

【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5月28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】	D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060
【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】	D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 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】

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060

（以下、上記を総称して、あるいは個別に、「当ファンド」、「各ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて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】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2021年 5月29日から2021年11月30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 >

当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する

金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第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 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日又はその翌営業日下記のうちいずれかの場合は、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、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<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

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1)プル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信

託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

1. 投資対象ファンド*への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)及び債券に分散投資します。

投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針(2)投資対象(参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

- 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- 為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

? 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。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは、後掲「2 投資方針(2)投資対象(参考)投資対象ファンドの概要」をご覧ください。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各投資対象ファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

3. ターゲット・イヤー[※]に近づくにしたいが、原則として1年に1回、各資産の基本組入比率を変更します。

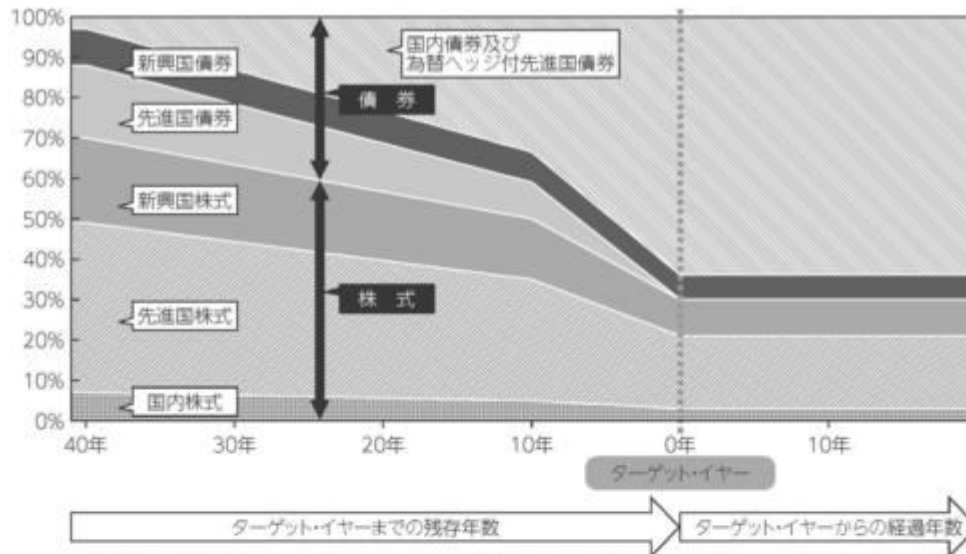
※ターゲット・イヤーとは、ファンドごとにあらかじめ定めた基準日(特定の決算日の翌日)をいいます。

- 定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。
- ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。
- 基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。
- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

各ファンドのターゲット・イヤー

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	2030年8月の決算日の翌日(第13計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2040年8月の決算日の翌日(第23計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2050年8月の決算日の翌日(第33計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2060年8月の決算日の翌日(第43計算期間開始日)

基本組入比率の推移のイメージ



※上記は当初設定時における基本組入比率の推移のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率と異なる場合があります。

<ご参考>

■ 当初設定時(2019年3月)

