱ＵＦＪリース	357,900	566.00	202,571,400	
九州リースサービス	6,900	521.00	3,594,900	
日本取引所グループ	404,800	2,435.00	985,688,000	
イー・ギャランティ	15,100	2,024.00	30,562,400	
アサックス	7,300	662.00	4,832,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,700	2,141.00	12,203,700	
いちご	186,100	315.00	58,621,500	
日本駐車場開発	153,600	146.00	22,425,600	
スター・マイカ・ホールディングス	8,700	1,504.00	13,084,800	
ＡＤワークスグループ	26,200	197.00	5,161,400	
ヒューリック	303,000	1,092.00	330,876,000	
三栄建築設計	7,300	1,347.00	9,833,100	

野村不動産ホールディングス	86,600	2,165.00	187,489,000	
三重交通グループホールディングス	32,700	498.00	16,284,600	
サムティ	21,400	1,471.00	31,479,400	
ディア・ライフ	24,000	512.00	12,288,000	
日本商業開発	10,300	1,566.00	16,129,800	
ハウスコム	3,900	1,388.00	5,413,200	
日本管理センター	11,000	1,320.00	14,520,000	
サンセイランディック	6,500	888.00	5,772,000	
フージャースホールディングス	28,100	577.00	16,213,700	
オープンハウス	41,600	3,535.00	147,056,000	
東急不動産ホールディングス	386,900	603.00	233,300,700	
飯田グループホールディングス	118,900	1,736.00	206,410,400	
イーグランド	5,300	716.00	3,794,800	
ムゲンエステート	13,400	570.00	7,638,000	
ハウスドゥ	6,900	1,133.00	7,817,700	
シーアールイー	5,100	1,376.00	7,017,600	
グッドコムアセット	4,600	1,853.00	8,523,800	
ジェイ・エス・ビー	3,900	2,282.00	8,899,800	
テンポイノベーション	6,200	704.00	4,364,800	
パーク２４	76,700	2,263.00	173,572,100	
パラカ	4,800	1,830.00	8,784,000	
三井不動産	696,500	2,282.00	1,589,413,000	
三菱地所	989,300	1,786.50	1,767,384,450	
平和不動産	26,500	3,095.00	82,017,500	
東京建物	150,000	1,455.00	218,250,000	
ダイビル	38,200	1,094.00	41,790,800	
京阪神ビルディング	24,000	1,401.00	33,624,000	
住友不動産	317,700	3,274.00	1,040,149,800	
テーオーシー	30,500	753.00	22,966,500	
東京楽天地	2,700	4,895.00	13,216,500	
スターツコーポレーション	20,100	2,227.00	44,762,700	
フジ住宅	20,100	570.00	11,457,000	
空港施設	18,800	447.00	8,403,600	
明和地所	12,500	446.00	5,575,000	
ゴールドクレスト	12,400	1,570.00	19,468,000	
エスリード	6,900	1,520.00	10,488,000	
日神グループホールディングス	26,000	407.00	10,582,000	
日本エスコン	25,500	848.00	21,624,000	
タカラレーベン	64,500	383.00	24,703,500	
ＡＶＡＮＴＩＡ	10,600	790.00	8,374,000	
イオンモール	72,000	1,558.00	112,176,000	
毎日コムネット	6,300	801.00	5,046,300	

ファースト住建	8,200	981.00	8,044,200	
カチタス	35,700	2,756.00	98,389,200	
トーセイ	21,300	1,134.00	24,154,200	
穴吹興産	4,300	1,773.00	7,623,900	
サンフロンティア不動産	21,600	989.00	21,362,400	
エフ・ジェー・ネクスト	14,600	909.00	13,271,400	
インテリックス	4,000	538.00	2,152,000	
ランドビジネス	4,800	435.00	2,088,000	
日本社宅サービス	6,200	1,107.00	6,863,400	
グランディハウス	16,000	428.00	6,848,000	
日本空港ビルデング	45,400	5,060.00	229,724,000	
日本工営	9,200	3,215.00	29,578,000	
ＬＩＦＵＬＬ	48,000	434.00	20,832,000	
ジェイエイシーリクルートメント	9,300	1,309.00	12,173,700	
日本M&Aセンター	103,200	4,895.00	505,164,000	
メンバーズ	4,100	1,675.00	6,867,500	
中広	2,200	553.00	1,216,600	
ＵＴグループ	21,600	2,449.00	52,898,400	
アイティメディア	5,600	1,401.00	7,845,600	
タケエイ	13,200	969.00	12,790,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	2,500	1,563.00	3,907,500	
ビーネックスグループ	17,300	957.00	16,556,100	
コシダカホールディングス	33,200	521.00	17,297,200	
アルトナー	3,500	921.00	3,223,500	
パソナグループ	14,900	1,277.00	19,027,300	
ＣＤＳ	3,500	1,311.00	4,588,500	
リンクアンドモチベーション	30,400	459.00	13,953,600	
ＧＣＡ	16,800	695.00	11,676,000	
エス・エム・エス	42,600	2,657.00	113,188,200	
サニーサイドアップグループ	4,900	870.00	4,263,000	
パーソルホールディングス	136,700	1,522.00	208,057,400	
リニカル	6,800	934.00	6,351,200	
クックパッド	48,200	319.00	15,375,800	
エスクリ	4,600	468.00	2,152,800	
アイ・ケイ・ケイ	6,900	607.00	4,188,300	
学情	4,900	1,417.00	6,943,300	
スタジオアリス	7,000	1,709.00	11,963,000	
シミックホールディングス	6,800	1,580.00	10,744,000	
エプコ	3,000	1,179.00	3,537,000	
ＮＪＳ	3,100	1,781.00	5,521,100	
綜合警備保障	54,400	5,350.00	291,040,000	
カカクコム	101,000	2,823.00	285,123,000	

アイロムグループ	4,800	3,355.00	16,104,000	
セントケア・ホールディング	9,200	409.00	3,762,800	
サイネックス	2,500	700.00	1,750,000	
ルネサンス	7,700	1,203.00	9,263,100	
ディップ	19,300	2,486.00	47,979,800	
オプトホールディング	7,500	1,510.00	11,325,000	
ツクイ	32,400	565.00	18,306,000	
キャリアデザインセンター	3,300	1,056.00	3,484,800	
ベネフィット・ワン	49,800	2,281.00	113,593,800	
エムスリー	301,300	4,505.00	1,357,356,500	
ツカダ・グローバルホールディング	8,700	374.00	3,253,800	
ブラス	2,100	570.00	1,197,000	
アウトソーシング	78,400	753.00	59,035,200	
ウェルネット	14,000	801.00	11,214,000	
ワールドホールディングス	4,800	1,860.00	8,928,000	
ディー・エヌ・エー	67,100	1,457.00	97,764,700	
博報堂ＤＹホールディングス	190,100	1,343.00	255,304,300	
ぐるなび	24,000	799.00	19,176,000	
タカミヤ	14,800	505.00	7,474,000	
ジャパンベストレスキューシステム	10,800	935.00	10,098,000	
ファンコミュニケーションズ	37,900	484.00	18,343,600	
ライク	4,600	1,713.00	7,879,800	
ビジネス・ブレークスルー	6,100	380.00	2,318,000	
エスプール	35,300	797.00	28,134,100	
ＷＤＢホールディングス	6,300	2,800.00	17,640,000	
手間いらず	900	5,210.00	4,689,000	
ティア	8,200	537.00	4,403,400	
ＣＤＧ	1,600	1,550.00	2,480,000	
バリューコマース	7,700	2,853.00	21,968,100	
インフォマート	149,900	906.00	135,809,400	
ＪＰホールディングス	43,400	281.00	12,195,400	
エコナックホールディングス	26,100	103.00	2,688,300	
ＥＰＳホールディングス	18,600	1,106.00	20,571,600	
レッグス	3,500	1,035.00	3,622,500	
プレステージ・インターナショナル	51,300	938.00	48,119,400	
アミューズ	7,500	2,257.00	16,927,500	
ドリームインキュベータ	4,300	1,517.00	6,523,100	
クイック	8,600	1,270.00	10,922,000	
ＴＡＣ	9,000	200.00	1,800,000	
ケネディクス	127,600	590.00	75,284,000	
電通グループ	140,900	3,040.00	428,336,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,400	731.00	3,947,400	

ぴあ	3,900	3,790.00	14,781,000	
イオンファンタジー	5,300	1,866.00	9,889,800	
シーティーエス	15,600	856.00	13,353,600	
ネクシィーズグループ	4,300	1,175.00	5,052,500	
みらかホールディングス	38,300	2,679.00	102,605,700	
アルプス技研	12,200	1,961.00	23,924,200	
ダイオーズ	2,800	1,121.00	3,138,800	
日本空調サービス	14,500	728.00	10,556,000	
オリエンタルランド	145,300	15,465.00	2,247,064,500	
ダスキン	34,000	2,865.00	97,410,000	
明光ネットワークジャパン	17,500	880.00	15,400,000	
ファルコホールディングス	7,600	1,634.00	12,418,400	
ラウンドワン	38,300	932.00	35,695,600	
リゾートトラスト	62,700	1,512.00	94,802,400	
ビー・エム・エル	17,600	3,085.00	54,296,000	
ワタベウェディング	2,600	396.00	1,029,600	
りらいあコミュニケーションズ	24,800	1,254.00	31,099,200	
リソー教育	62,900	340.00	21,386,000	
早稲田アカデミー	6,100	959.00	5,849,900	
ユー・エス・エス	153,100	1,944.00	297,626,400	
東京個別指導学院	5,100	623.00	3,177,300	
サイバーエージェント	84,200	5,110.00	430,262,000	
楽天	637,000	973.00	619,801,000	
クリーク・アンド・リバー社	7,300	1,119.00	8,168,700	
テー・オー・ダブリュー	22,100	382.00	8,442,200	
山田コンサルティンググループ	8,900	1,432.00	12,744,800	
セントラルスポーツ	5,100	2,615.00	13,336,500	
フルキャストホールディングス	13,800	1,655.00	22,839,000	
エン・ジャパン	24,300	3,165.00	76,909,500	
リソルホールディングス	1,500	3,505.00	5,257,500	
テクノプロ・ホールディングス	27,300	6,790.00	185,367,000	
アトラ	3,700	271.00	1,002,700	
インターワークス	3,000	398.00	1,194,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,600	10,410.00	58,296,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,100	1,724.00	8,792,400	
ファーストロジック	2,900	620.00	1,798,000	
三機サービス	2,800	1,057.00	2,959,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,600	1,037.00	8,918,200	
デザインワン・ジャパン	4,600	278.00	1,278,800	
イー・ガーディアン	6,100	2,496.00	15,225,600	
リブセンス	9,300	287.00	2,669,100	
ジャパンマテリアル	42,100	1,703.00	71,696,300	

ベクトル	17,200	960.00	16,512,000	
ウチヤマホールディングス	7,100	370.00	2,627,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,800	877.00	10,348,600	
ライクキッズ	2,500	922.00	2,305,000	
キャリアリンク	4,700	593.00	2,787,100	
ＩＢＪ	9,500	838.00	7,961,000	
アサンテ	5,600	1,562.00	8,747,200	
Ｎ・フィールド	9,600	618.00	5,932,800	
バリューＨＲ	5,500	1,516.00	8,338,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	11,100	4,265.00	47,341,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	2,000.00	10,600,000	
ＥＲＩホールディングス	4,100	670.00	2,747,000	
アビスト	2,200	2,624.00	5,772,800	
シグマクシス	9,400	1,886.00	17,728,400	
ウィルグループ	9,100	735.00	6,688,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	19,600	223.00	4,370,800	
リクルートホールディングス	978,900	4,048.00	3,962,587,200	
エラン	8,200	1,940.00	15,908,000	
土木管理総合試験所	6,300	374.00	2,356,200	
ネットマーケティング	5,500	673.00	3,701,500	
日本郵政	1,120,100	848.80	950,740,880	
ベルシステム２４ホールディングス	23,000	1,456.00	33,488,000	
鎌倉新書	10,400	1,298.00	13,499,200	
ＳＭＮ	3,000	1,084.00	3,252,000	
一蔵	1,800	413.00	743,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,800	2,634.00	12,643,200	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,700	607.00	1,638,900	
エアトリ	7,100	1,356.00	9,627,600	
アトラエ	4,200	3,415.00	14,343,000	
ストライク	5,200	5,160.00	26,832,000	
ソラスト	37,800	1,239.00	46,834,200	
セラク	4,400	1,068.00	4,699,200	
インソース	5,700	3,025.00	17,242,500	
ベイカレント・コンサルティング	8,300	9,150.00	75,945,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,000	1,425.00	4,275,000	
アイモバイル	5,000	824.00	4,120,000	
キャリアインデックス	6,000	350.00	2,100,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,600	908.00	4,176,800	
船場	2,400	1,006.00	2,414,400	
グレイステクノロジー	6,300	4,660.00	29,358,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,400	3,175.00	45,720,000	
フルテック	2,000	1,278.00	2,556,000	

グリーンズ	3,700	580.00	2,146,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	4,300	657.00	2,825,100	
ソウルドアウト	2,800	2,525.00	7,070,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,800	623.00	1,744,400	
ミダック	1,900	1,653.00	3,140,700	
日総工産	9,300	778.00	7,235,400	
キュービーネットホールディングス	5,700	2,225.00	12,682,500	
ＲＰＡホールディングス	10,500	899.00	9,439,500	
スプリックス	4,000	887.00	3,548,000	
マネジメントソリューションズ	6,000	1,171.00	7,026,000	
プロレド・パートナーズ	1,900	5,070.00	9,633,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	1,300	1,144.00	1,487,200	
ギークス	1,500	1,368.00	2,052,000	
カーブスホールディングス	37,700	672.00	25,334,400	
フォーラムエンジニアリング	7,300	958.00	6,993,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,100	918.00	6,517,800	
リログループ	74,800	2,452.00	183,409,600	
東祥	8,600	1,438.00	12,366,800	
エイチ・アイ・エス	21,300	2,036.00	43,366,800	
ラックランド	3,200	2,262.00	7,238,400	
共立メンテナンス	22,700	3,950.00	89,665,000	
イチネンホールディングス	15,400	1,269.00	19,542,600	
建設技術研究所	9,500	1,828.00	17,366,000	
スペース	9,000	1,042.00	9,378,000	
長大	5,600	1,093.00	6,120,800	
燦ホールディングス	6,100	1,240.00	7,564,000	
スバル興業	800	7,900.00	6,320,000	
東京テアトル	5,500	1,293.00	7,111,500	
タナベ経営	2,700	1,291.00	3,485,700	
ナガワ	4,400	7,600.00	33,440,000	
よみうりランド	3,000	3,755.00	11,265,000	
東京都競馬	9,000	3,745.00	33,705,000	
カナモト	22,400	2,361.00	52,886,400	
東京ドーム	55,500	890.00	49,395,000	
西尾レントオール	12,700	2,356.00	29,921,200	
トランス・コスモス	13,100	2,478.00	32,461,800	
乃村工藝社	58,700	1,016.00	59,639,200	
藤田観光	6,000	1,926.00	11,556,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,500	1,136.00	9,656,000	
日本管財	14,700	1,895.00	27,856,500	
トーカイ	13,300	2,665.00	35,444,500	
白洋舎	1,600	2,895.00	4,632,000	

セコム	145,000	9,619.00	1,394,755,000	
セントラル警備保障	6,600	4,660.00	30,756,000	
丹青社	26,000	817.00	21,242,000	
メイテック	16,800	5,540.00	93,072,000	
応用地質	14,800	1,374.00	20,335,200	
船井総研ホールディングス	28,300	2,588.00	73,240,400	
進学会ホールディングス	5,600	514.00	2,878,400	
オオバ	10,000	670.00	6,700,000	
いであ	3,400	1,991.00	6,769,400	
学究社	4,100	1,143.00	4,686,300	
ベネッセホールディングス	45,600	2,932.00	133,699,200	
イオンディライト	16,900	3,230.00	54,587,000	
ナック	7,700	912.00	7,022,400	
ニチイ学館	18,900	1,600.00	30,240,000	
ダイセキ	23,000	2,850.00	65,550,000	
ステップ	5,100	1,516.00	7,731,600	
合　計	167,583,090		326,255,581,770	

(2)株式以外の有価証券

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

(注)券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,820,777,095

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
国債証券	454,862,612,050
地方債証券	29,744,962,615
特殊債券	36,925,642,672
社債券	22,822,421,160
未収入金	1,009,983,000
未収利息	1,244,550,989
前払費用	46,761,742
流動資産合計	549,477,711,323
資産合計	549,477,711,323
負債の部	
流動負債	
未払金	3,100,372,900
未払解約金	356,626,252
未払利息	4,154
その他未払費用	4,603
流動負債合計	3,457,007,909
負債合計	3,457,007,909
純資産の部	
元本等	
元本	387,020,022,692
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	159,000,680,722
元本等合計	546,020,703,414
純資産合計	546,020,703,414
負債純資産合計	549,477,711,323

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
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 6月10日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数	387,020,022,692口
2． 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	有価証券 101,288,000円
3． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4108円
	(1万口当たり純資産額) (14,108円)

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2020年 6月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6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 6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	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。 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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	325,773,760,165円
期中追加設定元本額	100,983,554,677円
期中一部解約元本額	39,737,292,150円
期末元本額	387,020,022,692円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,645,430,270円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	12,256,774円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	18,177,615,105円
世界経済インデックスファンド	2,001,498,286円
ＤＣマイセレクション２５	21,467,089,673円

区分	2020年 6月10日現在
ＤＣマイセレクション５０	23,154,088,936円
ＤＣマイセレクション７５	5,957,960,957円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	456,762,344円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	89,805,995,866円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,373,417,174円
ＤＣマイセレクションＳ２５	9,318,558,253円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,903,516,158円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,979,380,417円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,087,592,181円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,457,433,953円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	500,639,285円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,589,451,793円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	66,144,821円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,307,726円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	42,611,891円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	13,051,579円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	894,939円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	150,498,015円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	209,307,357円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	53,384,867円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	81,044,820円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,973,303,538円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	843,551,077円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,538,160,880円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	760,635,471円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	87,899,212円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,154,928,764円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	25,765,905円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,329,809,832円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,680,657,769円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	149,420,301円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	6,244,722,646円
日本債券ファンド・シリーズ１	11,701,837,788円
分散投資コア戦略ファンドＡ	11,584,372,689円
分散投資コア戦略ファンドＳ	10,279,323,307円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	89,549,155円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	921,666,847円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,385,335円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,431,978円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	56,691,507円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	14,243,620円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	26,833,341円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	39,042,936円

区分	2020年 6月10日現在
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,143,240円
グローバル経済コア	223,504,626円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	16,033,147円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,888,019円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	140,445円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	173,612円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	44,437円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	12,591円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	71,666,869,041円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	14,818,956円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 6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	△1,110,522,350
地方債証券	△15,753,915
特殊債券	△31,771,586
社債券	△24,381,930
合計	△1,182,429,781

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第４０２回利付国債（２年）	500,000,000	501,425,000	
	第４０３回利付国債（２年）	3,690,000,000	3,701,143,800	

第４０４回利付国債（２年）	460,000,000	461,495,000	
第４０５回利付国債（２年）	470,000,000	471,659,100	
第４０６回利付国債（２年）	780,000,000	782,932,800	
第４０７回利付国債（２年）	360,000,000	361,407,600	
第４０８回利付国債（２年）	690,000,000	692,856,600	
第４０９回利付国債（２年）	2,670,000,000	2,681,641,200	
第４１０回利付国債（２年）	390,000,000	391,782,300	
第４１２回利付国債（２年）	780,000,000	783,985,800	
第４１３回利付国債（２年）	470,000,000	472,415,800	
第１２９回利付国債（５年）	3,340,000,000	3,351,088,800	
第１３０回利付国債（５年）	3,160,000,000	3,172,545,200	
第１３１回利付国債（５年）	4,990,000,000	5,013,053,800	
第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	4,794,660,900	
第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,405,009,800	
第１３４回利付国債（５年）	6,050,000,000	6,088,296,500	
第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,108,396,800	
第１３６回利付国債（５年）	4,140,000,000	4,171,422,600	
第１３７回利付国債（５年）	6,900,000,000	6,955,614,000	
第１３８回利付国債（５年）	9,420,000,000	9,500,070,000	
第１３９回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,419,025,800	
第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	7,366,430,000	
第１４１回利付国債（５年）	6,020,000,000	6,076,889,000	
第１４２回利付国債（５年）	6,050,000,000	6,107,777,500	
第１４３回利付国債（５年）	2,800,000,000	2,826,852,000	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	596,240,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,637,923,700	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	803,759,000	
第４回利付国債（４０年）	1,000,000,000	1,475,010,000	
第５回利付国債（４０年）	920,000,000	1,314,569,600	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,776,726,000	
第７回利付国債（４０年）	830,000,000	1,127,546,700	
第８回利付国債（４０年）	800,000,000	1,017,800,000	
第９回利付国債（４０年）	930,000,000	886,968,900	
第１０回利付国債（４０年）	1,990,000,000	2,226,869,700	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,945,157,200	
第１２回利付国債（４０年）	1,650,000,000	1,623,633,000	
第１３回利付国債（４０年）	400,000,000	392,832,000	
第３１７回利付国債（１０年）	890,000,000	904,337,900	
第３１８回利付国債（１０年）	2,260,000,000	2,293,538,400	
第３１９回利付国債（１０年）	1,710,000,000	1,743,088,500	
第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	4,651,437,400	
第３２１回利付国債（１０年）	2,470,000,000	2,520,931,400	

第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	764,130,000	
第３２３回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,971,340,600	
第３２４回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,793,128,600	
第３２５回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,983,685,200	
第３２６回利付国債（１０年）	3,120,000,000	3,187,236,000	
第３２７回利付国債（１０年）	3,190,000,000	3,266,815,200	
第３２８回利付国債（１０年）	3,400,000,000	3,470,992,000	
第３２９回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,314,575,000	
第３３０回利付国債（１０年）	1,690,000,000	1,742,575,900	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	922,068,000	
第３３２回利付国債（１０年）	3,110,000,000	3,191,544,200	
第３３３回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,394,937,100	
第３３４回利付国債（１０年）	1,790,000,000	1,842,482,800	
第３３５回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,515,831,500	
第３３６回利付国債（１０年）	510,000,000	524,387,100	
第３３７回利付国債（１０年）	3,330,000,000	3,392,870,400	
第３３８回利付国債（１０年）	3,060,000,000	3,134,113,200	
第３３９回利付国債（１０年）	5,230,000,000	5,362,057,500	
第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	6,487,606,400	
第３４１回利付国債（１０年）	2,160,000,000	2,207,995,200	
第３４２回利付国債（１０年）	6,380,000,000	6,452,157,800	
第３４３回利付国債（１０年）	3,250,000,000	3,288,382,500	
第３４４回利付国債（１０年）	6,940,000,000	7,025,431,400	
第３４５回利付国債（１０年）	2,290,000,000	2,318,556,300	
第３４６回利付国債（１０年）	5,200,000,000	5,267,288,000	
第３４７回利付国債（１０年）	2,000,000,000	2,026,140,000	
第３４８回利付国債（１０年）	4,840,000,000	4,905,533,600	
第３４９回利付国債（１０年）	3,130,000,000	3,171,441,200	
第３５０回利付国債（１０年）	5,790,000,000	5,864,575,200	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	3,590,000,000	3,634,839,100	
第３５２回利付国債（１０年）	4,190,000,000	4,240,447,600	
第３５３回利付国債（１０年）	4,470,000,000	4,519,661,700	
第３５４回利付国債（１０年）	3,780,000,000	3,819,841,200	
第３５５回利付国債（１０年）	4,940,000,000	4,989,054,200	
第３５６回利付国債（１０年）	2,420,000,000	2,442,433,400	
第３５７回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,692,855,200	
第３５８回利付国債（１０年）	3,310,000,000	3,335,818,000	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	138,443,800	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	196,945,600	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	147,067,200	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	142,571,000	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	61,562,000	

第６回利付国債（３０年）	190,000,000	239,713,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	226,456,200	
第８回利付国債（３０年）	100,000,000	120,385,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	277,224,000	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	179,048,000	
第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	107,751,600	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	237,919,900	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	360,168,400	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	389,766,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	447,596,400	
第１６回利付国債（３０年）	370,000,000	488,459,200	
第１７回利付国債（３０年）	570,000,000	746,483,400	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	447,989,400	
第１９回利付国債（３０年）	380,000,000	494,953,800	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	641,275,200	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	654,660,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	537,380,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	579,511,000	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	513,319,200	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	463,134,000	
第２６回利付国債（３０年）	530,000,000	711,710,500	
第２７回利付国債（３０年）	1,010,000,000	1,379,498,400	
第２８回利付国債（３０年）	1,640,000,000	2,252,572,800	
第２９回利付国債（３０年）	1,520,000,000	2,073,067,200	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,394,863,100	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,476,816,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,132,395,200	
第３３回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,327,337,600	
第３４回利付国債（３０年）	1,665,000,000	2,263,667,400	
第３５回利付国債（３０年）	1,940,000,000	2,571,314,800	
第３６回利付国債（３０年）	1,950,000,000	2,593,051,500	
第３７回利付国債（３０年）	1,910,000,000	2,511,420,800	
第３８回利付国債（３０年）	1,230,000,000	1,596,060,300	
第３９回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,586,172,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,170,000,000	1,523,655,900	
第４１回利付国債（３０年）	780,000,000	1,000,186,200	
第４２回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,732,860,000	
第４３回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,927,395,000	
第４４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,569,212,800	
第４５回利付国債（３０年）	990,000,000	1,229,104,800	
第４６回利付国債（３０年）	1,590,000,000	1,975,304,700	
第４７回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,710,720,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,222,474,800	

第４９回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,759,248,000	
第５０回利付国債（３０年）	1,110,000,000	1,195,569,900	
第５１回利付国債（３０年）	1,840,000,000	1,757,273,600	
第５２回利付国債（３０年）	1,600,000,000	1,603,712,000	
第５３回利付国債（３０年）	690,000,000	707,815,800	
第５４回利付国債（３０年）	2,110,000,000	2,270,170,100	
第５５回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,118,270,400	
第５６回利付国債（３０年）	1,870,000,000	2,011,895,600	
第５７回利付国債（３０年）	1,550,000,000	1,666,529,000	
第５８回利付国債（３０年）	1,710,000,000	1,839,583,800	
第５９回利付国債（３０年）	120,000,000	126,054,000	
第６０回利付国債（３０年）	2,530,000,000	2,787,604,600	
第６１回利付国債（３０年）	1,330,000,000	1,394,664,600	
第６２回利付国債（３０年）	170,000,000	169,148,300	
第６３回利付国債（３０年）	980,000,000	947,944,200	
第６４回利付国債（３０年）	1,700,000,000	1,641,894,000	
第６５回利付国債（３０年）	860,000,000	830,390,200	
第６６回利付国債（３０年）	800,000,000	772,256,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	113,194,400	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	82,765,600	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	207,220,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	145,383,000	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	156,564,000	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	250,015,200	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	314,049,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	209,380,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	363,755,000	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	247,682,400	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	329,184,000	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	211,816,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	341,488,000	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	235,859,800	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	352,621,500	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	140,004,800	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	206,782,700	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	422,970,600	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	440,764,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	218,764,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	690,120,900	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	394,549,200	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	220,104,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	143,715,000	

第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	295,893,000	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	319,203,000	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	187,122,400	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	298,557,900	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	244,380,400	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	433,329,000	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	669,840,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	325,359,700	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	524,698,600	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	326,946,000	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	239,192,100	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	623,265,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	480,803,400	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	398,548,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	721,066,500	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	517,887,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	1,006,174,400	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	468,228,200	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	700,786,300	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	712,559,300	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,834,860,000	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	466,752,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	510,206,400	
第９９回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,338,795,500	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	564,710,400	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	852,351,500	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,508,711,400	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	475,732,000	
第１０４回利付国債（２０年）	360,000,000	422,359,200	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,389,686,000	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	450,683,800	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	307,338,200	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	768,880,200	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	607,739,600	
第１１０回利付国債（２０年）	950,000,000	1,126,985,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,163,631,400	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	940,566,100	
第１１３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,732,474,500	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,793,437,000	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	845,894,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,806,803,800	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,299,099,600	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	789,947,400	

第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	623,757,000	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,816,348,700	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,784,625,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,108,748,800	
第１２３回利付国債（２０年）	830,000,000	1,007,628,300	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	734,165,500	
第１２５回利付国債（２０年）	820,000,000	1,007,279,800	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	881,110,000	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,220,226,000	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,163,563,500	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,057,862,900	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,531,141,750	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,180,380,000	
第１３２回利付国債（２０年）	840,000,000	993,703,200	
第１３３回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,421,324,100	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,352,723,000	
第１３５回利付国債（２０年）	30,000,000	35,564,400	
第１３６回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,725,559,500	
第１３７回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,330,548,800	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	721,841,200	
第１３９回利付国債（２０年）	580,000,000	682,155,400	
第１４０回利付国債（２０年）	1,840,000,000	2,190,391,200	
第１４１回利付国債（２０年）	2,110,000,000	2,516,744,700	
第１４２回利付国債（２０年）	580,000,000	698,952,200	
第１４３回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,336,179,800	
第１４４回利付国債（２０年）	1,740,000,000	2,035,660,800	
第１４５回利付国債（２０年）	2,515,000,000	3,011,058,600	
第１４６回利付国債（２０年）	2,440,000,000	2,926,584,800	
第１４７回利付国債（２０年）	2,100,000,000	2,495,388,000	
第１４８回利付国債（２０年）	2,280,000,000	2,682,648,000	
第１４９回利付国債（２０年）	3,040,000,000	3,581,545,600	
第１５０回利付国債（２０年）	3,670,000,000	4,278,302,500	
第１５１回利付国債（２０年）	1,255,000,000	1,429,118,700	
第１５２回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,757,323,800	
第１５３回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,784,489,900	
第１５４回利付国債（２０年）	2,950,000,000	3,367,307,000	
第１５５回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,279,784,500	
第１５６回利付国債（２０年）	1,960,000,000	1,998,533,600	
第１５７回利付国債（２０年）	2,820,000,000	2,785,398,600	
第１５８回利付国債（２０年）	2,320,000,000	2,397,580,800	
第１５９回利付国債（２０年）	2,760,000,000	2,894,908,800	
第１６０回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,576,622,400	

	第１６１回利付国債（２０年）	1,750,000,000	1,833,545,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	580,000,000	607,080,200	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,731,260,600	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,720,000,000	1,769,071,600	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,685,985,600	
	第１６６回利付国債（２０年）	900,000,000	956,574,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,540,000,000	2,606,268,600	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,400,994,900	
	第１６９回利付国債（２０年）	760,000,000	751,875,600	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,381,778,900	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,350,000,000	1,332,787,500	
	第１７２回利付国債（２０年）	1,200,000,000	1,206,624,000	
国債証券合計		419,770,000,000	454,862,612,050	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,424,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	109,390,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	134,277,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	133,576,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	128,710,000	
	第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	127,507,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,730,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	118,003,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	234,916,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	234,330,000	
	第７００回東京都公募公債	100,000,000	101,264,000	
	第７０２回東京都公募公債	100,000,000	101,551,000	
	第７１６回東京都公募公債	100,000,000	101,882,000	
	第７１７回東京都公募公債	100,000,000	101,678,000	
	第７２０回東京都公募公債	100,000,000	102,556,000	
	第７２８回東京都公募公債	100,000,000	102,203,000	
	第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,729,000	
	第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,841,000	
	第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,592,000	
	第７８１回東京都公募公債	300,000,000	301,311,000	
	第８００回東京都公募公債	200,000,000	198,776,000	
	平成２３年度第６回北海道公募公債	200,000,000	202,606,000	
	平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	102,051,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,823,000	
	平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,058,000	
	平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	100,899,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	137,064,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	117,061,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,564,000	

第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	203,808,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,765,000	
第２２６回神奈川県公募公債	200,000,000	201,480,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,592,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	198,682,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	235,450,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,800,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,551,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,556,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,137,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,869,000	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,386,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,320,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,227,760	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	198,852,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	118,942,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	117,390,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	102,537,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,470,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	98,890,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	103,281,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	104,279,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	116,385,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	102,492,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	400,000,000	439,608,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,410,000	
平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	200,000,000	203,094,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	102,484,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,952,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	102,127,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	299,856,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	121,091,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	105,284,000	
平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,374,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,814,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,662,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,802,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,901,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	119,343,000	

	平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,445,000	
	平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,716,000	
	平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,486,000	
	平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,821,000	
	平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,909,000	
	平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,800,000	
	平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	308,568,000	
	平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,743,000	
	平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	104,246,000	
	令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	198,852,000	
	平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	118,351,000	
	平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,936,000	
	平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	128,085,244	
	平成２９年度第１回広島県公募公債	200,000,000	201,244,000	
	第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,220,000	
	第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,432,000	
	第６回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,388,000	
	第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	108,195,000	
	第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,658,000	
	第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	197,690,000	
	平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,922,000	
	平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	102,164,000	
	平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,386,000	
	平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	102,282,000	
	平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	99,999,000	
	平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,094,000	
	平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,664,000	
	平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,356,000	
	平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,392,000	
	平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	108,762,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	119,227,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	109,042,000	
		100,000,000	132,871,000	

	平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）			
	平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,574,000	
	平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,254,000	
	平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	104,246,000	
	平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	103,265,000	
	令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	300,000,000	
	第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,388,000	
	第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,768,000	
	第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,312,000	
	平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	102,612,000	
	平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,877,000	
	平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	102,566,000	
	平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	99,999,000	
	平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,751,200	
	令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	297,987,000	
	平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,843,000	
	第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,944,000	
	第１０５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,608,000	
	第１０７回共同発行市場公募地方債	800,000,000	813,488,000	
	第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,761,000	
	第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,919,000	
	第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,690,000	
	第１１２回共同発行市場公募地方債	220,000,000	223,801,600	
	第１１３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,284,000	
	第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,760,000	
	第１１９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,196,000	
	第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,548,000	
	第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,209,000	
	第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,193,000	
	第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,326,000	
	第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,209,000	
	第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,414,000	
	第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,271,000	
	第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,122,000	
	第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,660,000	
	第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,170,000	
	第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,557,572	
	第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,389,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,259,000	
	第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,146,000	

第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,818,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,572,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,380,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,774,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,626,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,067,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,262,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,073,314	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,915,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,109,000	
平成２３年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	101,348,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	203,680,000	
平成２９年度第１回熊本県公募公債（５年）	100,000,000	99,966,000	
平成２３年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	101,488,000	
平成２３年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,488,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,963,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	238,064,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	297,612,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	103,864,000	
平成２９年度第１回大阪市公募公債（５年）	100,000,000	99,969,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	130,994,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	136,370,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	116,561,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	126,488,000	
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,817,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,945,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	299,535,000	
平成２３年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,598,000	
平成２４年度第２回京都市公募公債	122,500,000	124,735,625	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,832,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	102,190,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,252,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	137,660,400	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	236,192,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	119,965,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	110,578,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	118,253,000	
平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	101,612,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,592,000	

	平成２９年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	202,064,000	
	平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,818,000	
	平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	203,046,000	
	令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	299,685,000	
	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	109,349,000	
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,958,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,809,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	116,759,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,486,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,816,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,243,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,028,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	118,473,000	
	平成２３年度第６回福岡市公募公債	100,000,000	101,348,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	204,482,000	
	平成２８年度第１０回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	99,990,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,487,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	153,583,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,932,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,546,000	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	171,822,400	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	548,152,000	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	200,000,000	203,020,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	198,658,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	202,780,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,790,000	
地方債証券合計		28,359,430,000	29,744,962,615	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,709,120	
	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,704,000	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	310,000,000	315,936,500	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,623,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,259,000	
	第７５回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,425,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,799,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	104,764,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	103,829,000	

第２１回道路債券	100,000,000	131,045,000	
第２８回道路債券	200,000,000	265,440,000	
第３３回道路債券	200,000,000	269,360,000	
第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,333,000	
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	155,364,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,052,000	
第４２回道路債券	100,000,000	110,346,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,768,000	
第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,551,000	
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,866,000	
第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	147,453,000	
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	237,180,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,992,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	509,565,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,809,000	
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,716,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,319,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,434,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,871,000	
第１３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,302,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,925,000	
第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,347,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,818,000	
第１５５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	305,677,540	
第１５７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,254,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,016,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,732,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,890,000	

第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,836,000	
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,811,000	
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,665,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,272,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,858,000	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,838,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	617,748,000	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,264,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	428,000,000	436,020,720	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,326,000	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	151,867,240	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,911,000	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,412,000	
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	232,230,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,612,220	
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,566,000	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,445,000	
第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,312,000	
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,050,000	
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,245,000	
第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,203,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,124,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,316,000	
第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,683,000	
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,693,000	
第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,722,870	
	316,000,000	316,824,760	

第２９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,949,150	
第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,678,000	
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,304,000	
第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,820,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,384,800	
第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,428,000	
第３６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,247,000	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,021,680	
第１回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	110,000,000	110,881,100	
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,842,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	380,772,000	
第３回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,865,000	
第３回公営企業債券（２０年）	110,000,000	113,071,200	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	108,652,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	398,082,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	108,195,000	
第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	133,312,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	43,353,600	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	131,188,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	236,656,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	236,080,000	
第２１回地方公共団体金融機構債券（５年）	400,000,000	399,960,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	117,119,000	
第２９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,417,000	
第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,614,000	
第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,620,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,913,000	
第４４回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,030,000	
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,261,000	
第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,838,000	
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,621,000	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,848,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,622,000	

第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,792,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,669,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,537,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,833,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,939,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,970,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,656,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,259,000	
第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,461,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,626,480	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,823,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,807,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,262,800	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,020,200	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,405,000	
Ｆ１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,161,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,060,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,980,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,225,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,489,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	110,050,000	
第１９回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,007,000	
第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,832,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,805,000	
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	204,554,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,962,200	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,826,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,762,300	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,445,960	
第８１回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,973,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	212,356,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	177,052,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	97,086,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,753,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	104,268,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,637,200	
第５９回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	508,455,000	
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,939,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,854,000	13,243,476	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,323,000	13,866,311	

第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,634,000	14,237,849	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	212,667,000	212,601,073	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	150,088,000	150,146,534	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,525,000	14,061,131	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,444,000	15,100,335	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	271,611,000	270,948,269	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,745,000	11,954,883	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	24,352,000	25,079,150	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,199,000	14,750,205	
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,215,000	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	287,148,000	286,074,066	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,842,000	13,280,811	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,011,000	15,783,616	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,802,000	13,257,367	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,952,000	15,724,569	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,061,000	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,863,000	11,994,916	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,155,000	12,288,461	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,720,000	21,099,611	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,345,000	21,838,729	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,940,000	24,810,298	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,463,000	26,188,864	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,982,000	29,027,505	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,922,000	29,961,143	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,698,000	64,061,923	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,083,000	13,531,223	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,226,000	29,932,826	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,128,000	13,571,070	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,934,000	13,502,190	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,100,000	33,099,108	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,155,000	12,545,053	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,540,000	33,606,816	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,409,000	31,295,587	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,143,000	14,900,074	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,218,000	63,761,829	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,518,000	34,442,090	

	第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,654,000	14,253,547	
	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,864,000	45,317,535	
	第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,649,000	42,962,334	
	第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,735,000	43,096,815	
	第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,830,000	91,555,288	
	第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,516,000	
	第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,144,000	98,456,736	
	第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,970,000	50,111,860	
	第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,090,000	50,650,311	
	第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,573,000	51,222,657	
	第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,454,000	44,591,134	
	第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,494,000	44,311,893	
	第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,953,000	50,605,759	
	第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,946,000	
	第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,585,000	135,106,616	
	第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,696,000	182,134,555	
	第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,069,000	51,094,077	
	第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,710,000	52,841,848	
	第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,563,000	53,580,660	
	第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,204,000	
	第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,974,000	170,344,389	
	第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,935,000	57,875,944	
	第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,290,000	119,546,120	
	第９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,597,000	
	第９３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,231,000	
	第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,295,000	67,347,874	
	第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,912,000	70,867,033	
	第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,211,000	70,494,022	
	第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,791,000	219,745,869	
	第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,638,000	146,806,370	
	第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,566,000	71,981,331	
	第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,266,000	76,918,038	
	第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,918,000	80,268,840	
	第１１１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,866,000	
	第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,232,000	84,812,358	
	第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,467,000	84,865,684	
	第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,712,000	
	第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,545,000	85,312,668	
		85,089,000	86,303,220	

第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,564,000	86,657,507	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,459,000	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,587,000	88,596,878	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,265,000	89,391,261	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,038,000	88,915,738	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,496,000	89,375,650	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,976,000	89,913,807	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,248,000	180,746,513	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,057,000	89,932,430	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,400,000	182,647,784	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,335,000	91,239,253	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,538,000	183,062,919	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,072,000	91,966,327	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,678,000	186,052,004	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,768,000	186,129,740	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	132,007,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,327,000	94,553,316	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,877,000	95,315,195	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,925,000	94,591,867	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,212,000	190,672,313	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,186,000	95,324,019	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,502,000	95,781,820	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,128,000	192,350,868	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,823,000	96,174,285	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,744,000	288,266,411	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,022,000	192,664,184	
	98,909,000	99,172,097	

	第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
	第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,264,000	99,196,500	
	第１６１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,057,000	
	第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,073,000	
	第１６９回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,086,000	
	第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,379,000	
	第１９４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,652,000	
	第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	114,129,000	
	第５７回日本学生支援債券	100,000,000	99,979,000	
	第５８回日本学生支援債券	100,000,000	99,976,000	
	第５９回日本学生支援債券	200,000,000	199,960,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	109,733,000	
	い第７９５号商工債	200,000,000	199,988,000	
	い第８００号商工債	200,000,000	200,032,000	
	い第８０２号商工債	100,000,000	100,035,000	
	い第８０４号商工債	300,000,000	300,114,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	199,524,000	
	い第７９５号農林債	100,000,000	100,012,000	
	い第７９６号農林債	200,000,000	200,024,000	
	第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,152,000	
	第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,157,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,324,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,177,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	99,999,000	
	第２３６号商工債（３年）	300,000,000	299,649,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,241,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	118,237,000	
	第３８回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,019,000	
	第３９回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,044,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,083,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,716,000	
	第３３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,359,000	
	第４２回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,640,000	
	第５９回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,449,000	
	第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,985,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,231,000	
	第３２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,157,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,146,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,631,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	198,322,000	

特殊債券合計		35,272,842,000	36,925,642,672	
社債券	第２０回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,359,000	
	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	98,493,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	294,396,000	
	第１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,928,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,228,000	
	第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,434,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,128,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,474,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,455,000	
	第９回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,640,000	
	第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,666,000	
	第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,467,000	
	第１回ＨＳＢＣ・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	99,954,000	
	第１０回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	200,000,000	204,530,000	
	第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	398,112,000	
	第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,572,000	
	第２１回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,363,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,535,000	
	第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,690,000	
	第７回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,814,000	
	第１１回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,746,000	
	第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,580,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,671,000	
	第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,422,000	
	第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,508,000	
	第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,635,000	
	第７回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,053,000	
	第２回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,045,000	

第１１回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,901,000	
第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,577,000	
第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
第１２回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,424,000	
第５７回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,628,000	
第９回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,560,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,568,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,005,000	
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	198,502,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,290,000	
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,164,000	
第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,583,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	99,839,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,570,000	
第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,366,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,678,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,091,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,338,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,374,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,427,000	
第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,257,000	
第２８回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	98,331,000	
第１０回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,493,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,581,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,642,000	
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,458,000	
第１５回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,154,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,252,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,256,000	
第１２回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,853,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,434,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,491,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,256,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,574,000	
第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,720,000	

	第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,468,000	
	第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,610,000	
	第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,312,000	
	第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債	100,000,000	98,911,000	
	第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,273,000	
	第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	95,839,000	
	第１４回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,850,000	
	第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,906,000	
	第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,577,000	
	第２回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	99,621,000	
	第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,016,000	
	第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,246,000	
	第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,370,000	
	第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	97,162,000	
	第１１回株式会社りそなホールディングス無担保社債	700,000,000	698,936,000	
	第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	118,860,000	
	第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	114,290,000	
	第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,842,000	
	第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,891,000	
	第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,581,000	
	第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	302,337,000	
	第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,003,000	
	第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,187,000	
	第２３回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,807,000	
	第３７回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,320,000	
	第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,231,000	
	第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,762,000	
	第１９３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
	第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,670,000	
	第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,789,000	
	第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,530,000	
	第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,226,000	
		100,000,000	98,863,000	

第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債			
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,344,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,052,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,962,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,509,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,378,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,118,000	
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,488,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,131,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,262,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,592,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,287,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,876,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,826,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,964,000	
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,934,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,005,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	235,026,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,181,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,642,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,441,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,753,730	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,587,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,288,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,620,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,816,600	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,329,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,741,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,480,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	110,301,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	96,024,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	97,425,000	
第５３回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	194,892,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,261,000	

第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,605,000	
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,296,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,905,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,596,000	
第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	100,000,000	101,652,000	
第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,248,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,749,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,992,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,638,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,850,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	96,606,000	
第５０５回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,239,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,468,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,338,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,104,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,392,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,637,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,928,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,230,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,387,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,173,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,354,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,473,000	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,693,000	
第４８７回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,049,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,964,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,281,000	
第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,661,000	
第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,274,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,734,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,764,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,158,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,846,000	
第３１７回北海道電力株式会社社債	200,000,000	206,448,000	
第３２０回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,372,830	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,521,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,669,000	
第３４４回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,062,000	
第３５１回北海道電力株式会社社債	200,000,000	199,936,000	
第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,812,000	
第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,877,000	
第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,521,000	
第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,248,000	

	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,455,000	
	第３７回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,868,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,891,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,674,000	
	第３回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,650,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	198,854,000	
社債券合計		22,566,000,000	22,822,421,160	
合計			544,355,638,497	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,497,984,724
コール・ローン	1,154,054,498
株式	401,982,977,894
投資信託受益証券	286,528,014
投資証券	10,374,780,163
派生商品評価勘定	858,938,940
未収入金	3,715,631
未収配当金	556,744,810
差入委託証拠金	3,361,469,852
流動資産合計	424,077,194,526
資産合計	424,077,194,526
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	198,270
前受金	855,401,710
未払解約金	2,260,598,385
未払利息	1,699
その他未払費用	1,271
流動負債合計	3,116,201,335
負債合計	3,116,201,335

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	153,028,332,972
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	267,932,660,219
元本等合計	420,960,993,191
純資産合計	420,960,993,191
負債純資産合計	424,077,194,526

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (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。 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。

	2020年 6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	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月10日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		153,028,332,972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	2.7509円
	(1万口当たり純資産額)	(27,509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 6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 6月10日現在
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 6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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	137,917,434,727円
期中追加設定元本額	42,138,719,682円
期中一部解約元本額	27,027,821,437円
期末元本額	153,028,332,972円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,383,169,172円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,877,002円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	27,011,374,249円
世界経済インデックスファンド	8,264,079,066円
外国株式インデックス・オープン	791,224,707円
ＤＣマイセレクション２５	978,638,070円
ＤＣマイセレクション５０	4,746,695,444円
ＤＣマイセレクション７５	5,073,421,030円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	9,562,907,292円
ＤＣマイセレクションＳ２５	411,605,480円
ＤＣマイセレクションＳ５０	2,030,890,232円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,468,503,045円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	91,857,820円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	201,868,226円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	134,810,056円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,630,222,254円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	2,183,994,171円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,671,179円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,500,216円

区分	2020年 6月10日現在
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,611,473円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	38,632,193円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	144,345,379円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	30,417,742円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	158,408,585円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	573,334,237円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	339,922,591円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,124,853,276円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,732,818,244円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	65,527,031円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	305,756,726円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	8,055,290円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	101,984,010円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,753,300,818円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,878,225,034円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,043,678,523円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,264,957,748円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,503,070,291円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,163,193,200円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,179,969,248円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,146,509,265円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,144,647,950円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,178,678,308円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	736,878,603円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	39,180,113円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	221,937,043円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,232,652,687円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	37,511,740,384円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	116,409,585円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	402,129,261円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	70,550,945円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,220,225円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	71,110,608円
グローバル経済コア	993,854,541円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,369,734円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,206,020円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	475,028,107円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	78,721,853円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	422,278円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	675,856円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	261,550円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	160,429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）	1,159,571,410円

区分	2020年 6月10日現在
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）	1,403,440,925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）	1,770,804,849円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	158,192,583円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	62,491,708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 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	20,141,205,981
投資信託受益証券	10,107,686
投資証券	733,603,575
合計	20,884,917,242

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 6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	7,016,948,632	－	7,872,350,342	855,401,710
合計		7,016,948,632	－	7,872,350,342	855,401,710

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年 6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	1,528,113,660	－	1,524,774,700	3,338,960
	アメリカドル	1,067,142,900	－	1,064,866,400	2,276,500
	ユーロ	211,458,430	－	211,509,800	△51,370
	イギリスポンド	72,970,930	－	72,689,500	281,430
	スイスフラン	33,874,200	－	33,999,000	△124,800
	スウェーデンクローナ	35,286,000	－	35,130,000	156,000
	ノルウェークローネ	11,679,000	－	11,620,000	59,000
	デンマーククローネ	21,297,900	－	21,320,000	△22,100
	オーストラリアドル	49,305,100	－	48,620,000	685,100
	香港ドル	25,099,200	－	25,020,000	79,200
合計		1,528,113,660	－	1,524,774,700	3,338,960

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	67,650	18.67	1,263,025.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	21.93	786,826.47	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	51.01	1,120,995.76	
	CHEVRON CORP	182,072	101.53	18,485,770.16	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	64.98	1,250,540.10	
	CONOCOPHILLIPS	104,738	48.63	5,093,408.94	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	16,913	53.92	911,948.96	
	EOG RESOURCES INC	55,564	59.47	3,304,391.08	
	EXXON MOBIL	409,847	53.52	21,935,011.44	
	HALLIBURTON CO	97,620	15.43	1,506,276.60	
	HESS CORP	24,844	57.67	1,432,753.48	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	35.33	498,506.30	

KINDER MORGAN INC	194,644	17.29	3,365,394.76	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,097	40.41	2,509,339.77	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	15.69	583,071.78	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	85,461	23.18	1,980,985.98	
ONEOK INC	41,832	44.44	1,859,014.08	
PHILLIPS 66	42,441	85.67	3,635,920.47	
PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	108.53	1,719,549.32	
SCHLUMBERGER	132,260	22.51	2,977,172.60	
VALERO ENERGY CORP	39,247	71.27	2,797,133.69	
WILLIAMS COS	114,214	20.53	2,344,813.42	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	21,038	250.87	5,277,803.06	
ALBEMARLE CORP	10,180	85.00	865,300.00	
AMCOR PLC	153,458	10.20	1,565,271.60	
AVERY DENNISON CORP	7,457	122.42	912,885.94	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	24.25	426,945.50	
BALL CORP	32,534	72.44	2,356,762.96	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	97.00	1,072,141.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	31.93	608,937.03	
CORTEVA INC	70,180	29.59	2,076,626.20	
CROWN HOLDINGS INC	12,992	68.23	886,444.16	
DOW INC	70,834	44.41	3,145,737.94	
DUPONT DE NEMOURS INC	70,752	55.93	3,957,159.36	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	14,194	77.02	1,093,221.88	
ECOLAB INC	24,761	226.71	5,613,566.31	
FMC CORP	12,118	104.24	1,263,180.32	
FREEPORT-MCMORAN INC	138,927	11.27	1,565,707.29	
INT'L PAPER CO	33,803	38.31	1,294,992.93	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,795	134.57	1,183,543.15	
LINDE PLC	51,243	214.23	10,977,787.89	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	76.00	1,938,988.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	208.85	1,249,131.85	
MOSAIC CO/THE	31,911	14.75	470,687.25	
NEWMONT CORPORATION	78,251	57.17	4,473,609.67	
NUCOR CORP	29,015	44.25	1,283,913.75	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	107.85	958,786.50	
PPG INDUSTRIES INC	22,118	111.42	2,464,387.56	
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	79.22	984,704.60	
SEALED AIR CORP	14,689	33.78	496,194.42	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,930	581.77	4,613,436.10	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	29.36	536,495.28	
VULCAN MATERIALS CO	12,657	118.03	1,493,905.71	
WESTROCK CO	24,734	31.91	789,261.94	

3 M COMPANY	55,862	166.70	9,312,195.40	
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	37.89	429,293.70	
ALLEGION PLC	8,963	112.29	1,006,455.27	
AMETEK INC	22,247	94.79	2,108,793.13	
BOEING CO	51,941	216.74	11,257,692.34	
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	23.21	1,753,538.71	
CATERPILLAR	53,692	134.19	7,204,929.48	
CUMMINS INC	14,937	181.75	2,714,799.75	
DEERE&CO	29,071	164.81	4,791,191.51	
DOVER CORP	13,872	106.67	1,479,726.24	
EATON CORP	40,190	95.42	3,834,929.80	
EMERSON ELECTRIC CO	59,226	67.51	3,998,347.26	
FASTENAL CO	55,807	42.86	2,391,888.02	
FORTIVE CORP	28,503	69.58	1,983,238.74	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	63.33	811,257.30	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,906	163.48	3,908,152.88	
GENERAL ELECTRIC CO	848,526	8.02	6,805,178.52	
GRAINGER (WW) INC	4,461	326.34	1,455,802.74	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	37.85	576,304.10	
HEICO CORP	3,640	113.72	413,940.80	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	97.03	625,746.47	
HONEYWELL INTL INC	67,906	158.10	10,735,938.60	
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	16.22	592,841.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	197.76	696,510.72	
IDEX CORP	6,916	162.11	1,121,152.76	
ILLINOIS TOOL WORKS	31,233	178.03	5,560,410.99	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	33.09	1,044,386.58	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	88.59	1,065,383.34	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	46.00	924,600.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	23.13	474,165.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	75,045	35.74	2,682,108.30	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,485	208.28	4,474,895.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,699	233.14	862,384.86	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,659	408.56	10,074,681.04	
MASCO CORP	27,698	47.84	1,325,072.32	
NORDSON CORP	5,718	199.78	1,142,342.04	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,557	342.53	5,328,739.21	
OTIS WORLDWIDE CORP	40,997	60.65	2,486,468.05	
OWENS CORNING	10,458	58.47	611,479.26	
PACCAR INC	32,395	78.95	2,557,585.25	
PARKER HANNIFIN CORP	12,505	195.18	2,440,725.90	
PENTAIR PLC	18,123	40.37	731,625.51	

RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	147,006	70.54	10,369,803.24	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,244	220.04	2,474,129.76	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,116	402.13	4,067,947.08	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.84	578,563.52	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	49.27	598,433.42	
SNAP-ON INC	4,900	151.44	742,056.00	
STANLEY BLACK&DECKER	14,798	141.23	2,089,921.54	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	366.16	1,281,926.16	
TEXTRON	21,534	38.51	829,274.34	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,309	97.46	2,271,695.14	
TRANSDIGM GROUP INC	5,103	479.20	2,445,357.60	
UNITED RENTALS INC	7,713	158.25	1,220,582.25	
WABTEC CORP	17,764	69.12	1,227,847.68	
XYLEM INC	17,545	70.27	1,232,887.15	
CINTAS CORP	8,272	282.91	2,340,231.52	
COPART INC	19,784	89.10	1,762,754.40	
COSTAR GROUP INC	3,867	691.65	2,674,610.55	
EQUIFAX INC	11,791	175.03	2,063,778.73	
IHS MARKIT LTD	35,672	73.11	2,607,979.92	
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	16.66	580,584.34	
REPUBLIC SERVICES INC	21,742	87.82	1,909,382.44	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	57.81	553,010.46	
ROLLINS INC	14,566	43.50	633,621.00	
TRANSUNION	19,072	93.21	1,777,701.12	
VERISK ANALYTICS INC	14,560	169.33	2,465,444.80	
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	94.79	2,334,582.91	
WASTE MANAGEMENT INC	41,233	111.25	4,587,171.25	
AMERCO	1,179	340.13	401,013.27	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	83.09	1,095,624.74	
CSX CORP	75,667	73.66	5,573,631.22	
DELTA AIR LINES INC	15,095	34.17	515,796.15	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	78.18	1,240,560.24	
FEDEX CORP	24,100	144.69	3,487,029.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	119.81	996,699.39	
KANSAS CITY SOUTHERN	9,654	158.17	1,526,973.18	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	40.01	428,107.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,343	192.05	4,867,123.15	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,106	163.88	1,492,291.28	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	38.01	435,784.65	
UBER TECHNOLOGIES INC	93,775	36.59	3,431,227.25	
UNION PACIFIC CORP	65,930	178.16	11,746,088.80	
UNITED PARCEL SERVICE B	68,080	107.83	7,341,066.40	

XPO LOGISTICS INC	8,001	79.38	635,119.38	
APTIV PLC	24,462	75.91	1,856,910.42	
AUTOLIV INC	10,139	67.67	686,106.13	
BORGWARNER INC	19,890	36.65	728,968.50	
FORD MOTOR COMPANY	375,147	7.24	2,716,064.28	
GENERAL MOTORS CO	127,185	29.86	3,797,744.10	
LEAR CORP	5,287	121.48	642,264.76	
TESLA INC	14,369	940.67	13,516,487.23	
DR HORTON INC	32,171	55.53	1,786,455.63	
GARMIN LTD	14,696	98.13	1,442,118.48	
HASBRO INC	12,468	79.21	987,590.28	
LENNAR CORP-CL A	28,545	62.21	1,775,784.45	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,244	316.40	3,874,001.60	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	112.72	570,588.64	
NEWELL BRANDS INC	37,563	16.66	625,799.58	
NIKE B	121,020	102.63	12,420,282.60	
NVR INC	337	3,428.69	1,155,468.53	
PULTE GROUP INC	28,283	35.84	1,013,662.72	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	85.48	391,327.44	
VF CORP	32,491	64.45	2,094,044.95	
WHIRLPOOL CORP	6,079	137.01	832,883.79	
ARAMARK	24,034	30.11	723,663.74	
CARNIVAL CORPORATION	46,126	23.04	1,062,743.04	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,577	1,039.47	2,678,714.19	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,394	80.89	1,083,440.66	
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	382.22	1,422,240.62	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,760	86.13	2,390,968.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	53.66	1,776,146.00	
MARRIOTT INTL A	26,598	107.32	2,854,497.36	
MCDONALD'S CORP	72,055	199.52	14,376,413.60	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	18.44	325,687.28	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	49,467	22.06	1,091,242.02	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,686	69.91	1,306,338.26	
STARBUCKS CORP	113,355	82.37	9,337,051.35	
VAIL RESORTS INC	3,574	188.57	673,949.18	
WYNN RESORTS LTD	9,302	102.76	955,873.52	
YUM BRANDS INC	29,166	95.56	2,787,102.96	
ACTIVISION BLIZZARD INC	73,316	72.00	5,278,752.00	
ALPHABET INC-CL A	28,980	1,452.08	42,081,278.40	
ALPHABET INC-CL C	29,654	1,456.16	43,180,968.64	
ALTICE USA INC- A	35,374	25.83	913,710.42	
CABLE ONE INC	483	1,799.52	869,168.16	

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14,344	531.57	7,624,840.08	
COMCAST CORP-CL A	440,145	42.15	18,552,111.75	
DISCOVERY INC - A	12,804	23.88	305,759.52	
DISCOVERY INC-C	31,156	21.52	670,477.12	
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	35.28	850,353.84	
ELECTRONIC ARTS INC	27,876	121.07	3,374,947.32	
FACEBOOK INC-A	232,377	238.67	55,461,418.59	
FOX CORP - CLASS A	33,968	30.81	1,046,554.08	
FOX CORP- CLASS B	15,092	30.33	457,740.36	
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	281.67	2,202,941.07	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	19.24	650,966.16	
LIBERTY BROADBAND-A	3,021	130.11	393,062.31	
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	132.64	1,353,060.64	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	22.97	356,402.52	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,106	22.41	943,595.46	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	36.16	675,938.88	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	38.31	661,383.84	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	38.75	247,380.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	16,947	53.42	905,308.74	
MATCH GROUP INC	4,600	89.69	412,574.00	
NETFLIX INC	42,506	434.05	18,449,729.30	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	12.88	431,209.52	
OMNICOM GROUP	20,835	60.34	1,257,183.90	
PINTEREST INC- CLASS A	32,190	22.04	709,467.60	
ROKU INC	8,355	113.25	946,203.75	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	89,917	6.32	568,725.02	
SNAP INC - A	88,505	21.09	1,866,570.45	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	10,751	134.41	1,445,041.91	
THE WALT DISNEY CO	174,764	123.89	21,651,511.96	
TWITTER INC	77,631	35.92	2,788,505.52	
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	26.02	1,404,455.52	
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	61.19	756,797.92	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	144.21	892,083.06	
AMAZON.COM	40,989	2,600.86	106,606,650.54	
AUTOZONE INC	2,285	1,144.76	2,615,776.60	
BEST BUY COMPANY INC	22,720	81.62	1,854,406.40	
BOOKING HOLDINGS INC	4,000	1,777.97	7,111,880.00	
BURLINGTON STORES INC	6,766	212.63	1,438,654.58	
CARMAX INC	15,777	94.92	1,497,552.84	
DOLLAR GENERAL CORP	24,570	186.25	4,576,162.50	
DOLLAR TREE INC	22,651	92.58	2,097,029.58	
EBAY	78,761	49.75	3,918,359.75	

EXPEDIA GROUP INC	13,383	88.70	1,187,072.10	
GENUINE PARTS CO	13,937	91.66	1,277,465.42	
HOME DEPOT	105,894	256.76	27,189,343.44	
LKQ CORP	29,351	28.50	836,503.50	
LOWES COMPANIES	74,790	129.57	9,690,540.30	
MERCADOLIBRE INC	4,280	866.43	3,708,320.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,237	423.24	3,062,987.88	
ROSS STORES INC	34,327	101.59	3,487,279.93	
TARGET (DAYTON HUDSON)	48,428	120.72	5,846,228.16	
TIFFANY & CO	10,426	124.56	1,298,662.56	
TJX COMPANIES INC	115,530	56.24	6,497,407.20	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	122.44	1,372,797.28	
ULTA BEAUTY INC	5,362	244.68	1,311,974.16	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,854	305.55	13,094,039.70	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	5.00	169,500.00	
KROGER CO	76,549	32.92	2,519,993.08	
SYSCO CORP	45,437	61.39	2,789,377.43	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,429	45.28	3,279,585.12	
WALMART INC	137,434	121.35	16,677,615.90	
ALTRIA GROUP INC	178,226	42.18	7,517,572.68	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	42.38	2,211,769.82	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	69.14	2,005,751.40	
BUNGE LIMITED	13,606	42.91	583,833.46	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	49.53	785,991.57	
COCA-COLA CO	394,752	49.00	19,342,848.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	22,612	41.51	938,624.12	
CONAGRA BRANDS INC	45,992	33.57	1,543,951.44	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,999	183.40	2,934,216.60	
GENERAL MILLS INC	57,694	62.82	3,624,337.08	
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	133.34	1,852,892.64	
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.98	1,302,992.86	
INGREDION INC	5,835	89.39	521,590.65	
JM SMUCKER CO	10,802	108.43	1,171,260.86	
KELLOGG CO	24,092	66.20	1,594,890.40	
KEURIG DR PEPPER INC	36,671	28.33	1,038,889.43	
KRAFT HEINZ CO/THE	64,187	33.10	2,124,589.70	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	71.90	929,235.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,808	171.10	2,020,348.80	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	41.75	759,975.25	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	137,361	52.95	7,273,264.95	
MONSTER BEVERAGE CORP	39,969	70.43	2,815,016.67	
PEPSICO INC	134,605	132.97	17,898,426.85	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	151,108	75.65	11,431,320.20	
TYSON FOODS INC	28,214	66.77	1,883,848.78	
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	74.93	1,757,408.22	
CLOROX COMPANY	11,988	202.07	2,422,415.16	
COLGATE-PALMOLIVE CO	77,689	73.28	5,693,049.92	
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,244	200.72	4,264,095.68	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,715	138.58	4,533,644.70	
PROCTER & GAMBLE CO	237,820	118.34	28,143,618.80	
ABBOTT LABORATORIES	170,927	90.27	15,429,580.29	
ABIOMED INC	4,421	245.62	1,085,886.02	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	279.71	1,989,577.23	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	99.90	1,458,939.60	
ANTHEM INC	24,196	291.01	7,041,277.96	
BAXTER INTERNATIONAL	50,112	87.01	4,360,245.12	
BECTON DICKINSON & CO	25,805	237.28	6,123,010.40	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	133,021	38.26	5,089,383.46	
CARDINAL HEALTH	27,968	57.65	1,612,355.20	
CENTENE CORP	55,738	65.67	3,660,314.46	
CERNER CORP	30,009	71.88	2,157,046.92	
CIGNA CORP	35,629	214.50	7,642,420.50	
CVS HEALTH CORP	126,942	69.37	8,805,966.54	
DANAHER CORP	60,909	169.45	10,321,030.05	
DAVITA INC	9,056	84.50	765,232.00	
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	48.51	979,319.88	
DEXCOM INC	9,029	380.50	3,435,534.50	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	59,721	74.96	4,476,686.16	
HCA HEALTHCARE INC	25,918	116.00	3,006,488.00	
HENRY SCHEIN INC	14,096	61.16	862,111.36	
HOLOGIC INC	24,459	52.75	1,290,212.25	
HUMANA INC	12,640	390.18	4,931,875.20	
IDEXX LABORATORIES INC	8,195	303.00	2,483,085.00	
INSULET CORP	5,923	181.87	1,077,216.01	
INTUITIVE SURGICAL INC	11,319	584.52	6,616,181.88	
LABORATORY CRP OF AMER	9,814	178.94	1,756,117.16	
MASIMO CORP	5,273	215.78	1,137,807.94	
MCKESSON CORP	15,443	161.19	2,489,257.17	
MEDTRONIC PLC	130,093	99.11	12,893,517.23	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,271	175.09	1,097,989.39	
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	116.74	1,505,245.56	
RESMED INC	13,491	161.49	2,178,661.59	
STERIS PLC	8,111	161.56	1,310,413.16	
STRYKER CORP	32,154	200.70	6,453,307.80	

TELADOC HEALTH INC	7,237	168.83	1,221,822.71	
TELEFLEX INC	4,427	367.18	1,625,505.86	
THE COOPER COS INC	4,688	303.23	1,421,542.24	
UNITEDHEALTH GROUP INC	91,750	309.21	28,370,017.50	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	109.22	791,626.56	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	127.64	1,051,370.68	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	213.55	2,632,003.75	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,079	206.29	1,460,326.91	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,652	134.14	2,636,119.28	
ABBVIE INC	171,182	96.17	16,462,572.94	
AGILENT TECHNOLOGIES	29,560	89.77	2,653,601.20	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	115.99	2,404,008.74	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	129.79	1,384,210.35	
AMGEN	56,674	224.90	12,745,982.60	
AVANTOR INC	45,734	17.85	816,351.90	
BEIGENE LTD-ADR	3,859	172.63	666,179.17	
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	459.94	984,731.54	
BIOGEN INC	16,218	293.74	4,763,875.32	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	105.09	1,804,500.39	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	214,587	60.93	13,074,785.91	
CATALENT INC	16,026	74.83	1,199,225.58	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	24.10	869,070.10	
EXACT SCIENCES CORP	13,278	91.36	1,213,078.08	
GILEAD SCIENCES INC	122,900	77.59	9,535,811.00	
ILLUMINA INC	14,031	357.78	5,020,011.18	
INCYTE CORP	17,504	93.00	1,627,872.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	58.48	749,538.16	
IQVIA HOLDINGS INC	19,114	146.80	2,805,935.20	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	113.05	561,971.55	
JOHNSON & JOHNSON	254,657	145.96	37,169,735.72	
LILLY (ELI) & CO	83,527	149.13	12,456,381.51	
MERCK & CO	245,605	82.26	20,203,467.30	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	815.48	1,843,800.28	
MODERNA INC	27,534	58.23	1,603,304.82	
MYLAN NV	49,481	18.45	912,924.45	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	118.82	1,006,880.68	
PERKINELMER INC	10,645	102.44	1,090,473.80	
PERRIGO CO PLC	14,477	55.96	810,132.92	
PFIZER	535,793	36.21	19,401,064.53	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,927	608.59	6,041,472.93	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	155.65	1,112,430.55	
SEATTLE GENETICS INC	11,471	148.94	1,708,490.74	

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	12.63	1,370,152.92	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,248	347.65	13,296,917.20	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,286	270.85	6,848,713.10	
WATERS CORP	6,363	197.38	1,255,928.94	
ZOETIS INC	45,448	138.80	6,308,182.40	
BANK OF AMERICA CORP	760,804	28.22	21,469,888.88	
CITIGROUP	204,726	59.50	12,181,197.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	29.51	1,180,695.10	
COMERICA INC	14,360	45.71	656,395.60	
EAST WEST BANCORP INC	13,827	42.20	583,499.40	
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	24.08	1,636,019.28	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	115.64	1,835,438.08	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	11.00	1,089,132.00	
JPMORGAN CHASE & CO	297,288	110.54	32,862,215.52	
KEY CORP	94,322	14.79	1,395,022.38	
M & T BANK CORP	13,267	123.89	1,643,648.63	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	13.51	496,270.80	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,823	126.19	5,277,644.37	
REGIONS FINL CORP	92,434	13.46	1,244,161.64	
SIGNATURE BANK	5,223	117.10	611,613.30	
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	234.31	1,158,194.33	
TRUIST FINANCIAL CORP	128,020	44.68	5,719,933.60	
US BANCORP	134,236	42.10	5,651,335.60	
WELLS FARGO & CO	378,515	32.63	12,350,944.45	
ZIONS BANCORPORATION	15,186	39.30	596,885.73	
ALLY FINANCIAL INC	36,028	22.92	825,761.76	
AMERICAN EXPRESS	66,370	110.46	7,331,230.20	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	159.59	1,891,141.50	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	18,264	52.07	951,006.48	
BANK NEW YORK CO	79,248	41.42	3,282,452.16	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	134,103	196.07	26,293,575.21	
BLACKROCK INC	14,548	558.06	8,118,656.88	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	66,290	58.35	3,868,021.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44,494	78.47	3,491,444.18	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,087	29.95	481,805.65	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	103.05	1,093,566.60	
CME GROUP INC	34,191	191.10	6,533,900.10	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,078	58.85	1,711,240.30	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	51.97	1,096,982.76	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	22.12	889,555.80	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	304.90	1,107,701.70	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	23.65	616,555.50	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,053	218.10	6,990,759.30	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53,142	97.44	5,178,156.48	
INVESCO LTD	30,943	11.14	344,705.02	
KKR & CO INC	47,403	31.55	1,495,564.65	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	499.93	1,796,248.49	
MOODY'S CORP	16,220	274.98	4,460,175.60	
MORGAN STANLEY	115,860	50.40	5,839,344.00	
MSCI INC	8,407	327.16	2,750,434.12	
NASDAQ INC	10,979	120.09	1,318,468.11	
NORTHERN TRUST CORP	19,520	91.99	1,795,644.80	
PRICE T ROWE GROUP INC	23,384	128.64	3,008,117.76	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	81.66	977,306.88	
S&P GLOBAL INC	23,319	327.61	7,639,537.59	
SCHWAB (CHARLES) CORP	110,150	40.18	4,425,827.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	59.88	734,188.68	
STATE STREET CORP	34,742	70.48	2,448,616.16	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	25.86	1,373,036.70	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	43.33	1,121,250.41	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	65.01	589,055.61	
VOYA FINANCIAL INC	12,505	51.41	642,882.05	
AFLAC	68,601	40.20	2,757,760.20	
ALLEGHANY CORP	1,276	561.88	716,958.88	
ALLSTATE CORP	30,932	103.21	3,192,491.72	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	71.44	501,008.72	
AMERICAN INT'L GROUP	83,130	37.74	3,137,326.20	
AON PLC	22,349	194.29	4,342,187.21	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	34.38	1,333,806.48	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	101.15	1,803,807.95	
ASSURANT INC	5,819	116.70	679,077.30	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	35.57	474,752.79	
BROWN & BROWN INC	22,945	43.05	987,782.25	
CHUBB LTD	43,249	137.69	5,954,954.81	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	68.81	1,021,897.31	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	186.42	403,785.72	
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	227.46	893,007.96	
FNF GROUP	24,961	35.08	875,631.88	
GLOBE LIFE INC	9,867	85.01	838,793.67	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	44.98	1,550,955.38	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	47.21	839,865.90	
LOEWS CORP	25,707	38.26	983,549.82	
MARKEL CORP	1,312	1,031.90	1,353,852.80	
MARSH & MCLENNAN COS	48,167	110.44	5,319,563.48	

METLIFE INC	74,667	41.55	3,102,413.85	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	47.27	1,258,091.05	
PROGRESSIVE CORP	55,794	81.02	4,520,429.88	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,690	71.76	2,704,634.40	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	98.14	532,998.34	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,122	189.14	968,775.08	
TRAVELERS COS INC/THE	24,049	125.42	3,016,225.58	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	201.01	2,415,336.16	
WR BERKLEY CORP	14,085	62.99	887,214.15	
CBRE GROUP INC-A	33,971	53.33	1,811,673.43	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.39	433,293.00	
JONES LANG LASALLE INC	4,484	120.32	539,514.88	
WEYERHAEUSER CO	69,607	23.75	1,653,166.25	
ACCENTURE PLC-CL A	61,633	207.34	12,778,986.22	
ADOBE INC	46,703	397.16	18,548,563.48	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	15,447	102.73	1,586,870.31	
ANSYS INC	8,044	285.27	2,294,711.88	
AUTODESK INC	20,964	234.15	4,908,720.60	
AUTOMATIC DATA PROCESS	41,287	157.69	6,510,547.03	
AVALARA INC	7,873	100.90	794,385.70	
BLACK KNIGHT INC	14,413	76.15	1,097,549.95	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	79.99	1,074,905.62	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	123.51	1,355,028.21	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,369	92.56	2,440,714.64	
CDK GLOBAL INC	10,687	46.37	495,556.19	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	11,974	110.76	1,326,240.24	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	140.22	1,464,457.68	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	52,296	57.19	2,990,808.24	
COUPA SOFTWARE INC	6,767	224.59	1,519,800.53	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,909	93.90	1,024,355.10	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	103.83	321,873.00	
DATADOG INC - CLASS A	11,204	73.74	826,182.96	
DOCUSIGN INC	17,017	141.92	2,415,052.64	
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	21.93	531,078.81	
DYNATRACE INC	14,169	37.96	537,855.24	
EPAM SYSTEMS INC	5,266	235.00	1,237,510.00	
FAIR ISAAC CORP	3,001	419.51	1,258,949.51	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	59,991	141.37	8,480,927.67	
FISERV INC	55,147	107.39	5,922,236.33	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,052	276.61	2,227,263.72	
FORTINET INC	13,898	135.92	1,889,016.16	
GARTNER INC	8,569	131.24	1,124,595.56	

GLOBAL PAYMENTS INC	28,687	185.45	5,320,004.15	
GODADDY INC - CLASS A	16,351	79.63	1,302,030.13	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	107.44	851,247.12	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	86,303	131.87	11,380,776.61	
INTUIT INC	24,837	291.25	7,233,776.25	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	178.86	1,316,409.60	
LEIDOS HOLDINGS	12,829	105.69	1,355,897.01	
MASTERCARD INC-CLASS A	86,561	311.49	26,962,885.89	
MICROSOFT CORP	697,405	189.80	132,367,469.00	
MONGODB INC	4,623	201.70	932,459.10	
NORTONLIFELOCK INC	59,628	21.14	1,260,535.92	
OKTA INC	11,337	180.07	2,041,453.59	
ORACLE CORP	214,169	54.18	11,603,676.42	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,363	233.56	2,186,822.28	
PAYCHEX INC	30,214	77.83	2,351,555.62	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	327.60	1,557,738.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	107,989	156.86	16,939,154.54	
PTC INC	9,984	81.54	814,095.36	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,050	258.43	1,821,931.50	
SALESFORCE.COM INC	81,701	174.56	14,261,726.56	
SERVICENOW INC	18,502	388.83	7,194,132.66	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	31,963	31.32	1,001,081.16	
SPLUNK INC	14,752	183.93	2,713,335.36	
SQUARE INC - A	33,186	89.53	2,971,142.58	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	59.75	1,301,165.12	
SYNOPSYS INC	14,359	189.62	2,722,753.58	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	4,189	362.98	1,520,523.22	
TWILIO INC - A	11,282	194.27	2,191,754.14	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	355.61	1,320,379.93	
VERISIGN INC	10,096	213.43	2,154,789.28	
VISA INC-CLASS A SHARES	164,946	199.08	32,837,449.68	
VMWARE INC-CLASS A	7,867	146.41	1,151,807.47	
WESTERN UNION CO	38,757	24.39	945,283.23	
WIX.COM LTD	5,010	215.87	1,081,508.70	
WORKDAY INC-CLASS A	15,669	179.76	2,816,659.44	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,902	205.43	2,239,597.86	
AMPHENOL CORPORATION	29,541	101.72	3,004,910.52	
APPLE INC	421,686	343.99	145,055,767.14	
ARISTA NETWORKS INC	5,865	231.40	1,357,161.00	
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	74.42	583,378.38	
CDW CORP/DE	13,742	124.41	1,709,642.22	
CISCO SYSTEMS	410,724	48.05	19,735,288.20	

COGNEX CORP	16,230	57.45	932,413.50	
CORNING	72,399	27.63	2,000,384.37	
DELL TECHNOLOGIES -C	24,973	50.03	1,249,399.19	
F5 NETWORKS INC	5,350	143.92	769,972.00	
FLIR SYSTEMS INC	11,686	45.58	532,647.88	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	11.02	1,364,044.58	
HP INC	141,556	17.50	2,477,230.00	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	165.59	531,047.13	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	24.93	780,408.72	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	103.11	1,817,210.64	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,366	151.77	2,483,867.82	
NETAPP INC	20,586	46.72	961,777.92	
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	54.83	1,252,097.88	
TE CONNECTIVITY LTD	31,955	87.08	2,782,641.40	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	43.92	1,049,104.70	
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	47.83	1,360,954.82	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	270.32	1,395,391.84	
AT&T INC	696,675	32.62	22,725,538.50	
CENTURYLINK INC	93,962	11.01	1,034,521.62	
T-MOBILE US INC	41,028	103.19	4,233,679.32	
VERIZON COMMUNICATIONS	400,307	57.86	23,161,763.02	
AES CORP	61,761	13.84	854,772.24	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	50.77	1,226,400.12	
AMEREN CORPORATION	23,120	75.27	1,740,242.40	
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,150	85.91	4,050,656.50	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	130.70	2,211,705.40	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	104.32	1,191,230.08	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	18.63	897,258.06	
CMS ENERGY CORP	26,742	60.29	1,612,275.18	
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	76.70	2,434,841.50	
DOMINION ENERGY INC	81,747	85.85	7,017,979.95	
DTE ENERGY COMPANY	18,360	115.00	2,111,400.00	
DUKE ENERGY CORP	69,920	90.32	6,315,174.40	
EDISON INTL	33,630	61.63	2,072,616.90	
ENTERGY CORP	18,696	103.34	1,932,044.64	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	46.06	959,614.04	
EVERGY INC	21,330	63.57	1,355,948.10	
EVERSOURCE ENERGY	30,920	85.27	2,636,548.40	
EXELON CORP	92,804	40.51	3,759,490.04	
FIRSTENERGY CORP	50,559	42.89	2,168,475.51	
NEXTERA ENERGY INC	47,481	258.67	12,281,910.27	
NISOURCE INC	35,781	24.83	888,442.23	

	NRG ENERGY INC	23,078	36.40	840,039.20	
	OGE ENERGY CORP	19,225	33.53	644,614.25	
	PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	80.11	862,944.92	
	PPL CORPORATION	76,873	28.37	2,180,887.01	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	53.67	2,538,054.30	
	SEMPRA ENERGY	28,783	130.31	3,750,712.73	
	SOUTHERN CO	103,042	59.36	6,116,573.12	
	UGI CORP	18,019	35.70	643,278.30	
	VISTRA ENERGY CORP	46,057	21.17	975,026.69	
	WEC ENERGY GROUP INC	30,120	93.44	2,814,412.80	
	XCEL ENERGY INC	50,065	66.37	3,322,814.05	
	ADVANCED MICRO DEVICES	114,214	56.39	6,440,527.46	
	ANALOG DEVICES	35,161	123.38	4,338,339.98	
	APPLIED MATERIALS	88,168	59.79	5,271,564.72	
	BROADCOM INC	38,794	315.32	12,232,524.08	
	INTEL CORP	410,346	63.04	25,868,211.84	
	KLA CORP	15,075	191.03	2,879,777.25	
	LAM RESEARCH CORP	13,850	302.33	4,187,270.50	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	67,125	35.17	2,360,786.25	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,878	60.66	1,569,759.48	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	105.73	2,415,296.12	
	MICRON TECHNOLOGY	105,648	53.15	5,615,191.20	
	NVIDIA CORP	59,246	361.84	21,437,572.64	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,067	111.51	3,018,241.17	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	20.17	726,039.32	
	QORVO INC	10,609	115.53	1,225,657.77	
	QUALCOMM	111,205	89.75	9,980,648.75	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,107	134.51	2,166,552.57	
	TERADYNE INC	16,048	74.86	1,201,433.52	
	TEXAS INSTRUMENTS	90,730	132.12	11,987,247.60	
	XILINX INC	23,543	95.83	2,256,125.69	
アメリカドル 小計		28,431,520		2,647,742,505.45 (285,400,164,662)	
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	14.40	591,292.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	122,328	28.44	3,479,008.32	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	7.19	695,028.54	
	ENBRIDGE	193,997	44.26	8,586,307.22	
	IMPERIAL OIL	24,763	25.67	635,666.21	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	13.93	493,888.15	
	KEYERA CORP	18,607	22.73	422,937.11	
	PARKLAND CORP	17,004	37.02	629,488.08	
	PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	37.10	1,996,573.60	

SUNCOR ENERGY	147,329	27.61	4,067,753.69	
TC ENERGY CORP	92,266	62.58	5,774,006.28	
AGNICO EAGLE MINES	23,423	78.86	1,847,137.78	
B2GOLD CORP	114,473	6.97	797,876.81	
BARRICK GOLD CORP	170,934	32.64	5,579,285.76	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	47.26	620,949.14	
FRANCO-NEVADA CORP	18,244	173.46	3,164,604.24	
KINROSS GOLD CORP	125,340	8.36	1,047,842.40	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,848	50.98	1,368,711.04	
LUNDIN MINING CORP	62,243	6.91	430,099.13	
NUTRIEN LTD	55,504	51.33	2,849,020.32	
PAN AMERICAN SILVER CORP	23,098	36.22	836,609.56	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	15.85	723,980.45	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	45,525	51.20	2,330,880.00	
YAMANA GOLD INC	106,274	6.88	731,165.12	
CAE INC	25,999	26.97	701,193.03	
WSP GLOBAL INC	9,471	86.78	821,893.38	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	12,370	57.39	709,914.30	
THOMSON REUTERS CORP	18,789	92.88	1,745,122.32	
AIR CANADA	11,591	21.01	243,526.91	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69,824	123.00	8,588,352.00	
CP RAILWAY LIMITED	13,160	353.75	4,655,350.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	62.95	1,761,215.10	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	22.92	404,744.28	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	28,808	79.64	2,294,269.12	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.98	455,696.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	23.81	1,073,521.47	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	125.29	677,693.61	
DOLLARAMA INC	26,700	46.84	1,250,628.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	84,121	41.36	3,479,244.56	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	30.09	458,962.77	
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	65.99	1,181,682.93	
METRO INC	24,937	55.80	1,391,484.60	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	95.94	660,355.02	
SAPUTO INC	24,489	32.90	805,688.10	
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	26.67	741,426.00	
CANOPY GROWTH CORP	25,606	23.71	607,118.26	
CRONOS GROUP INC	15,900	10.07	160,113.00	
BANK MONTREAL	61,534	77.29	4,755,962.86	
BANK NOVA SCOTIA	116,919	60.67	7,093,475.73	
CANADIAN IMPERIAL BANK	42,951	98.72	4,240,122.72	
NATIONAL BANK OF CANADA	33,228	64.14	2,131,243.92	

	ROYAL BANK OF CANADA	137,232	94.64	12,987,636.48	
	TORONTO-DOMINION BANK	173,449	64.90	11,256,840.10	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	126,501	49.94	6,317,459.94	
	CI FINANCIAL CORP	18,671	18.03	336,638.13	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	35.05	269,359.25	
	ONEX CORP	6,603	67.28	444,249.84	
	TMX GROUP LTD	6,205	129.31	802,368.55	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	425.09	1,132,014.67	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	25.57	608,259.16	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	49.14	404,422.20	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	133.15	1,736,675.45	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	190,115	19.93	3,788,991.95	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	26.17	1,349,089.67	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	56,979	51.65	2,942,965.35	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.52	296,288.00	
	CGI INC - CL A	23,396	91.27	2,135,352.92	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,978	1,501.70	2,970,362.60	
	OPEN TEXT CORP	24,643	57.90	1,426,829.70	
	SHOPIFY INC - CLASS A	10,178	992.92	10,105,939.76	
	BCE INC	15,355	59.22	909,323.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	58.94	2,063,960.92	
	TELUS CORP	32,908	24.26	798,348.08	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.19	994,387.42	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	16.34	398,614.30	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.33	206,128.53	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.34	344,202.16	
	EMERA INC	23,704	54.52	1,292,342.08	
	FORTIS INC	42,633	52.99	2,259,122.67	
	HYDRO ONE LTD	32,299	25.87	835,575.13	
カナダドル 小計		3,695,593		174,203,859.85 (14,000,764,216)	
ユーロ	ENI	248,488	9.37	2,329,823.48	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	11.48	564,993.09	
	NESTE OIL OYJ	40,117	36.31	1,456,648.27	
	OMV AG	14,984	34.00	509,456.00	
	REPSOL SA	133,012	9.23	1,228,498.83	
	TENARIS SA	40,648	6.77	275,349.55	
	TOTAL SA	240,444	37.70	9,064,738.80	
	VOPAK	6,360	48.61	309,159.60	
	AIR LIQUIDE	45,301	126.20	5,716,986.20	
	AKZO NOBEL	19,521	78.28	1,528,103.88	
	ARCELORMITTAL	66,229	10.03	664,806.70	

ARKEMA	7,535	85.14	641,529.90	
BASF SE	88,020	56.23	4,949,364.60	
COVESTRO AG	15,098	35.41	534,620.18	
CRH PLC	80,003	31.76	2,540,895.28	
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	24.57	485,355.78	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	37.44	215,729.28	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	49.62	736,013.46	
KONINKLIJKE DSM NV	17,129	116.15	1,989,533.35	
LANXESS	7,293	49.00	357,357.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	28.62	559,950.30	
SOLVAY SA	6,906	77.00	531,762.00	
STORA ENSO OYJ R	54,792	11.13	609,834.96	
SYMRISE AG	12,476	95.36	1,189,711.36	
THYSSEN KRUPP	33,044	7.31	241,749.90	
UMICORE	17,605	43.07	758,247.35	
UPM KYMMENE OYJ	50,623	27.04	1,368,845.92	
VOESTALPINE AG	12,422	20.42	253,657.24	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,018	25.81	568,284.58	
AIRBUS SE	56,107	75.67	4,245,616.69	
ALSTOM	18,760	42.67	800,489.20	
ANDRITZ AG	5,242	35.20	184,518.40	
BOUYGUES ORD	19,381	29.40	569,801.40	
BRENNTAG AG	15,254	48.73	743,327.42	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	7.09	659,926.44	
DASSAULT AVIATION SA	213	932.50	198,622.50	
EIFFAGE	7,209	84.74	610,890.66	
FERROVIAL SA	46,063	25.82	1,189,346.66	
FERROVIAL SA-RTS	46,063	0.33	15,348.19	
GEA GROUP AG	13,382	29.16	390,219.12	
HOCHTIEF AG	2,222	84.30	187,314.60	
KINGSPAN GROUP PLC	15,306	56.80	869,380.80	
KION GROUP AG	5,887	54.92	323,314.04	
KNORR-BREMSE AG	4,123	97.56	402,239.88	
KONE OYJ-B	32,286	61.48	1,984,943.28	
LEGRAND SA	24,584	64.56	1,587,143.04	
LEONARDO SPA	35,425	6.84	242,519.55	
METSO OYJ	9,561	32.13	307,194.93	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	168.45	800,642.85	
PRYSMIAN SPA	21,155	20.45	432,619.75	
SAFRAN SA	31,568	97.18	3,067,778.24	
SAINT-GOBAIN	52,323	31.99	1,673,812.77	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,023	95.16	5,045,668.68	

SIEMENS	73,180	106.94	7,825,869.20	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	15.65	392,846.30	
THALES SA	9,665	76.32	737,632.80	
VINCI S.A.	49,409	87.34	4,315,382.06	
WARTSILA OYJ	34,386	8.00	275,225.54	
BUREAU VERITAS SA	25,073	20.04	502,462.92	
RANDSTAD NV	12,365	41.90	518,093.50	
TELEPERFORMANCE	5,732	216.40	1,240,404.80	
WOLTERS KLUWER	25,709	67.50	1,735,357.50	
ADP	2,382	111.00	264,402.00	
AENA SME SA	6,542	135.30	885,132.60	
ATLANTIA SPA	51,427	15.40	791,975.80	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	11.85	275,773.20	
DEUTSCHE POST AG-REG	97,787	31.21	3,051,932.27	
FRAPORT AG	3,561	48.38	172,281.18	
GETLINK	44,101	13.86	611,239.86	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,973	59.41	1,899,515.93	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	46.42	231,682.22	
CONTINENTAL AG	9,928	94.92	942,365.76	
DAIMLER AG	84,616	38.96	3,297,062.44	
FAURECIA	5,945	36.39	216,338.55	
FERRARI NV	12,609	153.35	1,933,590.15	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	111,379	8.99	1,001,742.72	
MICHELIN	16,459	97.52	1,605,081.68	
PEUGEOT SA	52,883	14.75	780,024.25	
PIRELLI & C SPA	39,097	4.24	165,771.28	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	53.56	751,339.68	
RENAULT SA	17,362	25.50	442,731.00	
VALEO SA	19,350	23.87	461,884.50	
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,999	145.56	2,619,934.44	
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	156.40	508,456.40	
ADIDAS AG	18,659	251.30	4,689,006.70	
ESSILORLUXOTTICA	27,287	121.35	3,311,277.45	
HERMES INTERNATIONAL	3,057	765.00	2,338,605.00	
KERING	7,275	525.00	3,819,375.00	
LVMH	26,977	395.30	10,664,008.10	
MONCLER SPA	20,700	34.16	707,112.00	
PUMA SE	7,720	67.94	524,496.80	
SEB SA	2,075	125.30	259,997.50	
ACCOR	17,931	28.04	502,785.24	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,262	119.90	870,713.80	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,540	31.51	332,115.40	

SODEXO	8,135	68.86	560,176.10	
ALTICE NV -A	50,000	3.93	196,650.00	
BOLLORE	61,805	3.01	186,156.66	
JC DECAUX SA	9,522	20.58	195,962.76	
PUBLICIS GROUPE	21,469	31.56	677,561.64	
SCOUT24 AG	11,366	69.00	784,254.00	
SES	31,369	7.38	231,565.95	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	39.78	198,820.44	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	67.08	624,581.88	
VIVENDI	77,307	22.86	1,767,238.02	
DELIVERY HERO SE	11,471	84.80	972,740.80	
INDITEX	101,980	25.68	2,618,846.40	
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	98.60	1,121,279.20	
PROSUS	47,869	75.94	3,635,171.86	
ZALANDO SE	13,985	64.84	906,787.40	
CARREFOUR	59,235	14.45	856,241.92	
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,810	35.18	204,395.80	
COLRUYT SA	5,424	52.68	285,736.32	
JERONIMO MARTINS	24,901	15.35	382,230.35	
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	23.64	2,441,160.96	
METRO AG	13,712	9.21	126,314.94	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,855	48.88	3,561,152.40	
DANONE (GROUPE)	59,282	64.02	3,795,233.64	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	64,414	7.39	476,148.28	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	77.65	830,932.65	
HEINEKEN NV	24,387	85.84	2,093,380.08	
KERRY GROUP PLC-A	14,641	107.90	1,579,763.90	
PERNOD-RICARD	20,967	146.70	3,075,858.90	
REMY COINTREAU	2,382	115.70	275,597.40	
BEIERSDORF AG	9,190	99.96	918,632.40	
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	77.05	785,139.50	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,238	83.86	1,445,578.68	
LOREAL	24,042	266.00	6,395,172.00	
UNILEVER NV	140,583	46.85	6,586,313.55	
BIOMERIEUX	4,175	113.90	475,532.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	89.35	306,470.50	
DIASORIN SPA	2,770	161.50	447,355.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	76.86	1,536,047.10	
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,407	44.07	1,780,736.49	
KONINKLIJKE PHILIPS	87,231	41.64	3,632,734.99	
ORPEA	5,633	104.75	590,056.75	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	277.40	900,440.40	

SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,846	43.28	642,534.88	
BAYER	94,130	67.26	6,331,183.80	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	590.00	683,220.00	
GALAPAGOS NV	4,368	180.75	789,516.00	
GRIFOLS SA	27,685	28.01	775,456.85	
IPSEN	2,722	76.30	207,688.60	
MERCK KGAA	12,078	106.15	1,282,079.70	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	43.39	427,565.06	
QIAGEN N.V.	21,801	38.90	848,058.90	
RECORDATI SPA	11,472	41.48	475,858.56	
SANOFI	109,629	90.46	9,917,039.34	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	211.60	635,646.40	
UCB (GROUPE)	12,416	89.38	1,109,742.08	
ABN AMRO BANK NV-CVA	53,189	8.56	455,616.97	
BANCO BILBAO VIZCAYA	647,435	3.40	2,206,458.48	
BANCO SANTANDER SA	1,599,817	2.50	4,000,342.40	
BANKINTER SA	58,881	4.64	273,266.72	
BNP PARIBAS	110,192	38.16	4,204,926.72	
CAIXABANK	328,697	1.96	644,246.12	
COMMERZBANK AG	80,494	4.40	354,254.09	
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	8.69	934,068.39	
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	24.16	665,849.60	
FINECOBANK SPA	53,120	11.28	599,459.20	
ING GROEP NV-CVA	377,830	6.98	2,637,253.40	
INTESA SANPAOLO	1,460,677	1.72	2,512,364.44	
KBC GROEP NV	24,002	53.60	1,286,507.20	
MEDIOBANCA	53,990	7.09	383,005.06	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	18.14	226,568.60	
SOCIETE GENERALE	79,076	16.46	1,302,223.56	
UNICREDIT SPA	214,165	8.92	1,911,422.62	
AMUNDI SA	6,226	69.90	435,197.40	
DEUTSCHE BANK NAMEN	190,535	8.62	1,643,173.84	
DEUTSCHE BOERSE	18,261	153.70	2,806,715.70	
EURAZEO SA	3,357	49.22	165,231.54	
EXOR NV	10,345	54.04	559,043.80	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,222	78.66	646,742.52	
NATIXIS	69,996	2.47	173,170.10	
SOFINA	1,781	234.00	416,754.00	
WENDEL	2,023	90.25	182,575.75	
AEGON	166,267	2.93	487,162.31	
AGEAS	16,065	35.38	568,379.70	
ALLIANZ SE-REG	39,899	187.42	7,477,870.58	

ASSICURAZIONI GENERALI	109,307	14.26	1,559,264.35	
AXA	185,927	19.40	3,608,099.36	
CNP ASSURANCES	11,830	12.01	142,078.30	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	160.70	930,292.30	
MAPFRE SA	90,939	1.81	165,327.10	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,866	236.40	3,277,922.40	
NN GROUP NV	27,631	31.10	859,324.10	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.67	399,399.66	
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	32.09	1,382,276.75	
SCOR SE	13,354	26.40	352,545.60	
AROUNDTOWN SA	111,346	5.70	634,672.20	
DEUTSCHE WOHNEN SE	33,768	39.86	1,345,992.48	
LEG IMMOBILIEN AG	7,281	116.94	851,440.14	
VONOVIA SE	49,525	53.04	2,626,806.00	
ADYEN NV	1,802	1,147.50	2,067,795.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	52.54	2,200,585.36	
ATOS SE	9,750	71.32	695,370.00	
CAPGEMINI SA	15,470	97.06	1,501,518.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	153.15	1,916,672.25	
EDENRED	22,756	41.68	948,470.08	
NEMETSCHEK SE	6,575	61.60	405,020.00	
NEXI SPA	36,670	14.60	535,382.00	
SAP SE	101,332	120.68	12,228,745.76	
TEAMVIEWER AG	14,027	44.01	617,398.40	
WIRECARD AG	11,369	94.82	1,078,008.58	
WORLDLINE SA	12,702	67.60	858,655.20	
INGENICO GROUP	6,281	127.45	800,513.45	
NOKIA OYJ	545,632	3.89	2,127,691.98	
CELLNEX TELECOM SA	24,602	48.16	1,184,832.32	
DEUTSCHE TELEKOM	319,355	15.19	4,851,002.45	
ELISA A	15,574	53.80	837,881.20	
ILIAD SA	1,253	162.65	203,800.45	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.06	275,197.50	
KPN (KON.)	354,332	2.30	815,672.26	
ORANGE	188,105	11.03	2,075,738.67	
PROXIMUS	13,141	20.39	267,944.99	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.36	314,250.66	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.39	183,592.40	
TELEFONICA	438,199	4.86	2,129,647.14	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	125,107	2.78	347,922.56	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	35.93	341,802.09	
E.ON SE	216,142	10.25	2,215,455.50	

	ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	8.59	527,098.12	
	ELIA GROUP SA/NV	3,630	96.30	349,569.00	
	ENAGAS	25,299	21.89	553,795.11	
	ENDESA	31,750	22.31	708,342.50	
	ENEL	784,622	7.54	5,917,619.12	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	4.19	990,362.77	
	ENGIE	171,054	11.86	2,028,700.44	
	FORTUM OYJ	41,901	17.47	732,010.47	
	IBERDROLA SA	567,531	10.15	5,760,439.65	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	17.55	529,897.67	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	16.70	661,854.40	
	RWE STAMM	56,470	29.81	1,683,370.70	
	SNAM SPA	203,694	4.48	914,382.36	
	SUEZ	28,043	10.89	305,528.48	
	TERNA SPA	130,230	6.18	805,342.32	
	UNIPER SE	20,192	28.74	580,318.08	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	21.40	1,127,073.80	
	VERBUND AG	7,463	41.22	307,624.86	
	ASML HOLDING NV	41,288	309.40	12,774,507.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES	122,254	20.87	2,551,440.98	
	STMICROELECTRONICS	66,237	24.05	1,592,999.85	
ユーロ 小計		17,920,619		365,498,588.01 (44,685,857,370)	
イギリスポンド	BP PLC	1,938,116	3.53	6,842,518.53	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	399,839	14.37	5,748,885.14	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	357,320	13.84	4,946,738.08	
	ANGLO AMERICAN PLC	122,165	18.65	2,278,865.91	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.98	322,202.01	
	BHP GROUP PLC	202,849	17.12	3,472,774.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,429	51.56	692,399.24	
	EVRAZ PLC	43,000	3.03	130,634.00	
	GLENCORE PLC	1,033,004	1.77	1,831,309.49	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	21.80	367,286.40	
	MONDI PLC	47,780	15.03	718,372.30	
	RIO TINTO PLC REG	107,837	45.25	4,879,624.25	
	ASHTEAD GROUP PLC	42,021	25.50	1,071,535.50	
	BAE SYSTEMS PLC	308,746	5.30	1,638,206.27	
	BUNZL PLC	33,283	19.89	661,998.87	
	DCC PLC	9,127	67.92	619,905.84	
	FERGUSON PLC	22,288	63.30	1,410,830.40	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.33	545,328.81	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,244	3.70	759,402.80	

SMITHS GROUP PLC	37,146	13.60	505,371.33	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	99.22	719,841.10	
EXPERIAN PLC	87,481	27.68	2,421,474.08	
INTERTEK GROUP PLC	15,404	53.38	822,265.52	
RELX PLC	185,932	18.66	3,469,491.12	
RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	4.73	857,166.44	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.45	525,948.98	
BURBERRY GROUP PLC	40,410	16.63	672,018.30	
PERSIMMON PLC	31,506	24.05	757,719.30	
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.59	565,935.06	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	42.82	453,849.18	
COMPASS GROUP PLC	177,028	12.65	2,239,404.20	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,615	108.25	499,573.75	
GVC HOLDINGS PLC	59,240	7.85	465,507.92	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	41.80	670,513.80	
WHITBREAD PLC	17,434	26.53	462,524.02	
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.40	525,533.40	
INFORMA PLC	158,400	4.87	771,883.20	
ITV PLC	295,435	0.86	254,074.10	
PEARSON	66,305	5.32	352,742.60	
WPP PLC	113,065	6.95	786,706.27	
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	6.45	206,528.00	
KINGFISHER PLC	170,994	2.05	350,708.69	
NEXT PLC	13,238	53.46	707,703.48	
OCADO GROUP PLC	44,612	20.72	924,360.64	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.85	387,538.31	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.96	291,923.28	
TESCO	919,600	2.23	2,054,386.40	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	36,715	20.66	758,531.90	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	219,338	30.26	6,637,167.88	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	21.35	383,446.00	
DIAGEO	224,511	28.43	6,382,847.73	
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	15.08	1,379,010.36	
RECKITT BENCKISER PLC	67,934	68.70	4,667,065.80	
UNILEVER PLC	114,166	43.34	4,947,954.44	
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	16.49	1,369,926.24	
ASTRAZENECA	127,263	82.44	10,491,561.72	
GLAXOSMITHKLINE	487,510	16.42	8,007,839.26	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	22.84	375,809.36	
BARCLAYS	1,669,454	1.25	2,091,491.97	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,974,878	4.05	8,007,142.85	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.35	2,337,921.29	

	ROYAL BANK OF SCOTLAND	479,086	1.31	629,279.46	
	STANDARD CHARTERED PLC	254,760	4.42	1,128,077.28	
	3I GROUP PLC	88,121	8.70	766,652.70	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	16.41	542,991.78	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	30,265	78.38	2,372,170.70	
	M&G PLC	229,107	1.70	389,596.45	
	SCHRODERS PLC	11,794	31.08	366,557.52	
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.67	432,822.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.66	622,049.78	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	22.65	368,175.75	
	AVIVA PIC	381,270	2.90	1,106,064.27	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.77	315,445.41	
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.42	1,335,282.00	
	PRUDENTIAL	246,816	12.12	2,991,409.92	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	4.14	359,046.16	
	AVEVA GROUP PLC	6,717	41.83	280,972.11	
	SAGE GROUP PLC	111,321	6.79	756,314.87	
	HALMA PLC	37,159	22.20	824,929.80	
	BT GROUP PLC	817,227	1.22	997,425.55	
	VODAFONE GROUP PLC	2,628,719	1.38	3,652,342.17	
	NATIONAL GRID PLC	334,044	9.26	3,093,247.44	
	SEVERN TRENT PLC	25,000	25.21	630,250.00	
	SSE PLC	100,354	12.43	1,247,400.22	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	9.06	608,934.33	
イギリスポンド 小計		27,633,982		146,316,665.66 (20,068,793,861)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.86	328,126.28	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	715.00	581,295.00	
	GIVAUDAN-REG	912	3,338.00	3,044,256.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	52,353	42.86	2,243,849.58	
	SIKA AG-BR	12,290	172.30	2,117,567.00	
	ABB LTD	176,891	20.67	3,656,336.97	
	GEBERIT AG-REG	3,423	472.00	1,615,656.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	222.60	470,131.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	224.20	844,785.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	48.67	643,612.08	
	SGS SA	586	2,294.00	1,344,284.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	145.00	734,715.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	51,645	64.96	3,354,859.20	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	203.10	504,297.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	39.52	155,629.76	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,884.00	527,520.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	83,700.00	837,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,880.00	819,520.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	287,763	105.36	30,318,709.68	
	ALCON INC	48,619	58.92	2,864,631.48	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	205.50	1,048,872.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	794.80	805,927.20	
	LONZA GROUP AG-REG	7,330	468.90	3,437,037.00	
	NOVARTIS	208,091	84.14	17,508,776.74	
	ROCHE HOLDING GENUSS	67,977	333.20	22,649,936.40	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	146.30	656,301.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	350	92.40	32,340.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	241,636	10.18	2,459,854.48	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	43.70	925,434.90	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	78.50	266,664.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,811	833.00	1,508,563.00	
	UBS GROUP AG	360,755	11.06	3,991,754.07	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	149.10	716,425.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,265	371.60	1,213,274.00	
	SWISS RE LTD	28,362	77.50	2,198,055.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,328	341.30	4,890,146.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	89.90	670,474.20	
	TEMENOS AG - REG	6,511	143.35	933,351.85	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17,151	56.42	967,659.42	
	SWISSCOM	2,441	506.20	1,235,634.20	
スイスフラン 小計		1,691,128		125,123,264.79 (14,180,219,598)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	234.90	4,045,447.80	
	BOLIDEN AB	23,903	214.00	5,115,242.00	
	SCA SV CELLULOSA B	64,571	110.70	7,148,009.70	
	ALFA LAVAL AB	34,177	209.00	7,142,993.00	
	ASSA ABLOY AB-B	101,748	199.70	20,319,075.60	
	ATLAS COPCO A	63,684	378.10	24,078,920.40	
	ATLAS COPCO B	36,538	337.20	12,320,613.60	
	EPIROC AB-A	70,414	114.70	8,076,485.80	
	EPIROC AB-B	29,972	114.50	3,431,794.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	18,468	182.00	3,361,176.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	33,536	202.50	6,791,040.00	
	SANDVIK AB	113,573	172.40	19,579,985.20	
	SKANSKA B	28,530	197.35	5,630,395.50	
	SKF AB-B	35,405	181.30	6,418,926.50	
	VOLVO B	153,020	149.85	22,930,047.00	
	SECURITAS B	35,993	126.30	4,545,915.90	

	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	159.65	2,900,840.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	75.50	2,922,756.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	13,521	565.20	7,642,069.20	
	HENNES & MAURITZ B	77,319	159.70	12,347,844.30	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	431.10	3,431,124.90	
	SWEDISH MATCH AB	16,014	637.20	10,204,120.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	287.10	16,389,103.50	
	NORDEA BANK ABP	309,938	71.25	22,083,082.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	85.90	13,375,489.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	94.60	14,226,515.60	
	SWEDBANK AB-A	86,716	131.18	11,375,404.88	
	EQT AB	27,735	167.30	4,640,065.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	225.00	3,778,200.00	
	INVESTOR AB-B SHS	43,938	516.60	22,698,370.80	
	KINNEVIK AB - B	23,604	242.60	5,726,330.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	436.40	3,176,992.00	
	ERICSSON (LM) B	263,755	85.28	22,493,026.40	
	HEXAGON AB-B SHS	26,504	543.40	14,402,273.60	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	122.30	6,116,467.60	
	TELIA CO AB	257,822	33.31	8,588,050.82	
スウェーデンクローナ 小計		2,509,726		369,454,196.30 (4,326,308,638)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	92,158	150.65	13,883,602.70	
	NORSK HYDRO	106,150	26.99	2,864,988.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	351.50	6,492,205.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	233.80	1,629,819.80	
	MOWI ASA	40,968	194.00	7,947,792.00	
	ORKLA	69,804	85.22	5,948,696.88	
	DNB ASA	96,834	141.20	13,672,960.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	185.00	3,436,190.00	
	TELENOR ASA	71,821	149.95	10,769,558.95	
ノルウェークローネ 小計		521,750		66,645,814.63 (774,424,366)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	638.40	6,605,524.80	
	NOVOZYMES A/S	21,895	374.30	8,195,298.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS	19,930	720.00	14,349,600.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	7,325.00	2,190,175.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	7,904.00	5,129,696.00	
	DSV PANALPINA A S	20,416	741.00	15,128,256.00	
	PANDORA A/S	8,431	352.40	2,971,084.40	
	CARLSBERG AS-B	10,388	905.00	9,401,140.00	
	AMBU A/S-B	18,085	213.50	3,861,147.50	

	COLOPLAST-B	11,223	1,033.00	11,593,359.00	
	DEMANT A/S	11,604	191.20	2,218,684.80	
	GN STORE NORD A/S	13,783	359.70	4,957,745.10	
	GENMAB A/S	6,320	1,878.00	11,868,960.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	260.80	1,270,356.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	171,832	428.25	73,587,054.00	
	DANSKE BANK A/S	72,713	95.94	6,976,085.22	
	TRYG A/S	9,828	194.00	1,906,632.00	
	ORSTED A/S	18,488	748.80	13,843,814.40	
デンマーククローネ 小計		431,102		196,054,613.52 (3,215,295,661)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	28.40	585,863.60	
	OIL SEARCH LTD	222,327	3.73	829,279.71	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	6.43	1,064,775.85	
	SANTOS	156,437	6.17	965,216.29	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.07	257,156.91	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	24.65	2,238,934.85	
	BHP GROUP LTD	281,528	37.64	10,596,713.92	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.89	635,837.92	
	EVOLUTION MINING LTD	174,295	5.24	913,305.80	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	171,404	14.87	2,548,777.48	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	27.33	1,181,421.24	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	28.39	2,103,642.22	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	78,732	12.81	1,008,556.92	
	ORICA LTD	44,211	17.73	783,861.03	
	RIO TINTO LTD	35,522	101.37	3,600,865.14	
	SOUTH32 LTD	481,840	2.34	1,127,505.60	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	28.10	259,082.00	
	BRAMBLES LTD	160,308	11.23	1,800,258.84	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.80	919,156.80	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.93	419,050.00	
	TRANSURBAN GROUP	262,342	14.89	3,906,272.38	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	28.10	1,482,331.20	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	10.79	327,239.12	
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	3.62	603,982.52	
	REA GROUP LTD	5,276	106.10	559,783.60	
	SEEK LTD	26,358	20.40	537,703.20	
	WESFARMERS LTD	109,322	41.77	4,566,379.94	
	COLES GROUP LTD	128,408	16.07	2,063,516.56	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	120,802	37.94	4,583,227.88	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.35	431,315.50	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.44	806,954.72	

	COCHLEAR LIMITED	6,220	193.00	1,200,460.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	66.35	1,078,054.80	
	SONIC HEALTHCARE LTD	47,360	28.89	1,368,230.40	
	CSL LIMITED	44,143	278.50	12,293,825.50	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	271,505	21.00	5,701,605.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	169,116	72.20	12,210,175.20	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	314,974	20.47	6,447,517.78	
	WESTPAC BANKING	355,195	19.88	7,061,276.60	
	AMP LTD	343,649	1.81	622,004.69	
	ASX LTD	20,270	86.46	1,752,544.20	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	32,981	124.40	4,102,836.40	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	60.30	657,993.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	6.21	1,300,094.55	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.90	782,594.00	
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	9.56	1,215,649.60	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	10.28	1,226,959.12	
	AFTERPAY LTD	22,862	50.70	1,159,103.40	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	13.65	605,732.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	22.50	405,000.00	
	TELSTRA CORP	403,126	3.24	1,306,128.24	
	TPG TELECOM LTD	31,475	8.25	259,668.75	
	AGL ENERGY LTD	64,235	18.05	1,159,441.75	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.75	328,439.47	
オーストラリアドル 小計		6,697,458		117,953,304.19 (8,824,086,686)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	136,010	6.95	945,269.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	19.01	1,270,894.54	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	28.30	1,542,916.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.79	500,811.43	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.39	873,311.48	
	MERCURY NZ LTD	85,000	4.92	418,200.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.86	537,796.56	
ニュージーランドドル 小計		688,177		6,089,199.51 (426,670,209)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	55.40	14,209,878.40	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	7.58	1,235,540.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	75.00	10,087,500.00	
	MTR CORP	151,000	42.60	6,432,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	211,000	56.35	11,889,850.00	
	SANDS CHINA LTD	242,800	34.10	8,279,480.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	9.70	1,280,400.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	15.62	2,199,296.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	193,100	25.40	4,904,740.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.92	6,480,580.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	18.68	2,039,108.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	25.20	9,084,600.00	
	HANG SENG BANK	74,200	138.50	10,276,700.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	115,000	290.80	33,442,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,175,000	74.20	87,185,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	257,996	47.80	12,332,208.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.20	2,975,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	32.40	4,057,387.20	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	21.20	1,367,400.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	621,500	9.28	5,767,520.00	
	SINO LAND CO	315,400	10.14	3,198,156.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	102.80	13,569,600.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	46.85	1,897,425.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.60	1,981,720.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140,000	35.90	5,026,000.00	
	WHEELOCK & CO LTD	82,000	62.30	5,108,600.00	
	PCCW LTD	357,000	4.50	1,606,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	43.05	2,905,875.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	78.40	12,308,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	12.86	13,253,245.94	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	45.40	6,242,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	80.30	1,903,110.00	
香港ドル 小計		8,216,659		304,528,921.14 (4,235,997,293)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	169,900	6.16	1,046,584.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	204,600	3.56	728,376.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	199,900	1.02	203,898.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	4.32	467,994.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.83	510,450.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	22.87	226,413.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.99	712,614.00	
	DBS GROUP	174,800	22.95	4,011,660.00	
	OCBC BANK	315,600	9.70	3,061,320.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	120,300	22.66	2,725,998.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	8.35	653,805.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.16	706,260.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	9.01	385,628.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.37	350,075.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.56	399,892.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.67	2,008,488.81	

シンガポールドル 小計		3,266,975		18,199,456.05 (1,412,095,794)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	12.46	844,239.76	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	514.80	1,104,760.80	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	22.35	2,197,228.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	19.74	2,776,529.70	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	12.12	1,205,940.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	75.25	940,850.75	
	AZRIELI GROUP	4,323	187.00	808,401.00	
	NICE LTD	6,172	640.90	3,955,634.80	
イスラエルシェケル 小計		431,365		13,833,585.31 (432,299,540)	
合　計		102,136,054		401,982,977,894 (401,982,977,894)	

(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	1,310,028.85	
		LENDLEASE GROUP	55,692	741,260.52	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	633,513.00	
	オーストラリアドル 小計		259,965	2,684,802.37 (200,850,065)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,741,950.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,417,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	6,159,450.00 (85,677,949)	
投資信託受益証券合計			855,465	286,528,014 (286,528,014)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	643,476.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,326	1,973,269.34	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	43,026	11,434,589.76	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	887,315.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,324,965.90	
		BOSTON PROPERTIES	14,788	1,542,832.04	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	877,042.40	
		CROWN CASTLE INTL CORP	39,669	6,915,893.46	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,549,874.68	
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,292,976.00	
		EQUINIX INC	8,137	5,624,457.14	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,101,009.08	

	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,319,841.03	
	ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,694,012.80	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,269,064.65	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	710,895.72	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,101	1,378,175.26	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	978,395.05	
	INVITATION HOMES INC	51,458	1,464,494.68	
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	829,960.98	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,024,737.28	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,360,663.90	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	632,636.65	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	712,298.78	
	PROLOGIS INC	70,356	6,847,749.48	
	PUBLIC STORAGE	15,009	3,172,452.33	
	REALTY INCOME CORP	33,520	2,106,732.00	
	REGENCY CENTERS CORP	17,800	903,884.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,751	3,313,995.75	
	SIMON PROPERTY GROUP	29,338	2,536,856.86	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,312,883.95	
	UDR INC	28,059	1,169,779.71	
	VENTAS INC	34,403	1,497,562.59	
	VEREIT INC	105,798	722,600.34	
	VICI PROPERTIES INC	44,224	972,928.00	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	694,089.00	
	WELLTOWER INC	38,031	2,266,647.60	
	WP CAREY INC	16,500	1,171,005.00	
アメリカドル 小計		1,210,243	81,232,044.95 (8,756,002,125)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	430,575.15	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	190,091.25	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	271,075.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	130,977.06	
カナダドル 小計		42,473	1,022,718.46 (82,195,882)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	337,664.10	
	GECINA SA	4,459	536,417.70	
	ICADE	2,845	197,727.50	
	KLEPIERRE	17,225	363,964.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	929,890.50	
ユーロ 小計		43,186	2,365,664.05 (289,226,086)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	347,753.90	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	384,205.10	

		SEGRO PLC	106,999	918,907.41	
	イギリスポンド 小計		244,963	1,650,866.41 (226,432,836)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	941,840.90	
		GOODMAN GROUP	162,271	2,414,592.48	
		GPT GROUP	167,884	767,229.88	
		MIRVAC GROUP	392,919	1,013,731.02	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,328,589.99	
		STOCKLAND	207,412	848,315.08	
		VICINITY CENTERS	291,115	537,107.17	
	オーストラリアドル 小計		1,802,354	7,851,406.52 (587,363,721)	
	香港ドル	LINK REIT	199,000	13,641,450.00	
	香港ドル 小計		199,000	13,641,450.00 (189,752,569)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	895,980.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	454,410.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	200,300	446,669.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	473,000.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	311,900	598,848.00	
		SUNTEC REIT	173,000	273,340.00	
	シンガポールドル 小計		1,422,200	3,142,247.00 (243,806,944)	
投資証券合計			4,964,419	10,374,780,163 (10,374,780,163)	
合計				10,661,308,177 (10,661,308,177)	

(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　589銘柄	97.0%	—	—	69.2%
	投資証券　38銘柄	—	—	3.0%	2.1%
カナダドル	株式　80銘柄	99.4%	—	—	3.4%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.6%	0.0%
ユーロ	株式　242銘柄	99.4%	—	—	10.8%

	投資証券　5銘柄	—	—	0.6%	0.1%
イギリスポンド	株式　85銘柄	98.9%	—	—	4.9%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.1%	0.1%
スイスフラン	株式　40銘柄	100.0%	—	—	3.4%
スウェーデンクローナ	株式　36銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　54銘柄	91.8%	—	—	2.1%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.1%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.1%	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	93.9%	—	—	1.0%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式　16銘柄	85.3%	—	—	0.3%
	投資証券　6銘柄	—	—	14.7%	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 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	148,594,240
コール・ローン	5,564,124,746
国債証券	273,601,588,672
派生商品評価勘定	92,225,702
未収入金	33,889,545
未収利息	1,577,016,260
前払金	18,772,192
前払費用	140,450,314

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	451,623,915
流動資産合計	281,628,285,586
資産合計	281,628,285,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,598,080
未払金	1,140,632
未払解約金	80,398,173
未払利息	8,195
その他未払費用	7,874
流動負債合計	109,152,954
負債合計	109,152,954
純資産の部	
元本等	
元本	96,103,991,147
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	185,415,141,485
元本等合計	281,519,132,632
純資産合計	281,519,132,632
負債純資産合計	281,628,285,586

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (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。 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。

	2020年 6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	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (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。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	96,103,991,147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 2.9293円 (1万口当たり純資産額) (29,293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 6月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2020年 6月10日現在
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 6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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	114,007,040,111円
期中追加設定元本額	42,320,021,906円
期中一部解約元本額	60,223,070,870円
期末元本額	96,103,991,147円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,624,605,662円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	637,752,782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）	2,031,111,501円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,934,361円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,510,344,235円
世界経済インデックスファンド	6,613,268,501円
ＤＣマイセレクション２５	1,743,953,830円
ＤＣマイセレクション５０	1,409,913,712円
ＤＣマイセレクション７５	859,349,387円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	1,975,753,490円
ＤＣマイセレクションＳ２５	742,351,605円
ＤＣマイセレクションＳ５０	603,265,644円
ＤＣマイセレクションＳ７５	276,994,985円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	44,035,370円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	68,842,672円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	33,446,435円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,538,000,685円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	605,723,597円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	30,524,302円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,580,123円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,876,546円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	45,841,103円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	81,223,211円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	122,012,266円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	130,106,083円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	225,686,545円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,848,801,299円

区分	2020年 6月10日現在
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	516,151,486円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,002,691,747円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	772,396,555円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	68,159,161円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	544,828,385円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	31,538,927円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	212,026,680円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	267,965,664円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	879,421,121円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	2,035,218,982円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	807,726,841円
外国債券ファンド・シリーズ１	595,657,806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	1,682,389,528円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,255,215,843円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	313,491,888円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,911,497,533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）	197,500,059円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	95,298,512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）	1,072,705,670円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	181,995,649円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	19,945,944,442円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	98,160,452円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	105,658,461円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	179,380,486円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,667,345円
グローバル経済コア	828,958,811円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	9,012,061円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	214,040円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	218,715,325円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,162,672円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	102,047円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	205,265円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	83,583円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	58,312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）	632,473,677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）	10,315,291,456円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	343,895,845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）	366,615,959円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	66,057,149円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 6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	△2,096,719,224
合計	△2,096,719,224

(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 6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	5,374,026,653	－	5,355,254,461	△18,772,192
合計		5,374,026,653	－	5,355,254,461	△18,772,192

(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はありません。

通貨関連

（2020年 6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				
	買建	5,573,319,434	－	5,656,724,600	83,405,166
	アメリカドル	2,594,943,015	－	2,597,498,000	2,554,985
	カナダドル	253,185,501	－	260,366,400	7,180,899
	ユーロ	2,327,827,181	－	2,390,183,000	62,355,819
	イギリスポンド	397,363,737	－	408,677,200	11,313,463
	売建	66,726,694	－	66,732,046	△5,352
	イギリスポンド	66,726,694	－	66,732,046	△5,352
合計		5,640,046,128	－	5,723,456,646	83,399,814

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,150,793.01	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,255,535.97	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	5,052,734.40	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,833,523.44	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,689,876.96	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,144,335.90	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,169,335.95	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,588,378.90	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,144,375.00	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,133,789.05	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,594,482.40	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,882,462.50	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,065,992.16	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,140,625.00	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,278,515.60	
		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,878,078.10	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,915,703.12	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,608,781.25	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,638,222.66	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,798,181.66	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,040,585.94	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,576,660.15	
		T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	15,755,617.18	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,155,078.15	
		T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,226,562.50	

		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,775,640.62	
		T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,559,113.34	
		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,354,815.62	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,849,640.62	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,566,015.62	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,813,930.67	
		T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,660,058.58	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,912,515.64	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,851,437.50	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,837,805.67	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,219,296.91	
		T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,032,843.78	
		T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,585,850.04	
		T 1.75% 07/31/21	6,700,000.00	6,818,166.02	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,330,451.15	
		T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,186,952.15	
		T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,189,765.66	
		T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,571,386.72	
		T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,664,355.45	
		T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,589,236.31	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,317,812.50	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,602,969.90	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,146,406.24	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,383,437.50	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,741,888.69	
		T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,532,468.75	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,442,058.58	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,905,281.25	
		T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,929,016.02	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,601,000.00	
		T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,402,218.75	
		T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,652,197.27	
		T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,235,312.50	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,151,750.00	
		T 2.125% 08/15/21	5,370,000.00	5,491,768.93	
		T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,557,701.15	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,602,812.48	
		T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,040,103.13	
		T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,603,701.18	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,575,609.40	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,282,031.24	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,912,125.00	

		T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,149,843.76	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,521,171.91	
		T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,070,019.52	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,512,543.01	
		T 2.25% 08/15/46	10,790,000.00	12,365,508.64	
		T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	11,811,281.25	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,816,058.57	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,989,357.39	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,820,062.50	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,529,750.00	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,810,781.25	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,110,062.50	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,280,859.40	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,200,100.00	
		T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,414,031.28	
		T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,023,203.12	
		T 2.375% 05/15/29	15,010,000.00	17,102,018.75	
		T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,551,269.50	
		T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	8,920,312.50	
		T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,736,513.68	
		T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,800,554.71	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,486,718.75	
		T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,098,898.41	
		T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,266,504.68	
		T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,187,382.85	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,305,023.43	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,570,882.85	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	6,058,027.36	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,872,054.68	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,245,655.06	
		T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,564,985.93	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,490,453.13	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,018,613.31	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,252,187.50	
		T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,438,918.94	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,787,929.70	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,502,940.62	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,267,890.64	
		T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,620,312.52	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,859,031.26	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,166,301.55	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,140,664.09	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,077,656.25	

		T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,330,000.00	
		T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,727,500.00	
		T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,253,628.93	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,721,800.76	
		T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,385,078.08	
		T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,634,940.65	
		T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,215,546.89	
		T 2.75% 11/15/47	4,550,000.00	5,754,328.12	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,478,593.76	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,480,587.50	
		T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,528,027.36	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,274,071.87	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,282,876.58	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,138,234.37	
		T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,449,640.66	
		T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,490,898.45	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,155,605.49	
		T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,509,697.24	
		T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	5,980,175.79	
		T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,667,039.06	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,378,816.39	
		T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,574,951.17	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,234,375.00	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,091,856.25	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,509,375.00	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,633,976.56	
		T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,866,574.21	
		T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,527,812.48	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,868,671.87	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,114,140.64	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,441,738.31	
		T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,822,031.62	
		T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,790,477.53	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,421,093.80	
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,461,500.00	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,128,222.68	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,087,187.50	
		T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,260,972.64	
		T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,094,656.25	
		T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,605,234.37	
		T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,369,234.37	
		T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,294,775.79	

		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,041,937.50	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,300,292.97	
		T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,189,622.67	
		T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	10,371,703.12	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,062,178.91	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,411,750.00	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,836,093.76	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,863,281.26	
		T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	7,949,648.46	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,104,539.06	
		T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,691,625.00	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,891,035.17	
		T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,334,609.41	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,093,217.19	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,555,742.20	
		T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,530,062.50	
		T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,241,261.74	
		T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,761,093.75	
		T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,675,195.30	
		T 3% 11/15/44	6,050,000.00	7,855,546.87	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,357,242.19	
		T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,576,406.25	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,517,734.38	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,926,742.19	
		T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,018,691.41	
		T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,932,820.31	
		T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,381,149.22	
		T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,464,375.00	
		T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,640,179.69	
		T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,764,862.50	
		T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,211,542.97	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,764,898.44	
		T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,725,781.25	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,783,132.81	
		T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,860,101.56	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,658,343.75	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,224,078.12	
		T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,028,867.18	
		T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,598,953.12	
		T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,963,693.36	
		T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,889,988.27	
	アメリカドル 小計		1,033,590,000.00	1,147,097,479.03 (123,645,637,264)	

カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,046,200.60	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,880,000.00	3,890,883.40	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,717,158.50	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,730,000.00	1,832,070.00	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,905,878.20	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,234,187.90	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,108,418.35	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,443,844.00	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	627,393.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,762,555.60	
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	516,742.50	
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,523,340.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,459,275.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,963,692.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,507,823.75	
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,943,017.20	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,850,343.80	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,720,371.50	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	861,789.60	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,457,682.85	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,221,903.85	
	CAN 2% 12/01/51	1,470,000.00	1,779,074.85	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,840,000.00	1,894,022.40	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,226,103.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,850,000.00	2,842,081.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,694,680.65	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,572,424.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,580,000.00	2,564,893.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,794,804.25	
カナダドル 小計		58,060,000.00	66,962,655.25 (5,381,788,602)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,174,251.50	
	MBONO 10% 12/05/24	25,860,000.00	30,600,396.60	
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	25,723,677.65	
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	26,951,980.75	
	MBONO 6.5% 06/10/21	39,660,000.00	40,222,775.40	
	MBONO 6.75% 03/09/23	14,560,000.00	15,162,347.20	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,144,401.90	
	MBONO 7.5% 06/03/27	41,630,000.00	45,325,495.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	18,508,423.90	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	25,471,949.05	
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	17,157,085.50	

	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	43,626,757.10	
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	25,399,908.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	37,948,540.05	
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	23,215,798.80	
	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,364,164.40	
メキシコペソ 小計		415,290,000.00	450,997,952.90 (2,223,419,907)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,060,000.00	1,064,383.10	
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,544,624.30	
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	662,969.25	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,684,127.70	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,306,461.80	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,804,142.60	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,671,649.20	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,676,867.50	
	BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,329,207.65	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	961,503.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	614,969.60	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,788,513.40	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,243,895.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,586,662.40	
	BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,559,499.60	
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,631,885.25	
	BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,396,059.80	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,450,000.00	1,571,749.25	
	BGB 2.25% 06/22/57	680,000.00	987,356.60	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,740,425.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,210,286.00	
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,412,387.50	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,140,000.00	3,646,795.40	
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,495,958.50	
	BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,333,289.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,458,048.60	
	BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,320,253.50	
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,562,236.20	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,001,393.00	
	BGB 5% 03/28/35	2,920,000.00	4,879,743.40	
	BKO 0% 03/11/22	3,100,000.00	3,133,216.50	
	BKO 0% 06/11/21	2,640,000.00	2,656,011.60	
	BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,016,541.10	
	BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	569,420.80	
	BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,589,378.30	
	BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,405,838.00	

		BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,184,343.70	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,212,706.25	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,224,710.80	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,032,070.00	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,621,834.70	
		BTPS 0.95% 08/01/30	650,000.00	617,074.25	
		BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,046,481.50	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,975,467.00	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	989,940.00	
		BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,960,726.00	
		BTPS 1.45% 03/01/36	550,000.00	516,067.75	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,367,746.50	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,077,641.25	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,476,692.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,487,614.05	
		BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,295,338.60	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,014,003.30	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,600,000.00	1,669,432.00	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,094,900.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,827,939.50	
		BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,194,668.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	1,740,000.00	1,842,955.80	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,403,984.00	
		BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,577,275.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	3,680,000.00	3,935,631.20	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,446,037.85	
		BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,780,433.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,693,062.50	
		BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	874,985.10	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,150,846.00	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,196,030.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,175,409.50	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,681,985.20	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,398,084.60	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,111,101.65	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,750,000.00	3,094,740.00	
		BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,741,740.00	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,212,024.65	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,625,999.40	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,279,579.25	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,310,000.00	2,731,043.70	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,565,051.60	

		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,681,630.80	
		BTPS 3.75% 08/01/21	1,660,000.00	1,729,720.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,420,513.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,350,307.45	
		BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,636,544.00	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,143,580.00	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,486,515.20	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,001,419.70	
		BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,570,260.40	
		BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,175,604.25	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,602,440.70	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,169,001.00	
		BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,351,709.90	
		BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	4,039,308.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,747,669.40	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,395,300.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,875,868.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,466,000.00	
		BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,519,668.75	
		BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,255,624.00	
		BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	4,728,132.90	
		BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,615,467.45	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,520,000.00	4,821,291.20	
		BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,653,210.50	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,934,485.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,029,160.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,351,864.50	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,107,703.85	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,301,197.10	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,154,425.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,181,185.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,567,122.90	
		DBR 0.5% 08/15/27	3,160,000.00	3,385,023.60	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,679,349.10	
		DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,617,398.25	
		DBR 0% 08/15/29	4,640,000.00	4,790,011.20	
		DBR 0% 08/15/50	1,130,000.00	1,067,064.65	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,050,000.00	3,961,248.50	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,131,384.00	
		DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,317,776.00	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,481,558.50	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,934,022.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,795,043.25	

		DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,193,110.15	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,134,930.00	
		DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,459,220.20	
		DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,018,396.25	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,320,000.00	5,227,904.40	
		DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,473,647.20	
		DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,437,923.50	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,100,955.00	
		DBR 3.25% 07/04/21	4,100,000.00	4,268,407.50	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,940,000.00	5,009,069.10	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,915,089.65	
		DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,463,330.60	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,623,958.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,320,131.20	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,530,626.55	
		DBR 5.5% 01/04/31	3,580,000.00	5,792,798.00	
		DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,384,478.80	
		DBR 6.25% 01/04/24	5,440,000.00	6,781,123.20	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,049,193.75	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,469,049.40	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,530,000.00	4,675,707.45	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,249,100.00	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,333,963.70	
		FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,194,480.00	
		FRTR 0.75% 05/25/28	5,640,000.00	6,034,264.20	
		FRTR 0.75% 05/25/52	1,550,000.00	1,533,903.25	
		FRTR 0.75% 11/25/28	7,590,000.00	8,126,461.20	
		FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,018,090.00	
		FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,162,947.75	
		FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,367,339.80	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,058,825.50	
		FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,186,760.90	
		FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,094,165.25	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,259,421.40	
		FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,792,517.15	
		FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,029,379.00	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,256,956.40	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,330,000.00	3,994,717.95	
		FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,900,651.20	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,397,464.20	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,261,387.90	
		FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,383,737.50	

		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,041,785.75	
		FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,886,588.60	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,547,084.50	
		FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,123,145.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	5,160,000.00	6,431,088.60	
		FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,727,514.00	
		FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,580,642.10	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,352,412.25	
		FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,943,291.50	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,782,909.25	
		FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	9,056,325.45	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,837,657.60	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	8,618,917.65	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,073,490.40	
		FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	4,051,445.75	
		FRTR 4% 04/25/60	1,960,000.00	4,065,941.60	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,488,432.55	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,733,725.45	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,322,057.40	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,555,196.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,260,780.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	1,270,000.00	1,290,535.90	
		IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	472,804.80	
		IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	838,642.70	
		IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,142,717.20	
		IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	535,374.20	
		IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	999,368.40	
		IRISH 1.3% 05/15/33	630,000.00	702,002.70	
		IRISH 1.35% 03/18/31	630,000.00	702,072.00	
		IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	734,290.20	
		IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	885,453.75	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,516,496.10	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,700,951.00	
		IRISH 2% 02/18/45	1,170,000.00	1,510,505.10	
		IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,324,743.20	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,131,255.55	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,918,220.95	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,488,620.00	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,666,056.00	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,250,000.00	1,341,218.75	
		NETHER 0.5% 07/15/26	1,860,000.00	1,962,755.70	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,274,210.75	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,754,889.30	

		NETHER 0% 01/15/22	980,000.00	988,810.20	
		NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,886,574.50	
		NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,631,292.25	
		NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,280,534.20	
		NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	699,619.80	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,650,000.00	2,183,478.00	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,130,000.00	3,538,419.90	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,198,144.05	
		NETHER 3.25% 07/15/21	2,740,000.00	2,854,751.20	
		NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,273,881.10	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,644,891.90	
		NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,489,127.65	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,500,066.25	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	242,424.00	
		OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,967,483.00	
		OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,680,157.00	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,854,081.25	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,260,059.90	
		OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,220,881.60	
		OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,620,423.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,541,740.20	
		OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,410,183.50	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,232,366.85	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	936,929.70	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,737,352.80	
		RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	598,892.00	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,284,845.90	
		RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,135,621.75	
		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,522,942.50	
		RAGB 0% 07/15/24	920,000.00	937,374.20	
		RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	323,902.40	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,802,129.20	
		RAGB 1.5% 02/20/47	830,000.00	1,049,999.80	
		RAGB 1.5% 11/02/86	450,000.00	621,490.50	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,082,332.35	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,431,997.70	
		RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,353,788.00	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,351,349.70	
		RAGB 3.15% 06/20/44	890,000.00	1,459,773.55	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,990,000.00	3,280,239.30	
		RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,818,238.65	
		RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,250,735.20	

		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,030,002.65	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,770,000.00	2,910,924.30	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,706,707.30	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,724,794.20	
		RFGB 0.125% 04/15/36	510,000.00	501,878.25	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	651,074.40	
		RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,380,504.20	
		RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	707,319.00	
		RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	685,954.75	
		RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	541,617.50	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	736,023.00	
		RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	393,808.35	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,996.40	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,124.90	
		RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	724,707.20	
		RFGB 1.375% 04/15/47	540,000.00	676,779.30	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	687,664.25	
		RFGB 1.625% 09/15/22	1,250,000.00	1,311,931.25	
		RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	856,219.80	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	520,279.20	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	800,653.05	
		RFGB 4% 07/04/25	1,050,000.00	1,287,982.50	
		SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,940,943.10	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,324,727.85	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,447,274.05	
		SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,423,340.50	
		SPGB 0.45% 10/31/22	2,210,000.00	2,249,724.75	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,150,000.00	2,137,067.75	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,802,921.10	
		SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,228,787.00	
		SPGB 0% 01/31/25	870,000.00	870,996.15	
		SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,394,410.90	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,238,657.75	
		SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,701,194.50	
		SPGB 1.4% 04/30/28	4,430,000.00	4,790,159.00	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,570,517.50	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,102,027.50	
		SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,817,204.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,317,576.50	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,291,834.50	
		SPGB 1.85% 07/30/35	1,820,000.00	2,041,084.50	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,118,523.95	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,846,616.10	

	SPGB 1% 10/31/50	1,180,000.00	1,040,583.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,628,544.40	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,895,584.60	
	SPGB 2.7% 10/31/48	2,070,000.00	2,672,494.20	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,049,820.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	2,882,421.85	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,800,000.00	2,790,252.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,907,576.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	4,036,983.20	
	SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,034,265.50	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,519,072.40	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,328,992.80	
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,834,508.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,590,000.00	4,297,548.15	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,436,602.85	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,305,829.75	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,333,593.50	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,102,025.60	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,716,602.80	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,708,579.20	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,543,862.25	
ユーロ 小計		760,300,000.00	898,200,758.60 (109,814,024,746)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/31/23	1,090,000.00	1,091,547.80	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,577,329.30	
	UKT 0.5% 10/22/61	340,000.00	325,873.00	
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,492,123.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,974,340.10	
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,912,503.80	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,223,982.45	
	UKT 1.25% 10/22/41	650,000.00	718,643.25	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,173,140.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,541,432.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	3,610,000.00	4,037,839.15	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,412,455.00	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,530,000.00	2,256,382.80	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,840,000.00	2,323,119.60	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,030,000.00	2,761,957.10	
	UKT 1.75% 09/07/22	2,470,000.00	2,566,206.50	
	UKT 1.75% 09/07/37	3,530,000.00	4,165,152.90	
	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,214,917.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,679,325.00	

		UKT 2.5% 07/22/65	2,350,000.00	4,083,900.50	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,805,935.50	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,964,087.60	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,489,475.25	
		UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	4,908,584.85	
		UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,711,498.90	
		UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	3,921,602.85	
		UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,949,029.10	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,790,000.00	4,326,243.75	
		UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	4,763,880.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,099,170.60	
		UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	873,351.70	
		UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,813,100.60	
		UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	4,019,963.60	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,649,939.65	
		UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	4,914,340.20	
		UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,733,419.85	
		UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,394,913.00	
		UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,217,673.00	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,262,680.00	
		UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	4,181,164.80	
		UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,085,388.50	
		UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,440,765.80	
		UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,853,693.75	
		UKT 8% 06/07/21	740,000.00	798,175.10	
	イギリスポンド 小計		97,270,000.00	133,710,248.20 (18,339,697,643)	
	スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,531,546.00	
		SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,131,815.00	
		SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,259,187.50	
		SGB 1% 11/12/26	9,170,000.00	9,832,715.90	
		SGB 2.5% 05/12/25	8,370,000.00	9,489,613.05	
		SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,049,538.00	
		SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,812,400.75	
	スウェーデンクローナ 小計		61,640,000.00	69,106,816.20 (809,240,817)	
	ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	3,610,000.00	3,836,022.10	
		NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,199,125.35	
		NGB 1.75% 02/17/27	4,120,000.00	4,450,774.20	
		NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,518,786.50	
		NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,221,537.50	
		NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,428,318.00	
		NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,831,219.80	

	NGB 3% 03/14/24	6,830,000.00	7,509,345.95	
ノルウェークローネ 小計		48,320,000.00	51,995,129.40 (604,183,403)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,197,650.40	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,360,333.85	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,261,178.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,380,000.00	7,884,755.10	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	9,985,392.05	
	DGB 3% 11/15/21	9,800,000.00	10,295,782.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,940,000.00	31,225,671.40	
デンマーククローネ 小計		69,380,000.00	87,210,762.80 (1,430,256,509)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	4,550,000.00	4,631,422.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,888,273.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,191,168.15	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,188,335.80	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,032,600.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,587,704.80	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,487,648.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,688,867.95	
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,060,000.00	4,561,247.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,480,000.00	3,893,424.00	
	POLGB 4% 10/25/23	3,730,000.00	4,167,118.70	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	823,998.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,541,592.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,661,664.00	
ポーランドズロチ 小計		56,520,000.00	61,345,065.00 (1,687,602,738)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,343,627.05	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,964,075.40	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,060,000.00	2,145,263.40	
	ACGB 1% 12/21/30	3,720,000.00	3,689,124.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,570,000.00	3,954,132.00	
	ACGB 2.25% 11/21/22	4,050,000.00	4,244,987.25	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,315,331.90	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,590,054.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	933,772.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	730,000.00	865,769.05	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,806,006.85	
	ACGB 2.75% 11/21/28	2,960,000.00	3,403,215.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,383,863.00	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,980,517.75	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,955,124.40	

	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,900,914.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,656,428.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,152,761.30	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,070,138.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,492,040.50	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,668,079.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,284,361.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,820,000.00	3,240,039.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,732,101.00	
オーストラリアドル 小計		70,230,000.00	79,771,726.35 (5,967,722,848)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,458,518.40	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	829,368.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	297,711.10	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	803,702.90	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,080,000.00	1,100,984.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	510,000.00	580,423.35	
	SIGB 2.375% 06/01/25	320,000.00	348,416.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	304,460.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,188,783.75	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,590,678.20	
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	767,236.65	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,147,200.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	977,529.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	412,130.25	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	433,396.65	
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	679,926.40	
	SIGB 3.375% 09/01/33	840,000.00	1,066,560.60	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,036,714.80	
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,347,191.10	
シンガポールドル 小計		14,590,000.00	16,370,932.05 (1,270,220,617)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,535,752.50	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	724,906.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,840,000.00	2,922,885.40	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,569,750.70	
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,266,455.40	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,039,266.95	
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	363,340.25	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,549,950.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,733,073.20	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,477,076.25	

		MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	771,416.25	
		MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,089,173.50	
		MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	778,377.10	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,197,771.75	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,093,765.25	
		MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,527,516.00	
		MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	638,037.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,739,731.60	
		MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,101,332.00	
		MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,013,392.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	462,488.65	
		MGS 4.16% 07/15/21	2,030,000.00	2,076,304.30	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,361,472.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,197,270.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	875,456.10	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,657,440.60	
		MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,658,031.60	
		MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,695,502.50	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,639,536.60	
		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,613,643.80	
		MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	932,348.00	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,214,571.75	
		MGS 4.935% 09/30/43	2,550,000.00	2,945,785.50	
		MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,719,782.20	
	マレーシアリンギット 小計		51,320,000.00	55,182,602.70 (1,392,257,066)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,846,034.95	
		ILGOV 1% 03/31/30	830,000.00	845,939.98	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	2,160,000.00	2,430,930.52	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,619,602.44	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	2,420,000.00	3,436,171.31	
		ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,298,655.73	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,471,037.57	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,188,795.90	
	イスラエルシェケル 小計		26,950,000.00	33,137,168.40 (1,035,536,512)	
合計				273,601,588,672 (273,601,588,672)	

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　193銘柄	100.0%	45.2%
カナダドル	国債証券　29銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　312銘柄	100.0%	40.1%
イギリスポンド	国債証券　44銘柄	100.0%	6.7%
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　19銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券　34銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　8銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,633,415,512
コール・ローン	23,654,270
株式	66,148,099,201
投資信託受益証券	180,040,437
投資証券	62,212,551
派生商品評価勘定	268,629,961
未収入金	1,253,034
未収配当金	138,150,176
差入委託証拠金	764,801,596
流動資産合計	69,220,256,738
資産合計	69,220,256,738

	2020年 6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	14,757
前受金	268,623,459
未払解約金	24,379,715
未払利息	34
その他未払費用	195
流動負債合計	293,018,160
負債合計	293,018,160
純資産の部	
元本等	
元本	25,324,856,282
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	43,602,382,296
元本等合計	68,927,238,578
純資産合計	68,927,238,578
負債純資産合計	69,220,256,738

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

	2020年 6月10日現在
	(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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月10日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		25,324,856,282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	2.7217円
	(1万口当たり純資産額)	(27,217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 6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 6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 6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。 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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	19,516,351,824円
期中追加設定元本額	7,116,070,158円
期中一部解約元本額	1,307,565,700円
期末元本額	25,324,856,282円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	7,731,792,350円
世界経済インデックスファンド	3,780,953,825円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	4,490,592,987円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	4,857,189,812円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	161,952,716円
分散投資コア戦略ファンドＡ	357,886,446円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,266,224,032円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	529,119,514円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	611,479,839円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	340,671,968円

区分	2020年 6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）	20,113,147円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	113,351,050円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	89,754,727円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	283,636,747円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	57,626,843円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,148,582円
グローバル経済コア	449,357,694円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	19,793,117円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	208,276円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	333,579円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	129,484円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	81,086円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	114,081,176円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	46,377,285円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△775,611,768
投資信託受益証券	△16,162,375
投資証券	△25,193,039
合計	△816,967,182

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 6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	2,224,426,659	－	2,493,050,118	268,623,459
合計		2,224,426,659	－	2,493,050,118	268,623,459

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年 6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				
	買建	2,342,530	－	2,327,773	△14,757
	ブラジルレアル	2,342,530	－	2,327,773	△14,757
	売建	34,676,530	－	34,670,028	6,502
	アメリカドル	34,676,530	－	34,670,028	6,502
合計		37,019,060	－	36,997,801	△8,255

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	617,282	5.90	3,644,432.92	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.62	64,480.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	43,246	78.70	3,403,460.20	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,190	157.60	1,605,944.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	146,513	5.82	853,584.73	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	5.88	725,067.31	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	26,967	51.00	1,375,317.00	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	6.44	99,890.84	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.50	143,905.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	70,402	29.36	2,067,002.72	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	19.90	390,000.20	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	13.88	372,233.84	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	76.35	543,917.40	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	13.75	533,128.75	

	SOUTHERN COPPER CORP	11,367	38.93	442,517.31	
	51JOB INC-ADR	2,701	69.08	186,585.08	
	BEST INC - ADR	14,126	5.26	74,302.76	
	DP WORLD PLC	21,152	16.18	342,239.36	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	35,934	34.08	1,224,630.72	
	NIO INC - ADR	77,076	6.68	514,867.68	
	GSX TECHEDU INC- ADR	7,846	39.60	310,701.60	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	37.65	524,125.65	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,167	128.76	1,952,902.92	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	40,978	65.58	2,687,337.24	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	38,070	50.94	1,939,285.80	
	58.COM INC-ADR	9,450	50.48	477,036.00	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	87.62	575,751.02	
	BAIDU INC - SPON ADR	29,357	115.83	3,400,421.31	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	9,184	33.87	311,062.08	
	HUYA INC-ADR	8,211	15.91	130,637.01	
	IQIYI INC-ADR	21,239	18.09	384,213.51	
	JOYY INC	6,185	72.71	449,711.35	
	MOMO INC-SPON ADR	15,529	20.56	319,276.24	
	NETEASE INC-ADR	7,551	409.54	3,092,436.54	
	SINA CORP	5,725	34.35	196,653.75	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	34,090	12.35	421,011.50	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	33.10	173,741.90	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	196,529	220.72	43,377,880.88	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	32.15	112,782.20	
	JD.COM INC-ADR	78,907	58.82	4,641,309.74	
	PINDUODUO INC-ADR	26,536	69.38	1,841,067.68	
	TRIP.COM GROUP LTD	52,406	29.02	1,520,822.12	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	17.44	828,190.72	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47,223	12.47	588,870.81	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	7,243	24.02	173,976.86	
	ZAI LAB LTD-ADR	5,149	74.06	381,334.94	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	173,806	4.09	710,866.54	
	CREDICORP LTD	7,332	165.98	1,216,965.36	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	289,100	12.67	3,664,342.50	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.07	405,633.70	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	28.08	56,749.68	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.75	40,878.43	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	7,645	62.14	475,060.30	
	GLOBANT SA	3,122	136.65	426,621.30	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	9.49	378,214.46	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	10.49	154,370.84	

アメリカドル 小計		3,138,293		96,949,752.30 (10,450,213,800)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	6.40	9,889,030.40	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	350,392	52.87	18,525,225.04	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	214.87	3,115,615.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	37.26	3,608,705.52	
	ALFA S.A.B.-A	359,900	13.61	4,898,239.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	51.79	1,942,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	294.75	6,869,148.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	168.76	5,245,060.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	179.42	3,046,551.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	29.27	6,538,625.30	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	67.51	2,119,814.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	579,880	56.79	32,931,385.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	99.73	5,033,871.75	
	BECLE SAB DE CV	48,100	39.68	1,908,608.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	198,940	152.96	30,429,862.40	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	222.71	5,781,551.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	35.56	6,464,808.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	35.44	6,442,992.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	262,800	84.86	22,301,208.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	18.40	4,646,000.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,625,440	15.79	57,245,697.60	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	66.19	3,805,925.00	
メキシコペソ 小計		8,195,655		242,790,049.96 (1,196,954,946)	
ブラジルレアル	COSAN SA	18,400	68.53	1,260,952.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	423,000	22.69	9,597,870.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	446,840	21.72	9,705,364.80	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	19.27	1,456,812.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	27.00	399,600.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	12.05	759,150.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	14.96	1,570,800.00	
	SUZANO SA	62,679	38.17	2,392,457.43	
	VALE SA	372,878	54.99	20,504,561.22	
	WEG SA	84,872	45.81	3,887,986.32	
	CCR SA	125,600	14.48	1,818,688.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	42.90	2,657,740.80	
	RUMO SA	114,200	24.31	2,776,202.00	
	COGNA EDUCACAO	181,284	6.95	1,259,923.80	
	B2W CIA DIGITAL	20,960	94.50	1,980,720.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	77,416	30.25	2,341,834.00	

	LOJAS RENNER S.A.	82,907	45.82	3,798,798.74	
	MAGAZINE LUIZA SA	83,400	62.38	5,202,492.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	23.41	1,779,160.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	18.37	762,355.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	19,700	66.88	1,317,536.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,500	110.45	2,706,025.00	
	AMBEV SA	517,700	14.32	7,413,464.00	
	BRF SA	52,500	23.07	1,211,175.00	
	JBS SA	106,400	22.06	2,347,184.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	62,900	41.21	2,592,109.00	
	NATURA &CO HOLDING SA-RIGHTS	3,308	9.80	32,418.40	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	60.09	1,207,809.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	63.66	3,463,104.00	
	HYPERA SA	35,300	35.00	1,235,500.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	146,698	21.21	3,111,464.58	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	483,948	22.95	11,106,606.60	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	35.79	3,160,257.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	529,381	27.80	14,716,791.80	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	505,867	10.36	5,240,782.12	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	222,703	51.07	11,373,442.21	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	27.62	1,905,780.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	69,100	13.22	913,502.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	52.56	383,688.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,963	11.77	1,011,784.51	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	23.93	1,086,422.00	
	CIELO SA	99,269	4.84	480,461.96	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	49.00	2,562,700.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	96,100	14.48	1,391,528.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	33.21	587,817.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	31.87	1,070,832.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	98,092	12.05	1,182,008.60	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	7,900	67.14	530,406.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	55.30	1,918,910.00	
	CPFL ENERGIA SA	15,400	33.45	515,130.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	43.36	1,268,280.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	110,400	21.77	2,403,408.00	
ブラジルレアル 小計		6,277,467		167,361,794.89 (3,680,285,869)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	5,650.00	252,724,500.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,765.00	239,978,225.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,556	22,598.00	238,544,488.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,435.20	172,502,262.40	

	CENCOSUD SA	137,988	1,086.90	149,979,157.20	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,564	6,200.00	139,896,800.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,000.00	30,424,000.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	77.31	375,930,698.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,194	29,999.00	155,814,806.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	36.40	228,585,484.40	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,480.00	61,568,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,600.00	103,891,200.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	290.00	83,007,570.00	
	COLBUN SA	1,215,680	130.02	158,062,713.60	
	ENEL AMERICAS SA	3,990,008	136.50	544,636,092.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	64.10	164,177,919.80	
チリペソ 小計		19,698,858		3,099,723,916.80 (433,961,348)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,400.00	1,173,549,600.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	29,000.00	851,904,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	29,020.00	1,110,827,560.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	20,800.00	433,056,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	19,260.00	972,841,860.00	
コロンビアペソ 小計		627,964		4,542,179,020.00 (133,994,281)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,794	14.90	86,330.60	
	OPAP SA	17,668	9.33	164,930.78	
	JUMBO SA	14,899	16.03	238,830.97	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	12.00	314,484.00	
ユーロ 小計		64,568		804,576.35 (98,367,504)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	14.63	390,754.50	
イギリスポンド 小計		26,700		390,754.50 (53,595,887)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	88.60	1,028,025.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	8.63	1,007,595.65	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	49,783	31.64	1,575,134.12	
	KOC HOLDING AS	89,884	17.50	1,572,970.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	28,973	19.99	579,170.27	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	12.61	784,228.51	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	67.55	439,142.55	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	65.00	2,783,560.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	21,501	19.40	417,119.40	
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.86	1,619,241.06	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.18	1,963,134.56	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.10	882,361.20	

	YAPI VE KREDI BANKASI	246,063	2.39	588,090.57	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	9.04	1,033,977.12	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	14.22	2,034,754.02	
トルコリラ 小計		1,622,872		18,308,504.83 (290,372,886)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	592.00	4,418,096.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	58.50	4,021,758.00	
	CEZ AS	18,145	498.50	9,045,282.50	
チェココルナ 小計		94,356		17,485,136.50 (80,431,627)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,012.00	85,218,260.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,015.00	106,473,670.00	
	OTP BANK NYRT	24,834	11,530.00	286,336,020.00	
ハンガリーフォリント 小計		82,367		478,027,950.00 (169,699,922)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	11,057	64.64	714,724.48	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	69.52	2,135,167.76	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	259,894	4.49	1,167,963.63	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	88.62	1,163,757.84	
	LPP SA	124	7,640.00	947,360.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	385.90	2,587,073.60	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.06	659,466.12	
	DINO POLSKA SA	4,430	189.90	841,257.00	
	BANK PEKAO SA	22,583	58.14	1,312,975.62	
	M BANK SA	1,663	254.80	423,732.40	
	PKO BANK POLSKI SA	104,297	24.24	2,528,159.28	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	187.00	676,005.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	31.25	1,938,875.00	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.54	364,003.32	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.01	445,106.96	
ポーランドズロチ 小計		662,912		17,905,628.01 (492,583,826)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	8.57	1,645,440.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,739,400	3.68	10,080,992.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	392,500	13.30	5,220,250.00	
	CNOOC LTD-R	1,883,000	9.55	17,982,650.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.03	346,580.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,382,000	2.87	6,836,340.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.49	921,580.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	1.61	547,400.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	124,000	54.50	6,758,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	3.53	358,295.00	

CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	642,000	2.61	1,675,620.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	8.84	3,642,080.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	9.52	2,741,760.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	8.34	692,220.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	4.52	750,320.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.45	961,050.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	557,000	2.12	1,180,840.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	8.79	795,495.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.35	2,442,150.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	3.99	494,760.00	
BOC AVIATION LTD	32,500	53.60	1,742,000.00	
CHINA COMMUICATIONS CONST-H	519,000	5.02	2,605,380.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	5.30	1,038,800.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	35.10	5,598,450.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	79,000	10.86	857,940.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	7.21	1,380,715.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.34	2,057,160.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	5.50	935,000.00	
CITIC LTD	677,000	8.16	5,524,320.00	
CRRC CORP LTD-H	511,050	3.90	1,993,095.00	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	10.32	2,972,160.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	16.26	1,268,280.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.32	389,760.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	12.54	476,520.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.41	243,815.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	97,500	20.30	1,979,250.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	14.78	3,130,404.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	7.89	247,872.24	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	23.30	1,451,590.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	6.21	721,602.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	41,500	40.85	1,695,275.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	4.37	1,682,773.38	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	35.40	4,814,400.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	10.00	1,800,000.00	
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.40	1,155,600.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	5.63	608,040.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	308,000	3.18	979,440.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.34	1,711,755.98	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.13	726,880.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	474,000	2.26	1,071,240.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	232,344	4.32	1,003,726.08	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	9.44	1,472,640.00	

SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	64,000	8.40	537,600.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	13.30	1,701,362.60	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	5.76	506,880.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	3.54	414,180.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.37	2,712,160.00	
BYD CO LTD-H	82,500	52.25	4,310,625.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.39	1,433,740.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	19.44	528,768.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	518,000	12.42	6,433,560.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	5.48	1,933,070.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.00	1,766,408.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	73.95	8,208,450.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	2.13	413,220.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	23.20	2,691,200.00	
LI NING CO LTD	217,000	25.10	5,446,700.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	76,900	102.20	7,859,180.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	15.16	682,200.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	12.78	894,600.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	6.73	646,080.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	68,000	36.45	2,478,600.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	22,500	31.75	714,375.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.10	1,595,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	32,200	46.10	1,484,420.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	603,900	433.80	261,971,820.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	1.40	831,541.20	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	369,800	151.50	56,024,700.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	14.64	1,001,376.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	11.20	1,276,800.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	39.90	2,713,200.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	11.24	2,911,160.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	200	83.45	16,690.00	
CHINA FEIHE LTD	64,000	14.20	908,800.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	30.80	8,654,800.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	44.40	6,304,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.93	1,212,780.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.18	3,005,040.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	55.90	2,571,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.00	640,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.89	3,298,400.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	68.30	3,278,400.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	78,500	61.10	4,796,350.00	

VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	23.95	598,750.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	30,000	22.75	682,500.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	358,000	19.70	7,052,600.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	33,500	101.00	3,383,500.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	15.86	3,869,840.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.20	1,694,880.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	20.55	2,572,860.00	
3SBIO INC	119,000	9.99	1,188,810.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	5,800	184.50	1,070,100.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	9.33	933,000.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	498,000	15.90	7,918,200.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.71	741,825.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.60	597,600.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	17.70	1,451,400.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	64,000	35.95	2,300,800.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	94,000	48.35	4,544,900.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	4.48	365,120.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	25.95	1,440,225.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	742,000	13.68	10,150,560.00	
SSY GROUP LTD	114,000	5.26	599,640.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	26,740	85.75	2,292,955.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	91,500	125.70	11,501,550.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,152,000	3.17	9,991,840.00	
BANK OF CHINA LTD-H	8,635,200	2.98	25,732,896.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.92	5,404,497.00	
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.51	3,338,712.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,118,620	6.34	64,152,050.80	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	3.02	2,068,700.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	436,923	38.60	16,865,227.80	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	5.47	3,688,968.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.15	475,650.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,464,515	5.21	33,680,123.15	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	882,000	4.94	4,357,080.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.54	1,281,280.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	11.48	1,538,320.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.03	1,323,855.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	0.84	778,680.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	14.26	1,882,320.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	15.16	3,767,260.00	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.90	1,656,000.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.54	756,644.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	109,400	11.32	1,238,408.00	

HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.40	2,286,080.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	209,200	12.66	2,648,472.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	831,000	17.04	14,160,240.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	23.70	7,029,420.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	0.87	207,930.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	13.08	2,407,033.92	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	27.40	2,641,360.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.55	2,394,450.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.44	5,128,302.72	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	605,500	82.20	49,772,100.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	29.40	1,343,580.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	9.20	1,306,400.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	8.78	1,106,280.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	18.86	3,507,960.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	5.84	3,375,520.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	409,040	25.30	10,348,712.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	7.88	630,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	347,111	32.80	11,385,240.80	
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	26.35	4,700,840.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.67	1,840,920.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	865,154	10.28	8,893,783.12	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	204,000	7.62	1,554,480.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	9.25	1,250,600.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.28	511,680.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	13.02	1,985,550.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	150,000	13.16	1,974,000.00	
LONGFOR PROPERTIES	197,000	36.30	7,151,100.00	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	8,000	80.80	646,400.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.45	823,200.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	33.65	4,458,625.00	
SHUI ON LAND LTD	651,000	1.37	891,870.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	1.97	1,041,324.27	
SOHO CHINA LTD	291,500	2.90	845,350.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	36.80	9,236,800.00	
WHARF HOLDINGS	100,000	16.08	1,608,000.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.46	843,880.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	332,086	3.67	1,218,755.62	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	5.10	668,100.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	13.72	3,320,240.00	
KINGSOFT CORP LTD	92,000	25.65	2,359,800.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	17.30	1,366,700.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	43.15	3,085,225.00	

	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	16.74	1,422,900.00	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	3.71	875,560.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	20.30	1,360,100.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.46	514,740.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	9.97	210,367.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	4.34	3,176,880.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	75,500	114.30	8,629,650.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,109,600	12.98	14,402,608.00	
	ZTE CORP-H	82,908	22.00	1,823,976.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	654,500	55.90	36,586,550.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	2.47	3,349,320.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.54	7,031,640.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	618,000	4.65	2,873,700.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	28.35	1,686,825.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.18	1,939,800.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.72	2,308,240.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	253,600	28.35	7,189,560.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	431,000	4.24	1,827,440.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.76	1,172,160.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	42.30	3,637,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	9.41	1,650,514.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	84,700	94.35	7,991,445.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	15.44	4,940,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.04	1,124,800.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	5.01	1,803,600.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	18.58	836,100.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	310,500	19.44	6,036,120.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	376,453	6.36	2,394,241.08	
香港ドル 小計		95,342,933		1,101,904,408.76 (15,327,490,325)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.80	1,571,938.40	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	22.44	563,244.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	6.89	1,859,611.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.75	685,425.00	
	GAMUDA BHD	141,520	3.87	547,682.40	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	8.81	336,542.00	
	IJM CORP BHD	198,100	1.95	386,295.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.21	743,324.66	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.10	650,223.40	
	MISC BHD	125,040	8.25	1,031,580.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.86	270,200.00	

	GENTING BHD	307,200	4.77	1,465,344.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.71	1,001,887.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	13,200	25.10	331,320.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	21,300	32.20	685,860.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.18	142,520.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.39	788,619.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	55,646	22.48	1,250,922.08	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	140.00	966,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	17.46	919,792.80	
	QL RESOURCES BHD	83,200	9.20	765,440.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.95	1,222,877.70	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	12.52	1,985,672.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.63	1,290,959.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	168,300	17.00	2,861,100.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	265,600	3.40	903,040.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	517,519	4.04	2,090,776.76	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	15.12	926,735.04	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	46,033	15.04	692,336.32	
	MALAYAN BANKING BHD	404,004	8.20	3,312,832.80	
	PUBLIC BANK BERHAD	324,420	17.38	5,638,419.60	
	RHB BANK BHD	206,419	5.38	1,110,534.22	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.65	1,041,304.85	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.40	1,371,480.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.32	1,425,228.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	4.35	306,901.20	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	17.70	1,336,350.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	275,175	11.90	3,274,582.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.90	228,390.32	
マレーシアリンギット 小計		7,139,248		47,983,291.65 (1,210,618,448)	
タイバーツ	IRPC PCL - NVDR	829,500	2.84	2,355,780.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	95.50	12,835,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,253,200	39.00	48,874,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	46.50	5,584,650.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	30.75	6,346,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	48.75	10,965,532.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	367.00	29,727,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	65.75	28,147,575.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	10.00	8,170,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	11.90	9,633,050.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	323,310	23.90	7,727,109.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	743,535	15.50	11,524,792.50	

	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	41.75	7,414,800.00	
	CP ALL PCL-NVDR	657,100	71.50	46,982,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	458,200	32.00	14,662,400.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	40.25	2,656,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	449,700	12.80	5,756,160.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,083,700	23.00	24,925,100.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	121.00	3,968,800.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	123.00	6,383,700.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	113.00	14,283,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	113.00	8,847,900.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	11.80	5,176,070.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127,400	87.75	11,179,350.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,147,300	1.22	3,839,706.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	25.00	4,127,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	56.25	5,051,250.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	60.00	4,578,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	53.50	12,107,050.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.85	6,845,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	195.00	23,341,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	56.25	13,708,125.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	42.75	2,821,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.84	3,691,810.56	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	53.75	2,870,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	36,000	272.00	9,792,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	41.75	7,744,625.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	78.50	5,353,700.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	262,000	37.25	9,759,500.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	67.25	3,651,675.00	
タイバーツ 小計		16,345,738		453,412,310.56 (1,564,272,471)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	51.95	12,360,983.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	800.00	22,624,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	530.00	3,634,740.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	289,060	66.50	19,222,490.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	950.00	21,664,750.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	107.00	15,461,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	138.90	8,474,289.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	87,300	45.55	3,976,515.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	149.00	14,238,440.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	77.30	4,626,018.50	
	BDO UNIBANK INC	219,911	110.50	24,300,165.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	42.00	6,774,054.00	

	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.55	8,362,735.00	
	AYALA LAND INC	742,900	38.00	28,230,200.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	3.30	2,105,400.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	20.10	1,869,300.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,156,150	33.50	38,731,025.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,170.00	10,177,300.00	
	PLDT INC	10,460	1,194.00	12,489,240.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	28.80	2,577,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	291.00	8,471,010.00	
フィリピンペソ 小計		6,533,866		270,371,755.00 (584,002,990)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,180.00	1,698,374,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	17,775.00	3,570,997,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	1,225.00	3,531,062,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	5,825.00	1,422,465,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	12,625.00	2,398,750,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	9,450.00	3,265,920,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	5,000.00	10,763,500,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,485.00	1,344,964,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	792,300	5,825.00	4,615,147,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	48,375.00	2,883,150,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	1,805.00	1,656,809,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,900.00	1,432,900,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,300.00	2,703,330,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	8,300.00	6,195,120,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,410.00	3,885,819,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,051,000	29,025.00	30,505,275,000.00	
	BANK MANDIRI	1,813,696	5,275.00	9,567,246,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	4,860.00	3,937,572,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,498,800	3,210.00	17,651,148,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	5,349,700	3,140.00	16,798,058,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	387,000	2,650.00	1,025,550,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	1,095.00	866,692,500.00	
インドネシアルピア 小計		29,924,996		131,719,851,400.00 (1,027,414,840)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	40,400.00	266,357,200.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	75,100.00	333,969,700.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	125,500.00	701,043,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	18,350.00	196,455,100.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	24,950.00	180,687,900.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	378,000.00	295,974,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,512	76,200.00	191,414,400.00	

LG CHEM LTD	4,819	432,500.00	2,084,217,500.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,129	202,000.00	228,058,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	188,000.00	362,840,000.00	
POSCO	7,998	198,500.00	1,587,603,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	63,300.00	215,156,700.00	
CJ CORP	1,230	91,000.00	111,930,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,217	92,200.00	296,607,400.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	33,865	3,960.00	134,105,400.00	
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	30,000.00	129,240,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	28,700.00	194,012,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,825	28,950.00	81,783,750.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	35,700.00	329,832,300.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,348	287,000.00	386,876,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10,619	27,000.00	286,713,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	102,000.00	444,108,000.00	
LG CORP	9,902	72,500.00	717,895,000.00	
LOTTE CORP	2,370	36,850.00	87,334,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	15,350.00	91,915,800.00	
SAMSUNG C&T CORP	8,727	112,500.00	981,787,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	13,200.00	244,411,200.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	6,790.00	252,255,290.00	
SK HOLDINGS CO LTD	3,449	253,500.00	874,321,500.00	
S-1 CORPORATION	2,394	90,900.00	217,614,600.00	
CJ LOGISTICS	862	161,000.00	138,782,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,307	120,000.00	276,840,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	21,100.00	116,134,400.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	3,860.00	114,780,960.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	25,000.00	176,650,000.00	
HANON SYSTEMS	19,000	10,200.00	193,800,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,916	214,500.00	1,483,482,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	15,682	112,000.00	1,756,384,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,286	69,600.00	298,305,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	63,800.00	191,591,400.00	
KIA MOTORS CORPORATION	26,639	36,700.00	977,651,300.00	
COWAY CO LTD	5,058	72,800.00	368,222,400.00	
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	43,200.00	176,256,000.00	
HLB INC	3,701	111,800.00	413,771,800.00	
LG ELECTRONICS INC	11,019	66,600.00	733,865,400.00	
KANGWON LAND INC	13,208	25,350.00	334,822,800.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	18,000.00	91,260,000.00	
KAKAO CORP	5,728	254,500.00	1,457,776,000.00	
NAVER CORP	13,049	237,500.00	3,099,137,500.00	

NCSOFT CORPORATION	1,650	800,000.00	1,320,000,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	97,800.00	241,077,000.00	
PEARL ABYSS CORP	921	202,500.00	186,502,500.00	
CJ ENM CO LTD	830	123,400.00	102,422,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	81,600.00	248,961,600.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	65,400.00	79,918,800.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	92,300.00	95,438,200.00	
SHINSEGAE CO LTD	881	247,500.00	218,047,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	151,000.00	82,899,000.00	
EMART	1,864	118,500.00	220,884,000.00	
GS RETAIL CO LTD	4,060	39,700.00	161,182,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	305,500.00	236,762,500.00	
KT&G CORP	11,869	87,100.00	1,033,789,900.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,968	130,500.00	387,324,000.00	
OTTOGI CORPORATION	68	586,000.00	39,848,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,873	176,000.00	505,648,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	2,100	63,700.00	133,770,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,374,000.00	1,313,544,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	278	744,000.00	206,832,000.00	
PACIFIC CORP	3,393	58,000.00	196,794,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,381	98,800.00	630,442,800.00	
CELLTRION INC	10,296	263,500.00	2,712,996,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,242	135,600.00	168,415,200.00	
HANMI PHARM CO LTD	490	263,000.00	128,870,000.00	
HELIXMITH CO LTD	2,051	70,200.00	143,980,200.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,803	676,000.00	1,218,828,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,802	55,900.00	212,531,800.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,153	5,600.00	269,656,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	32,598	30,900.00	1,007,278,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	9,480.00	268,568,400.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	40,986	38,500.00	1,577,961,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	48,174	34,550.00	1,664,411,700.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	9,850.00	585,149,100.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	55,600.00	255,871,200.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,530.00	169,101,120.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,015	6,910.00	214,313,650.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,400.00	125,912,800.00	
SAMSUNG CARD CO	1,899	30,400.00	57,729,600.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	30,450.00	175,879,200.00	
DB INSURANCE CO LTD	4,209	50,300.00	211,712,700.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	27,700.00	252,097,700.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	199,000.00	618,492,000.00	

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	50,300.00	373,075,100.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	106,000.00	153,806,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	183,500.00	683,537,500.00	
	KMW CO LTD	1,901	60,300.00	114,630,300.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	12,650.00	304,498,150.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	157,500.00	222,862,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	128,500.00	719,985,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	501,244	55,500.00	27,819,042,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	85,728	48,000.00	4,114,944,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,738	383,500.00	2,200,523,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	13,100.00	289,837,500.00	
	SK TELECOM	2,172	221,000.00	480,012,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	30,309	22,550.00	683,467,950.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	30,700.00	139,316,600.00	
	SK HYNIX INC	57,001	89,800.00	5,118,689,800.00	
韓国ウォン 小計		1,606,998		88,006,105,370.00 (7,920,549,483)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	96.00	10,775,040.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	44.85	10,502,793.60	
	CHINA STEEL	1,266,261	21.30	26,971,359.30	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	396,061	77.00	30,496,697.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	413,824	89.50	37,037,248.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	548,752	67.00	36,766,384.00	
	TAIWAN CEMENT	540,479	43.90	23,727,028.10	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	519.00	6,228,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	28.40	9,883,995.20	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,237	309.50	6,572,851.50	
	CHINA AIRLINES LTD	437,203	8.83	3,860,502.49	
	EVA AIRWAYS CORP	164,159	12.20	2,002,739.80	
	EVERGREEN MARINE	359,039	11.30	4,057,140.70	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	38.50	6,814,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	35.40	6,267,959.40	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	346.50	6,908,170.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	36,207	192.50	6,969,847.50	
	FORMOSA TAFFETA CO.	121,000	39.45	4,773,450.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	249.50	6,353,268.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	262.50	4,200,000.00	
	POU CHEN	273,780	30.25	8,281,845.00	
	TATUNG CO LTD	210,000	21.65	4,546,500.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	648.00	19,440,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	294.50	17,535,708.00	
	STANDARD FOODS CORP	35,756	65.50	2,342,018.00	

UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	526,395	73.90	38,900,590.50	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	559,468	20.15	11,273,280.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,899,237	21.05	39,978,938.85	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,071,573	28.20	30,218,358.60	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,004,094	23.10	23,194,571.40	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	912,945	20.35	18,578,430.75	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,173,339	31.85	37,370,847.15	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	12.25	14,171,890.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,201,768	13.50	16,223,868.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	476,620	11.15	5,314,313.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,055,621	21.25	22,431,946.25	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	46.10	15,252,692.10	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	132,022	126.00	16,634,772.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,125,153	18.15	20,421,526.95	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	823,123	42.00	34,571,166.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.48	11,914,274.40	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	307,791	22.50	6,925,297.50	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	710,082	44.00	31,243,608.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	8.96	10,712,011.52	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	103,120	46.50	4,795,080.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	98,440	49.40	4,862,936.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	209.50	10,056,000.00	
ACER INC	255,803	17.60	4,502,132.80	
ADVANTECH CO LTD	39,402	295.00	11,623,590.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	76,092	220.50	16,778,286.00	
AU OPTRONICS CORP	945,090	8.99	8,496,359.10	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	223.50	15,577,950.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	87.00	5,375,904.00	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	7.77	6,021,750.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	19.20	8,289,792.00	
DELTA ELECTRONICS INC	209,903	159.00	33,374,577.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	55.40	5,143,890.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,287,248	79.50	102,336,216.00	
INVENTEC CO LTD	280,511	26.15	7,335,362.65	
LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	4,390.00	48,465,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	50.60	11,407,871.20	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	107.50	6,450,000.00	
PEGATRON CORP	200,474	66.00	13,231,284.00	
QUANTA COMPUTER INC	286,270	70.80	20,267,916.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	45.85	5,873,385.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	197.50	5,332,500.00	
WISTRON CORP	355,695	31.15	11,079,899.25	

	WIWYNN CORP	8,000	790.00	6,320,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	40.45	5,812,341.40	
	YAGEO CORPORATION	22,764	392.50	8,934,870.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	138.00	8,269,236.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	371,315	113.00	41,958,595.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	67.90	10,660,300.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	178,200	107.50	19,156,500.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	349,315	66.20	23,124,653.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	398.00	9,552,000.00	
	MEDIATEK INC	160,804	497.50	79,999,990.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	154,000	63.40	9,763,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	217.00	12,595,765.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	293.50	3,404,306.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	99,770	103.00	10,276,310.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	271.00	13,805,824.00	
	SILERGY CORP	7,000	1,640.00	11,480,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,582,389	319.00	823,782,091.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	16.85	20,388,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	75.80	6,746,200.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	282.00	9,024,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	14.05	4,903,450.00	
新台湾ドル 小計		35,142,007		2,215,284,242.41 (8,019,328,957)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	381.50	25,224,780.00	
	COAL INDIA LTD	147,331	144.30	21,259,863.30	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	211.65	12,577,301.25	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	90.65	17,564,797.25	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	90.00	22,743,810.00	
	PETRONET LNG LTD	83,779	257.75	21,594,037.25	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	306,633	1,537.15	471,340,915.95	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	187.80	13,809,497.40	
	ASIAN PAINTS LTD	28,520	1,642.05	46,831,266.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	16,698	490.45	8,189,534.10	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	41,773	611.90	25,560,898.70	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	142.60	17,305,508.20	
	JSW STEEL LTD	80,284	190.05	15,257,974.20	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,467.30	18,000,836.40	
	SHREE CEMENT LTD	901	21,009.80	18,929,829.80	
	TATA STEEL LTD	39,709	332.20	13,191,329.80	
	ULTRATECH CEMENT LTD	10,743	3,791.35	40,730,473.05	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	430.60	23,340,242.40	
	VEDANTA LTD	198,772	104.60	20,791,551.20	

HAVELLS INDIA LTD	23,476	546.40	12,827,286.40	
LARSEN & TOUBRO LTD	49,730	953.30	47,407,609.00	
SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,122.75	6,653,416.50	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	346.05	21,637,122.30	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	419.60	11,100,518.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,080.35	9,031,726.00	
BAJAJ AUTO LTD	8,362	2,791.15	23,339,596.30	
BHARAT FORGE LTD	30,322	362.15	10,981,112.30	
BOSCH LTD	965	11,189.35	10,797,722.75	
EICHER MOTORS LTD	1,254	17,026.85	21,351,669.90	
HERO MOTOCORP LTD	10,359	2,387.30	24,730,040.70	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	478.75	36,226,533.75	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,151	5,662.30	68,802,607.30	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	99.05	7,610,704.85	
TATA MOTORS LTD	190,082	111.45	21,184,638.90	
PAGE INDUSTRIES LTD	601	19,256.80	11,573,336.80	
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	997.10	32,794,619.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,132	1,666.85	8,554,274.20	
INFO EDGE INDIA LTD	6,428	2,703.15	17,375,848.20	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	192.40	15,290,605.20	
AVENUE SUPERMARTS LTD	14,325	2,390.10	34,238,182.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	3,415.70	17,447,395.60	
ITC LTD	388,437	198.50	77,104,744.50	
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	16,552.55	39,643,357.25	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	28,688	384.25	11,023,364.00	
UNITED SPIRITS LTD	32,483	608.20	19,756,160.60	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	5,255	1,375.10	7,226,150.50	
DABUR INDIA LTD	58,111	466.55	27,111,687.05	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	659.35	25,361,238.40	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	87,189	2,106.50	183,663,628.50	
MARICO LTD	42,465	333.85	14,176,940.25	
AUROBINDO PHARMA LTD	28,844	774.95	22,352,657.80	
BIOCON LTD	17,686	381.65	6,749,861.90	
CIPLA LTD	37,891	640.05	24,252,134.55	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	2,421.80	21,936,664.40	
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,123.80	52,141,327.20	
LUPIN LTD	26,552	919.40	24,411,908.80	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,063.55	12,466,933.10	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	500.75	41,537,212.50	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,552	2,376.95	8,442,926.40	
AXIS BANK LTD	228,324	420.05	95,907,496.20	
BANDHAN BANK LTD	36,073	259.85	9,373,569.05	

	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	177,443	1,772.10	314,446,740.30	
	ICICI BANK LTD	515,616	348.55	179,717,956.80	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	253.60	7,093,445.60	
	STATE BANK OF INDIA	187,504	184.45	34,585,112.80	
	BAJAJ FINANCE LTD	18,080	2,443.60	44,180,288.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,634.40	10,787,868.00	
	REC LTD	48,168	96.80	4,662,662.40	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	19,022	619.60	11,786,031.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	5,310.80	20,648,390.40	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	62,014	506.85	31,431,795.90	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	17,954	1,314.35	23,597,839.90	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	393.70	12,492,888.40	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	32,481	758.50	24,636,838.50	
	DLF LTD	56,420	153.35	8,652,007.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	122,073	572.85	69,929,518.05	
	INFOSYS LTD	365,523	717.60	262,299,304.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	96,664	2,072.05	200,292,641.20	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	586.20	28,169,841.00	
	WIPRO LTD	118,712	218.35	25,920,765.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	263,301	567.80	149,502,307.80	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	233.00	8,342,332.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	101.10	17,669,044.80	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	13,220	463.45	6,126,809.00	
	NTPC LTD	260,019	98.00	25,481,862.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	170.55	34,342,800.75	
インドルピー 小計		6,595,630		3,606,638,067.45 (5,193,558,817)	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	116.82	8,527,860.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	102.12	6,790,980.00	
	MCB BANK LTD	53,300	163.70	8,725,210.00	
パキスタンルピー 小計		192,800		24,044,050.00 (15,869,073)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	57,358	17.00	975,086.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.10	932,242.50	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	8.60	1,692,376.80	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	3.96	809,228.33	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	3.90	1,589,164.86	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	8.19	808,085.24	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	16.00	1,827,680.00	
	QATAR NATIONAL BANK	470,710	17.80	8,378,638.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.95	613,132.95	
	OOREDOO QSC	72,800	6.72	489,871.20	

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	16.10	1,004,978.10	
カタールリアル 小計		2,334,811		19,120,483.98 (562,142,229)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,900	139.00	4,851,100.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	7,385	1,165.20	8,605,002.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,716	413.18	18,475,756.88	
	GOLD FIELDS LTD	89,344	129.05	11,529,843.20	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	77,953	134.11	10,454,276.83	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	492.85	2,647,590.20	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	117.83	4,000,328.50	
	SASOL LTD	57,207	171.45	9,808,140.15	
	SIBANYE STILLWATER LTD	218,901	37.40	8,186,897.40	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	164.52	4,557,533.04	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	94.60	3,834,043.40	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	148.10	4,222,331.00	
	NASPERS LTD-N SHS	46,871	2,891.00	135,504,061.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	83,044	13.42	1,114,450.48	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	34.39	3,799,923.05	
	BID CORP LTD	33,071	268.12	8,866,996.52	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	227.00	6,111,067.00	
	PICK N PAY STORES LTD	45,989	54.80	2,520,197.20	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	58,453	110.00	6,429,830.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	186.89	4,349,677.86	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	174.76	2,275,899.48	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	18.96	2,968,055.28	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	145.20	5,407,828.80	
	ABSA GROUP LTD	73,296	98.76	7,238,712.96	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,385	990.00	4,341,150.00	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	121.74	4,630,624.38	
	STANDARD BANK GROUP LTD	142,629	115.85	16,523,569.65	
	FIRSTRAND LTD	377,344	45.25	17,074,816.00	
	PSG GROUP LTD	18,494	184.40	3,410,293.60	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	306.00	5,259,222.00	
	REMGRO LTD	55,441	115.02	6,376,823.82	
	RMB HOLDINGS LTD	113,172	59.80	6,767,685.60	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	115.15	4,029,789.40	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	19.15	1,303,693.70	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	12.64	6,188,695.68	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	31.08	3,147,409.44	
	SANLAM LTD	221,098	61.72	13,646,168.56	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	32,121	95.90	3,080,403.90	
	MTN GROUP LTD	173,000	57.89	10,014,970.00	

	VODACOM GROUP	62,331	129.27	8,057,528.37	
南アフリカランド 小計		3,323,886		391,612,386.33 (2,541,564,387)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	5.05	1,360,924.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	3.96	509,208.48	
	EMIRATES NBD PJSC	112,010	9.35	1,047,293.50	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	11.64	3,297,169.68	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	509,421	1.75	891,486.75	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.38	247,907.34	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	2.83	1,089,663.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	200,413	16.40	3,286,773.20	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		2,067,867		11,730,426.65 (344,757,239)	
香港・オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	6.13	557,217.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	7.18	274,994.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	5.60	491,680.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	8.78	537,336.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	2.86	469,898.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	56.56	1,665,126.40	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	4.58	177,246.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	22,500	38.12	857,700.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	9.60	512,640.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.73	546,483.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.09	502,490.00	
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	12.99	501,024.30	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.10	249,490.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.05	451,205.00	
	SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	69,000	7.01	483,690.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	5,180	35.95	186,221.00	
	SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	23,600	26.82	632,952.00	
	TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	17.58	72,078.00	
	TIANQI LITHIUM CORP-A	31,500	22.65	713,475.00	
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	43,200	12.83	554,256.00	
	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.74	529,228.00	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	49.50	866,250.00	
	WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	58.74	541,582.80	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	64.82	674,128.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15,600	35.25	549,900.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	13.08	308,688.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.74	297,160.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	23.42	266,988.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	17.20	292,400.00	

BEIJING NEW BUILDING MATER-A	25,000	22.84	571,000.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	6.05	584,430.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	63,200	8.81	556,792.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	110,200	4.09	450,718.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	16,100	32.26	519,386.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.09	1,073,481.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	153.96	2,063,064.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	1.92	719,232.00	
CRRC CORP LTD-A	79,000	5.88	464,520.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	24,521	38.85	952,640.85	
GUOCHENG MINING CO LTD-A	31,100	18.40	572,240.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	45.75	622,200.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	12,200	73.55	897,310.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	18.98	922,428.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	3.49	569,568.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	19.24	806,156.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	34.56	705,024.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,400	16.52	617,848.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	8.00	180,800.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	14.20	613,440.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	10.05	202,115.55	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	25.71	812,436.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	67.73	559,449.80	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	19.32	911,710.80	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	11.88	526,284.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.97	642,382.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	37,300	17.73	661,329.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	52.07	572,770.00	
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.29	188,811.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.65	186,000.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	7.05	862,215.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	16.44	509,640.00	
S F HOLDING CO LTD-A	13,700	52.45	718,565.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	75.93	403,871.67	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.25	188,700.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	38.69	321,127.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	16,800	38.92	653,856.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	104,734	6.08	636,782.72	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	22.04	822,092.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	21.78	747,054.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	22.64	663,352.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	18.30	779,580.00	

GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	61.92	1,145,520.00	
NAVINFO CO LTD-A	33,200	15.78	523,896.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	5,500	113.40	623,700.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	17.38	451,880.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	30,100	22.78	685,678.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	6.08	482,144.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	19.66	658,216.80	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	12.13	650,168.00	
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	13.60	231,200.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.42	755,548.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	1,800	408.98	736,164.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	51.78	844,014.00	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	19.12	315,480.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	9.75	803,010.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	15,200	47.06	715,312.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	36.80	901,600.00	
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	22,800	21.35	486,780.00	
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	169,400	3.35	567,490.00	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	110.00	1,628,000.00	
HLA CORP LTD-A	21,400	6.17	132,038.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	17.77	302,090.00	
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	9.03	413,574.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,800	77.00	600,600.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	9.01	364,905.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	18,700	43.33	810,271.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	4,800	148.39	712,272.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	49.39	108,658.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	7.75	461,125.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	58.18	599,254.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	54.60	546,000.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	21,100	33.65	710,015.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	14,160	113.87	1,612,399.20	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	25.07	686,918.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	45.61	775,370.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	32,400	39.89	1,292,436.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	30.55	1,047,926.10	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	38.76	670,548.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	112.70	1,025,570.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	52.39	602,485.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,416.55	10,765,780.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	95.79	938,742.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	23,970	69.40	1,663,518.00	

NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	28.06	752,008.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	134.99	904,433.00	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	14.83	468,628.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	31,800	27.43	872,274.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	162.61	3,447,332.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	16.11	85,383.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	19.20	570,240.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,914	40.59	727,129.26	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	156.24	781,200.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	77.80	220,796.40	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	23.30	226,476.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	62.17	767,799.50	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	18.13	188,552.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	34.03	503,644.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	11.58	287,647.20	
OVCTEK CHINA INC-A	13,950	58.35	813,982.50	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	272.53	1,444,409.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	4,700	145.80	685,260.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	29,100	22.81	663,771.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,800	219.91	835,658.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	19,500	41.01	799,695.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	7,400	112.14	829,836.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	122.95	676,225.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	334.80	736,560.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	38.62	590,886.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	28.15	287,130.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	89.13	882,387.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	34.04	755,449.72	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	33.01	528,160.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	82.70	661,600.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	40.60	765,310.00	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	26,926	22.97	618,490.22	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	31,752	82.97	2,634,463.44	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	12,600	60.76	765,576.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	8.25	528,825.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	137.89	937,652.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	21.00	147,000.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	21.39	240,252.48	
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	103,300	5.27	544,391.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	15.82	308,490.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	47.38	805,460.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	8,820	79.90	704,718.00	

YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	20.89	545,229.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	86.93	617,203.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	154.50	602,550.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	29.30	264,286.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	27.49	665,258.00	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	61.70	598,490.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.42	1,209,312.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.95	287,100.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	5.15	509,335.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	5.99	346,222.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	7.87	397,435.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	26.99	647,760.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.16	371,280.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.43	803,107.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.83	493,687.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	35.53	3,727,097.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.78	1,581,408.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.38	761,772.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.26	1,373,912.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	16.25	1,547,000.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	13.67	1,632,198.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.68	1,477,044.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	3.89	476,525.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	6.26	124,574.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	56,200	17.16	964,392.00	
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	23.29	1,006,128.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	33.94	817,954.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	102,600	15.72	1,612,872.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	11.18	1,138,124.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	7.05	583,740.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	13.76	833,856.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	116.31	628,074.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	7.16	310,744.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	5.85	514,215.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	9.38	297,346.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	45,800	12.14	556,012.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.51	934,472.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	30.29	551,278.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	76.50	5,110,200.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	22.55	315,700.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	16.98	928,806.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	26.44	1,419,828.00	

GEMDALE CORP-A	45,500	13.80	627,900.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	5.54	651,504.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	8.19	576,248.40	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	14.95	1,222,910.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	32.99	422,272.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	19.70	167,450.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	18.78	505,182.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	33.87	457,245.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	24.94	718,272.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	77.90	521,930.00	
GLODON CO LTD-A	15,400	58.46	900,284.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	86.00	782,600.00	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	33.63	363,204.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	175.86	527,580.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	4,700	55.35	260,145.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	38,870	35.42	1,376,775.40	
ADDSINO CO LTD -A	34,700	14.30	496,210.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	36.78	492,852.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.60	527,160.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	21.01	588,280.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	13.50	469,800.00	
DAWNING INFORMATION INDUST-A	5,640	37.24	210,033.60	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	29.55	614,640.00	
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	15,400	34.16	526,064.00	
GOERTEK INC -A	26,900	23.20	624,080.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	11.17	558,500.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	93.00	651,000.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	58,500	29.25	1,711,125.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	38.44	757,729.28	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	38,500	20.89	804,265.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	45,732	51.60	2,359,771.20	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	157.33	487,723.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	16.60	519,580.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	27.65	671,895.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	158.20	753,032.00	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	23.51	552,485.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	48.03	643,602.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	28.50	812,250.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	14.71	691,370.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	13,100	38.28	501,468.00	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	19.64	54,992.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	109.96	461,832.00	

	WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	21,080	25.55	538,594.00	
	YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	62.49	703,012.50	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	17.74	537,522.00	
	ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	59.30	515,910.00	
	ZTE CORP-A	12,600	38.75	488,250.00	
	CHINA UNITED NETWORK-A	166,400	5.05	840,320.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.14	719,532.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	18.02	2,414,680.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.52	1,050,016.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	8.00	540,800.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.39	808,500.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	2.60	214,500.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,480	226.98	1,016,870.40	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	35,600	14.69	522,964.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	32.46	529,098.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	25.16	1,021,496.00	
	SG MICRO CORP-A	1,400	242.00	338,800.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	230.18	598,468.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	23.69	532,219.54	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	11,700	66.76	781,092.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	43,600	13.80	601,680.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,900	190.35	552,015.00	
香港・オフショア人民元 小計		12,009,772		195,912,508.03 (2,983,747,497)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	13.88	326,998.92	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	129,846	32.30	4,194,025.80	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	51.00	500,004.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	10.12	323,111.36	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	14.16	457,127.28	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	19,671	79.70	1,567,778.70	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	37.85	1,702,644.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	91,783	88.70	8,141,152.10	
	SAUDI CEMENT	7,489	49.75	372,577.75	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	19.44	409,386.96	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	8.60	568,580.40	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	51.70	1,372,945.20	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	76.40	338,604.80	
	JARIR MARKETING CO	7,199	139.60	1,004,980.40	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	113.40	422,415.00	
	ALMARAI CO	30,130	54.40	1,639,072.00	
	SAVOLA	25,336	44.90	1,137,586.40	
	AL RAJHI BANK	135,049	59.30	8,008,405.70	

	ALINMA BANK	109,956	15.02	1,651,539.12	
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	21.70	1,250,744.60	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	11.38	407,551.94	
	BANK ALBILAD	45,859	22.16	1,016,235.44	
	BANQUE SAUDI FRANSI	57,797	32.90	1,901,521.30	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	148,866	39.35	5,857,877.10	
	RIYAD BANK	138,943	18.02	2,503,752.86	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	24.38	2,479,031.54	
	SAUDI BRITISH BANK	71,793	23.96	1,720,160.28	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	114.20	692,394.60	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	73.30	484,732.90	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	7.31	344,242.52	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	7.23	333,932.01	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	27.55	948,105.70	
	SAUDI TELECOM CO	60,811	99.20	6,032,451.20	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	15.94	1,470,002.74	
サウジアラビアリアル 小計		1,772,696		61,581,673.02 (1,772,320,549)	
合　計		260,825,260		66,148,099,201 (66,148,099,201)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	5,930,520.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	5,930,520.00 (29,237,463)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,665,732.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	58,600	1,868,754.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	816,585.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,271,328.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	26,962	1,235,398.84	
	ブラジルレアル 小計		192,062	6,857,797.84 (150,802,974)	
投資信託受益証券合計			250,462	180,040,437 (180,040,437)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	6,618,264.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	6,618,264.00 (32,628,041)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	4,558,476.15	

	南アフリカランド 小計	295,047	4,558,476.15 (29,584,510)	
投資証券合計		603,447	62,212,551 (62,212,551)	
合計			242,252,988 (242,252,988)	

(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　56銘柄	100.0%	—	—	15.7%
メキシコペソ	株式　22銘柄	95.1%	—	—	1.8%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.3%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	2.6%	0.0%
ブラジルレアル	株式　52銘柄	96.1%	—	—	5.5%
	投資信託受益証券　5銘柄	—	3.9%	—	0.2%
チリペソ	株式　16銘柄	100.0%	—	—	0.7%
コロンビアペソ	株式　5銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ユーロ	株式　4銘柄	100.0%	—	—	0.1%
イギリスポンド	株式　1銘柄	100.0%	—	—	0.1%
トルコリラ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.4%
チェココルナ	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.7%
香港ドル	株式　207銘柄	100.0%	—	—	23.1%
マレーシアリンギット	株式　39銘柄	100.0%	—	—	1.8%
タイバーツ	株式　40銘柄	100.0%	—	—	2.4%
フィリピンペソ	株式　21銘柄	100.0%	—	—	0.9%
インドネシアルピア	株式　22銘柄	100.0%	—	—	1.5%
韓国ウォン	株式　106銘柄	100.0%	—	—	11.9%
新台湾ドル	株式　88銘柄	100.0%	—	—	12.1%
インドルピー	株式　86銘柄	100.0%	—	—	7.8%
パキスタンルピー	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.0%

カタールリアル	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.8%
南アフリカランド	株式　40銘柄	98.8%	—	—	3.8%
	投資証券　1銘柄	—	—	1.2%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.5%
香港・オフショア人民元	株式　261銘柄	100.0%	—	—	4.5%
サウジアラビアリアル	株式　34銘柄	100.0%	—	—	2.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,645,570,592
コール・ローン	511,951,430
国債証券	55,008,705,318
未収利息	1,079,211,109
前払費用	145,767,731
流動資産合計	59,391,206,180
資産合計	59,391,206,180
負債の部	
流動負債	
前受収益	88,845
未払金	45,113,294
未払解約金	25,420,629
未払利息	754
その他未払費用	1,990
流動負債合計	70,625,512
負債合計	70,625,512
純資産の部	
元本等	
元本	35,123,332,856
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	24,197,247,812
元本等合計	59,320,580,668
純資産合計	59,320,580,668
負債純資産合計	59,391,206,180

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。
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 6月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	35,123,332,856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 1.6889円 (1万口当たり純資産額) (16,889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 6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 6月10日現在
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 6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。
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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	29,218,077,103円
期中追加設定元本額	8,442,295,578円
期中一部解約元本額	2,537,039,825円
期末元本額	35,123,332,856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	4,188,775,004円
世界経済インデックスファンド	6,019,888,421円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	4,562,994,325円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,674,977,297円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,820,277,757円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	97,574,996円
分散投資コア戦略ファンドＡ	245,654,901円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,180,609,008円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	281,844,557円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,618,086,797円
コア投資戦略ファンド（切替型）	86,647,214円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,111,036円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	89,740,544円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	162,325,592円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,286,631,751円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	130,432,840円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	145,104,413円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	236,795,714円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,211,495円
グローバル経済コア	723,454,550円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	28,048,658円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,567,889円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	158,309円

区分	2020年 6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）２０４０	240,067円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	89,180円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	54,310円
ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	91,154,984円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	90,137,520円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	310,097,432円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	311,584,720円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 6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	607,879,509
合計	607,879,509

(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	40,253,444.00	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	97,327,247.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	61,800,000.00	62,025,879.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	111,178,205.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	27,450,000.00	28,585,606.50	
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	85,033,092.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	118,294,860.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	56,200,000.00	61,988,881.00	

	MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	64,759,192.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	29,200,000.00	32,155,770.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	106,000,000.00	122,761,780.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	56,150,000.00	64,243,461.00	
	MBONO 8% 09/05/24	54,800,000.00	60,330,142.00	
	MBONO 8% 11/07/47	68,850,000.00	74,413,768.50	
	MBONO 8% 12/07/23	112,900,000.00	123,018,098.00	
メキシコペソ 小計		1,047,150,000.00	1,146,369,427.50 (5,651,601,277)	
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	27,196,313.17	
	BLTN 0% 01/01/24	11,800,000.00	9,862,986.34	
	BLTN 0% 07/01/21	24,650,000.00	24,002,496.26	
	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00	25,537,185.98	
	BLTN 0% 07/01/23	53,750,000.00	46,622,911.25	
	BNTNF 10% 01/01/23	47,100,000.00	53,435,285.82	
	BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000.00	41,253,925.57	
	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000.00	28,336,110.30	
	BNTNF 10% 01/01/29	13,200,000.00	15,842,166.50	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,548,750.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	504,843.75	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,018,750.00	
ブラジルレアル 小計		269,550,000.00	276,161,724.94 (6,072,796,331)	
チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,855,000,000.00	2,138,161,937.97	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,470,000,000.00	1,742,147,745.86	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,300,000,000.00	1,421,369,959.10	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,170,000,000.00	2,698,100,713.28	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,650,000,000.00	2,412,439,007.55	
チリペソ 小計		8,445,000,000.00	10,412,219,363.76 (1,457,710,710)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	90,300,000,000.00	114,209,634,000.00	
コロンビアペソ 小計		90,300,000,000.00	114,209,634,000.00 (3,369,184,203)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	4,021,435.75	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,400,000.00	5,749,353.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,650,000.00	4,215,421.50	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,197,332.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	8,032,675.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,200,000.00	9,645,168.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	9,127,350.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,000,000.00	8,542,485.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,289,517.00	

ペルーヌエボソル 小計		55,500,000.00	64,820,737.25 (2,028,889,075)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	14,169,870.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,320,331.50	
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	31,490,201.50 (79,670,209)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	18,819,306.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	21,019,500.00	
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	39,838,806.00 (74,498,567)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,927,465.25	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	8,127,713.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	9,395,831.25	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	8,150,000.00	8,393,603.50	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,150,000.00	8,838,900.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	5,600,000.00	5,764,164.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	10,490,634.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	5,370,014.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,967,260.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,801,619.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	6,438,802.50	
	TURKGB 8% 03/12/25	7,100,000.00	6,308,634.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,600,000.00	10,677,274.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	3,029,940.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,866,003.75	
トルコリラ 小計		107,000,000.00	106,397,858.25 (1,687,470,031)	
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	46,855,244.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	53,300,000.00	53,390,876.50	
	CZGB 0.95% 05/15/30	41,600,000.00	41,475,200.00	
	CZGB 1% 06/26/26	75,100,000.00	75,938,491.50	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	56,048,737.50	
	CZGB 2.5% 08/25/28	55,000,000.00	61,877,200.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	56,787,609.00	
	CZGB 2% 10/13/33	52,350,000.00	58,143,312.75	
	CZGB 3.85% 09/29/21	48,000,000.00	50,377,200.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	43,400,000.00	47,819,856.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	45,475,248.00	
チェココルナ 小計		555,350,000.00	594,188,975.25 (2,733,269,286)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	566,405,250.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	573,720,380.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	265,000,000.00	271,507,075.00	

	HGB 2.75% 12/22/26	462,500,000.00	490,201,437.50	
	HGB 3.25% 10/22/31	232,000,000.00	253,346,320.00	
	HGB 3% 06/26/24	512,500,000.00	546,189,187.50	
	HGB 3% 08/21/30	439,000,000.00	467,901,565.00	
	HGB 3% 10/27/27	678,000,000.00	728,633,040.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	786,175,500.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	617,632,650.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	451,812,160.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	314,699,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		5,495,000,000.00	6,068,223,565.00 (2,154,219,365)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	12,650,000.00	12,876,371.75	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,454,200.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	5,200,000.00	5,545,566.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	21,014,997.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000.00	16,033,875.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000.00	17,882,466.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000.00	17,819,701.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	12,950,000.00	14,364,981.75	
	POLGB 2.75% 10/25/29	13,050,000.00	14,661,153.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,824,100.00	
	POLGB 4% 10/25/23	16,250,000.00	18,154,337.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,198,817.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	5,350,000.00	5,761,736.00	
ポーランドズロチ 小計		169,200,000.00	183,592,303.25 (5,050,624,262)	
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	172,134,924.50	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	173,734,430.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	195,923,955.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	177,556,200.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	131,400,000.00	144,028,197.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	181,734,952.50	
	RFLB 7.4% 07/17/24	168,200,000.00	183,393,506.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	175,528,541.50	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	127,199,835.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	138,700,000.00	146,878,445.50	
	RFLB 7.65% 04/10/30	113,500,000.00	131,346,172.50	
	RFLB 7.7% 03/16/39	126,500,000.00	151,840,480.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	184,105,550.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	205,582,280.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	208,177,150.00	
	RFLB 7% 01/25/23	53,200,000.00	56,176,008.00	

	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	114,250,008.00	
	RFLB 7% 12/15/21	170,500,000.00	176,629,475.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	181,989,600.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	151,809,468.00	
ロシアルーブル 小計		2,918,650,000.00	3,240,019,178.50 (5,086,830,110)	
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,333,237.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	8,200,000.00	8,524,474.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	10,700,000.00	10,928,284.50	
	MGS 3.733% 06/15/28	12,450,000.00	13,154,856.75	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,034,857.75	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	9,030,773.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	7,200,000.00	7,590,024.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	15,650,000.00	16,687,125.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,348,137.50	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,539,238.75	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	8,932,518.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,953,984.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,000,000.00	7,417,760.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	11,850,000.00	12,120,298.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	10,051,492.50	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,700,000.00	7,680,444.50	
マレーシアリンギット 小計		149,000,000.00	157,327,506.25 (3,969,372,982)	
タイバーツ	THAIGB 1.45% 12/17/24	43,900,000.00	45,167,173.50	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	37,400,000.00	37,678,256.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	39,500,000.00	40,932,270.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	75,300,000.00	77,319,169.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	94,500,000.00	101,226,037.50	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	101,000,000.00	107,066,060.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	74,333,640.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	84,500,000.00	87,509,045.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	125,400,000.00	155,878,470.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	144,200,000.00	178,420,102.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	91,492,380.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	140,030,644.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	75,600,000.00	79,210,278.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	100,294,980.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	82,400,000.00	95,399,836.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	101,400,000.00	131,653,197.00	
タイバーツ 小計		1,349,200,000.00	1,543,611,539.00 (5,325,459,809)	
	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,135,450.00	

フィリピンペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	37,085,550.00	
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	52,221,000.00 (112,797,360)	
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,871,982,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,161,603,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	37,900,000,000.00	37,223,295,500.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	33,599,880,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	30,500,000,000.00	30,180,817,500.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	21,820,560,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	18,702,665,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	20,200,000,000.00	20,022,644,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	24,625,500,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	36,634,155,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	36,573,128,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	32,200,000,000.00	31,672,886,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	29,600,000,000.00	31,080,148,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	38,000,000,000.00	40,485,580,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	34,501,274,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	19,742,278,500.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	31,800,000,000.00	32,777,373,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000.00	76,491,723,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	54,115,620,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,194,810,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	36,300,000,000.00	38,813,230,500.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	35,510,401,500.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,064,058,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	33,700,000,000.00	37,278,771,500.00	
インドネシアルピア 小計		732,700,000,000.00	755,144,384,000.00 (5,890,126,195)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	108,700,000.00	124,737,054.50	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	23,149,758.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,900,000.00	29,772,589.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	53,100,000.00	56,593,183.50	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	34,643,631.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	44,199,900.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	71,000,000.00	57,783,350.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	54,367,335.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	70,818,918.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	53,369,266.00	
	SAGB 8% 01/31/30	84,400,000.00	78,584,840.00	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	29,019,550.00	
南アフリカランド 小計		745,050,000.00	657,039,375.50	

			(4,264,185,546)	
合計			55,008,705,318 (55,008,705,318)	

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%	11.0%
チリペソ	国債証券　5銘柄	100.0%	2.6%
コロンビアペソ	国債証券　1銘柄	100.0%	6.1%
ペルーヌエボソル	国債証券　9銘柄	100.0%	3.7%
ウルグアイペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券　15銘柄	100.0%	3.1%
チェココルナ	国債証券　11銘柄	100.0%	5.0%
ハンガリーフォリント	国債証券　12銘柄	100.0%	3.9%
ポーランドズロチ	国債証券　13銘柄	100.0%	9.2%
ロシアルーブル	国債証券　20銘柄	100.0%	9.2%
マレーシアリンギット	国債証券　16銘柄	100.0%	7.2%
タイバーツ	国債証券　16銘柄	100.0%	9.7%
フィリピンペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券　24銘柄	100.0%	10.7%
南アフリカランド	国債証券　12銘柄	100.0%	7.8%

(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。

【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4期中間計算期間(2020年6月11日から2020年12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。

【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （2020年 6月10日現在）	第4期中間計算期間 （2020年12月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,205,398	4,585,983
親投資信託受益証券	1,351,788,371	1,729,285,076
未収入金	24,747,491	17,396,107
流動資産合計	1,382,741,260	1,751,267,166
資産合計	1,382,741,260	1,751,267,166
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,252,557	1,224,301
未払受託者報酬	323,670	422,658
未払委託者報酬	2,589,287	3,381,193
未払利息	9	6
その他未払費用	32,329	42,206
流動負債合計	7,197,852	5,070,364
負債合計	7,197,852	5,070,364
純資産の部		
元本等		
元本	1,294,679,455	1,557,910,924
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	80,863,953	188,285,878
（分配準備積立金）	49,168,177	46,395,524
元本等合計	1,375,543,408	1,746,196,802
純資産合計	1,375,543,408	1,746,196,802
負債純資産合計	1,382,741,260	1,751,267,166

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自　2019年 6月11日 至　2019年12月10日	第4期中間計算期間 自　2020年 6月11日 至　2020年12月10日
営業収益		
受取利息	-	47
有価証券売買等損益	39,045,739	91,974,408
営業収益合計	39,045,739	91,974,455
営業費用		
支払利息	2,536	3,805
受託者報酬	245,780	422,658
委託者報酬	1,966,171	3,381,193
その他費用	24,517	42,206
営業費用合計	2,239,004	3,849,862
営業利益又は営業損失（△）	36,806,735	88,124,593
経常利益又は経常損失（△）	36,806,735	88,124,593
中間純利益又は中間純損失（△）	36,806,735	88,124,593
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（△）	3,411,080	1,144,142
期首剰余金又は期首欠損金（△）	8,443,665	80,863,953
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,998,835	25,779,638
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,998,835	25,779,638
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,566,696	5,338,164
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,566,696	5,338,164
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	48,271,459	188,285,878

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	第3期 (2020年 6月10日現在)	第4期中間計算期間 (2020年12月10日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	1,294,679,455口	1,557,910,924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 1.0625円 (1万口当たり純資産額) (10,625円)	1口当たり純資産額 1.1209円 (1万口当たり純資産額) (11,209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4期中間計算期間 (2020年12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ん。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第4期中間計算期間 (2020年12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。

（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3期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2020年 6月11日 至 2020年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	814,756,255円	1,294,679,455円
期中追加設定元本額	723,541,962円	348,776,276円
期中一部解約元本額	243,618,762円	85,544,807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

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,572,086,440
株式	366,434,730,120

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	2,376,000
未収入金	388,700
未収配当金	272,349,566
差入委託証拠金	150,888,000
流動資産合計	370,432,818,826
資産合計	370,432,818,826
負債の部	
流動負債	
前受金	2,376,000
未払解約金	396,514,724
未払利息	4,742
流動負債合計	398,895,466
負債合計	398,895,466
純資産の部	
元本等	
元本	218,398,621,559
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	151,635,301,801
元本等合計	370,033,923,360
純資産合計	370,033,923,360
負債純資産合計	370,432,818,826

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12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12月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	218,398,621,559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　1.6943円 (1万口当たり純資産額)　(16,943円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年12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	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	216,012,632,233円
期中追加設定元本額	28,745,365,985円
期中一部解約元本額	26,359,376,659円
期末元本額	218,398,621,559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）	479,416,367円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,001,718,704円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,475,624円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,886,310,145円
世界経済インデックスファンド	2,397,646,515円
日本株式インデックス・オープン	3,826,010,734円
ＤＣマイセレクション２５	6,798,336,384円
ＤＣマイセレクション５０	18,691,605,499円
ＤＣマイセレクション７５	17,932,570,697円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,804,151,550円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,965,798,270円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,105,042,100円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,426,602,054円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,164,986,774円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	313,734,658円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	709,556,016円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	488,541,527円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,054,854,754円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,594,263,585円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	14,492,197円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	29,243,529円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	30,422,250円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	244,276,914円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,505,321円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	63,042,654円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	215,888,207円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	42,753,545円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	155,146,015円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,381,280,696円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	587,135,570円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,552,685,089円

区分	2020年12月10日現在
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	540,028,391円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	31,998,337円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	661,432,459円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	365,071,232円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	469,055,404円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	47,285,222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）	728,798,047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	1,948,551,812円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,312,324,678円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,380,522,977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）	354,183,867円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	365,590,119円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,350,540,852円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	204,924,142円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,493,693円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	63,541,064円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	29,419,632,057円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	731,236,988円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	28,772,570円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	89,507,964円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	16,031,194円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,746,039円
グローバル経済コア	244,977,365円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	20,844,471円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	41,812,920円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,911,484円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,146,961,068円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	117,678,642円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	452,459円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	427,855円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	240,252円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	337,781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）	46,351,171,965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）	1,554,929,802円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	89,213,011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

（2020年12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	3,500,244,000	－	3,502,620,000	2,376,000
合計		3,500,244,000	－	3,502,620,000	2,376,000

(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。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	608,933,525
国債証券	504,809,029,600
地方債証券	33,207,788,523
特殊債券	38,903,718,218
社債券	25,709,953,110
未収入金	198,033,000
未収利息	1,277,192,010
前払費用	73,003,985
流動資産合計	604,787,651,971
資産合計	604,787,651,971
負債の部	
流動負債	
未払金	500,000,000
未払解約金	111,588,831
未払利息	808
流動負債合計	611,589,639
負債合計	611,589,639
純資産の部	
元本等	
元本	427,642,974,411
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	176,533,087,921
元本等合計	604,176,062,332
純資産合計	604,176,062,332
負債純資産合計	604,787,651,971

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
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12月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	427,642,974,411口
2.	担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
		有価証券　101,464,000円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　1.4128円
		(1万口当たり純資産額)　(14,128円)

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

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年12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

	2020年12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	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	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	387,020,022,692円
期中追加設定元本額	47,936,171,559円
期中一部解約元本額	7,313,219,840円
期末元本額	427,642,974,411円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,653,502,739円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	12,370,181円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	18,760,085,227円
世界経済インデックスファンド	2,121,560,153円
ＤＣマイセレクション２５	22,684,205,297円
ＤＣマイセレクション５０	25,448,964,510円
ＤＣマイセレクション７５	6,587,741,459円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	431,769,079円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	92,157,668,262円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	69,145,325,386円
ＤＣマイセレクションＳ２５	9,786,633,292円
ＤＣマイセレクションＳ５０	10,873,360,590円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,088,880,983円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,028,008,584円

区分	2020年12月10日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,609,106,134円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	565,713,951円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,726,070,684円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	15,092,090円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,659,502円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	39,811,804円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,325,153円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	944,620円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	138,983,083円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	193,506,528円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	49,687,185円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	52,639,211円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,635,995,199円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	829,770,336円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,322,991,033円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	784,111,499円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	85,165,771円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,111,650,391円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,259,650,749円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,572,167,877円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	149,678,548円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	6,215,972,177円
日本債券ファンド・シリーズ１	12,938,968,299円
分散投資コア戦略ファンドＡ	24,563,191,106円
分散投資コア戦略ファンドＳ	24,093,323,329円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	99,448,305円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,050,666,861円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	48,458,977円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,445,100円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	51,911,298円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	18,640,825円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	31,132,247円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	47,860,223円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,101,561円
グローバル経済コア	203,426,436円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	18,825,918円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	3,206,697円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	655,961円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	436,757円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	175,319円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	106,031円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	75,246,678,733円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	32,317,921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。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,332,094,109
コール・ローン	425,951,262
株式	441,833,004,871
投資信託受益証券	304,671,422
投資証券	9,701,428,623
派生商品評価勘定	943,900,901
未収入金	220,160
未収配当金	582,459,776
差入委託証拠金	5,267,531,176
流動資産合計	465,391,262,300
資産合計	465,391,262,300
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	476,921
前受金	943,630,280
未払解約金	572,311,921
未払利息	565
流動負債合計	1,516,419,687
負債合計	1,516,419,687
純資産の部	
元本等	
元本	149,613,940,913
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	314,260,901,700
元本等合計	463,874,842,613
純資産合計	463,874,842,613
負債純資産合計	465,391,262,300

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

	2020年12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）

		2020年12月10日現在
1．計算期間の末日における受益権の総数		149,613,940,913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	3.1005円
	(1万口当たり純資産額)	(31,005円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年12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	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	153,028,332,972円
期中追加設定元本額	13,013,234,984円
期中一部解約元本額	16,427,627,043円
期末元本額	149,613,940,913円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,207,175,339円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,641,656円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	26,984,536,138円
世界経済インデックスファンド	7,924,751,032円
外国株式インデックス・オープン	802,190,397円
ＤＣマイセレクション２５	1,003,889,638円
ＤＣマイセレクション５０	4,470,188,587円
ＤＣマイセレクション７５	4,998,670,618円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	10,115,224,566円
ＤＣマイセレクションＳ２５	424,640,842円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,896,667,789円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,509,943,759円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	84,197,309円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	188,756,509円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	129,993,482円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,230,236,455円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,953,661,905円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,006,466円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,576,295円
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	31,846,516円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	33,963,653円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	119,027,224円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	23,943,931円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	86,996,665円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	514,486,101円

区分	2020年12月10日現在
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	283,567,513円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,933,471,568円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,514,214,497円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	53,817,326円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	277,405,456円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	92,970,912円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,573,648,640円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,704,871,933円
外国株式ファンド・シリーズ１	977,318,059円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,783,464,866円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,615,295,050円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,254,795,118円
分散投資コア戦略ファンドＳ	10,941,726,462円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,204,473,649円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,140,461,498円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,337,484,341円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	689,940,333円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,574,040円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	196,992,766円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	977,017,255円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	32,350,227,317円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	144,803,033円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	451,421,784円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	81,648,439円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,757,951円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	81,898,867円
グローバル経済コア	828,796,638円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,777,918円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,577,734円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	705,298,573円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	73,958,947円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	1,444,568円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	1,347,966円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	771,441円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,088,735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）	861,732,760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）	1,503,061,455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）	1,713,337,301円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	439,157,670円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	115,349,202円
ＳＭＴＡＭ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
ＳＭＴＡＭバランスファンド２００２（適格機関投資家専用）	527,559,511円
ＳＭＴＡＭ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	2020年12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

（2020年12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	10,637,525,627	－	11,581,155,907	943,630,280
合計		10,637,525,627	－	11,581,155,907	943,630,280

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年12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	601,662,100	－	601,868,400	△206,300
	アメリカドル	517,979,500	－	518,192,400	△212,900
	イギリスポンド	83,682,600	－	83,676,000	6,600
合計		601,662,100	－	601,868,400	△206,300

(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。

①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。

②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。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	140,005,271
コール・ローン	2,507,842,735
国債証券	276,728,452,630
派生商品評価勘定	18,996,383
未収入金	6,322,608
未収利息	1,543,181,493
前払費用	61,776,550
差入委託証拠金	508,396,015
流動資産合計	281,514,973,685
資産合計	281,514,973,685
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,252,180
前受金	542,283
未払金	16,718,270
未払解約金	467,460,122
未払利息	3,329
流動負債合計	489,976,184
負債合計	489,976,184
純資産の部	
元本等	
元本	93,923,909,329
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	187,101,088,172
元本等合計	281,024,997,501
純資産合計	281,024,997,501
負債純資産合計	281,514,973,685

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

	2020年12月10日現在
	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、当該先物取引及び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	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (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。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年12月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	93,923,909,329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 2.9920円 (1万口当たり純資産額) (29,920円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年12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

	2020年12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	「(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。 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	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	96,103,991,147円
期中追加設定元本額	6,841,005,825円
期中一部解約元本額	9,021,087,643円
期末元本額	93,923,909,329円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,515,205,346円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	618,766,663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）	2,035,475,209円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,005,429円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,728,928,785円
世界経済インデックスファンド	7,521,966,927円
ＤＣマイセレクション２５	1,789,081,231円
ＤＣマイセレクション５０	1,510,152,948円
ＤＣマイセレクション７５	888,075,363円

区分	2020年12月10日現在
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,103,198,068円
ＤＣマイセレクションＳ２５	766,379,883円
ＤＣマイセレクションＳ５０	647,494,904円
ＤＣマイセレクションＳ７５	286,493,824円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	40,209,647円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	72,235,756円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	35,556,658円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,595,552,661円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	669,259,605円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	8,411,916円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,361,667円
マイセレクション７５ＶＡ１（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ＶＡ１（適格機関投資家専用）	36,702,303円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	75,056,213円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	111,075,242円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	117,991,945円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	142,881,326円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,685,063,989円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	501,420,198円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,879,709,719円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	775,791,507円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	64,347,486円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	523,097,496円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	195,838,319円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	244,865,840円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	833,503,925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）	932,364,693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	591,348,325円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,032,227,516円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,614,235,263円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,090,641,754円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,150,936,306円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	341,601,567円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,231,741,706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）	201,221,191円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	95,859,501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）	1,134,490,845円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	185,009,357円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	20,649,607,392円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	135,453,045円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	129,406,943円

区分	2020年12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）	227,594,491円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,472,425円
グローバル経済コア	751,077,553円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,573,195円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	336,138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	428,249円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	464,820円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	294,638円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	451,071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）	587,920,522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）	10,387,292,564円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	340,417,980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）	363,402,447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

（2020年12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	2,266,377,025	－	2,266,919,308	542,283
合計		2,266,377,025	－	2,266,919,308	542,283

(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はありません。

通貨関連

（2020年12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	1,974,886,376	－	1,988,168,300	13,281,924
	アメリカドル	830,462,941	－	830,952,200	489,259
	カナダドル	122,713,069	－	124,450,200	1,737,131
	ユーロ	854,639,010	－	865,413,900	10,774,890
	イギリスポンド	167,071,356	－	167,352,000	280,644
	売建	61,562,603	－	61,642,607	△80,004
	イギリスポンド	61,562,603	－	61,642,607	△80,004
合計		2,036,448,979	－	2,049,810,907	13,201,920

(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。

①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。

②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。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,281,725,506
コール・ローン	60,663,317
株式	83,655,697,772
投資信託受益証券	178,431,242
投資証券	59,243,208
派生商品評価勘定	186,043,148
未収入金	62,946
未収配当金	25,292,790
差入委託証拠金	491,574,632
流動資産合計	85,938,734,561
資産合計	85,938,734,561
負債の部	
流動負債	
前受金	186,038,648
未払株式払込金	1,746,605
未払解約金	57,898,024
未払利息	80
流動負債合計	245,683,357
負債合計	245,683,357
純資産の部	
元本等	
元本	25,942,082,561
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	59,750,968,643
元本等合計	85,693,051,204
純資産合計	85,693,051,204
負債純資産合計	85,938,734,561

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (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。 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。
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。

	2020年12月10日現在
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年12月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	25,942,082,561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　3.3032円 (1万口当たり純資産額)　(33,032円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年12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12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。 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	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	25,324,856,282円
期中追加設定元本額	1,774,593,508円
期中一部解約元本額	1,157,367,229円
期末元本額	25,942,082,561円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	7,387,783,648円
世界経済インデックスファンド	4,006,195,310円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	4,647,854,308円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	5,107,350,397円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	184,222,867円
分散投資コア戦略ファンドＡ	323,155,672円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,286,691,180円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	574,176,498円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	635,912,735円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	335,197,332円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,117,780円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	102,865,427円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	103,484,861円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	327,138,308円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	58,767,781円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,649,637円

区分	2020年12月10日現在
グローバル経済コア	410,565,389円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	29,503,033円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	699,535円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	655,770円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	379,099円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	524,081円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	315,204,975円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	82,986,938円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年12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	1,560,717,048	－	1,746,755,696	186,038,648
合計		1,560,717,048	－	1,746,755,696	186,038,648

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年12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	46,921,500	－	46,917,000	4,500
	アメリカドル	46,921,500	－	46,917,000	4,500
合計		46,921,500	－	46,917,000	4,500

(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。

①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。

②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

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,114,481,100
コール・ローン	310,775,311
国債証券	60,908,521,702
未収利息	970,378,263
前払費用	50,513,243
流動資産合計	63,354,669,619
資産合計	63,354,669,619
負債の部	
流動負債	
未払金	38,450,384
未払解約金	49,671,616
未払利息	412
流動負債合計	88,122,412
負債合計	88,122,412
純資産の部	
元本等	
元本	36,650,818,354
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	26,615,728,853
元本等合計	63,266,547,207
純資産合計	63,266,547,207
負債純資産合計	63,354,669,619

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。

	2020年12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12月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	36,650,818,354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　1.7262円 (1万口当たり純資産額)　(17,262円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年12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。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	35,123,332,856円
期中追加設定元本額	3,034,844,832円
期中一部解約元本額	1,507,359,334円
期末元本額	36,650,818,354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	4,263,202,047円
世界経済インデックスファンド	6,407,292,770円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	4,717,804,809円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,206,768,995円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,812,167,425円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	82,240,986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）	307,260,594円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,836,497,562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）	184,647,254円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	86,075,906円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	157,487,858円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,291,568,809円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	174,265,048円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	169,697,629円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	293,286,448円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,284,727円
グローバル経済コア	653,624,431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	641,464円

区分	2020年12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）２０４０	561,217円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	302,043円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	409,719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）	87,920,323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）

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

【純資産額計算書】

（2020年12月30日現在）

Ⅰ　資産総額	1,769,611,794円
Ⅱ　負債総額	41,567,139円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,728,044,655円
Ⅳ　発行済口数	1,535,215,223口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1256円
（1万口当たり純資産額）	（11,256円）

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年12月30日現在）

Ⅰ　資産総額	375,000,460,100円
Ⅱ　負債総額	395,662,143円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	374,604,797,957円
Ⅳ　発行済口数	217,317,649,573口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7238円
（1万口当たり純資産額）	（17,238円）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年12月30日現在）

Ⅰ　資産総額	612,526,426,821円
Ⅱ　負債総額	6,582,196,994円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	605,944,229,827円
Ⅳ　発行済口数	429,655,533,903口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4103円
（1万口当たり純資産額）	（14,103円）

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年12月30日現在）

Ⅰ　資産総額	467,139,441,185円
Ⅱ　負債総額	334,195,995円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	466,805,245,190円
Ⅳ　発行済口数	148,584,913,479口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1417円
（1万口当たり純資産額）	（31,417円）

外国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年12月30日現在）

Ⅰ　資産総額	281,494,684,494円
Ⅱ　負債総額	122,579,694円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	281,372,104,800円
Ⅳ　発行済口数	93,894,683,078口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9967円
（1万口当たり純資産額）	（29,967円）

新興国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年12月30日現在）

Ⅰ　資産総額	85,792,631,074円
Ⅱ　負債総額	23,945,726円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	85,768,685,348円
Ⅳ　発行済口数	25,874,399,400口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3148円
（1万口当たり純資産額）	（33,148円）

新興国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年12月30日現在）

Ⅰ　資産総額	63,459,752,696円
Ⅱ　負債総額	23,771,648円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	63,435,981,048円
Ⅳ　発行済口数	36,574,526,976口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7344円
（1万口当たり純資産額）	（17,344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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤償還金

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

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年12月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数：12,000株
発行済株式総数　：3,000株
最近5年間にお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

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の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発します。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。

②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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2021年 3月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	524	13,396,945
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	302,014
単位型公社債投資信託	41	287,976
合計	644	13,986,935

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				
	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	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 （2019年3月31日）		当事業年度 （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

（リース取引関係）

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、自社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。

①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。

②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。

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

（注）　1．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
　　2．時価の算定方法
　　取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
　　2．時価の算定方法
　　金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		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

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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

① 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。

② 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				
	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	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	△2
	英ポンド	105	－	△0	△0
	カナダドル	19	－	0	0
	スイスフラン	50	－	0	0
	香港ドル	178	－	△0	△0
	ユーロ	306	－	3	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				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	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おりません。

（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 3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社
②資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）
③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2020年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社東京スター銀行	26,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社静岡銀行	90,845	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ａｕカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

３【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2020年7月27日現在）
④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。
⑤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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）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．ＸＢＲＬ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8月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2019年6月11日から2020年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2020年6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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

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に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、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．ＸＢＲＬ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2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

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SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2020年6月11日から2020年12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、SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2020年12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6月11日から2020年12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に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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。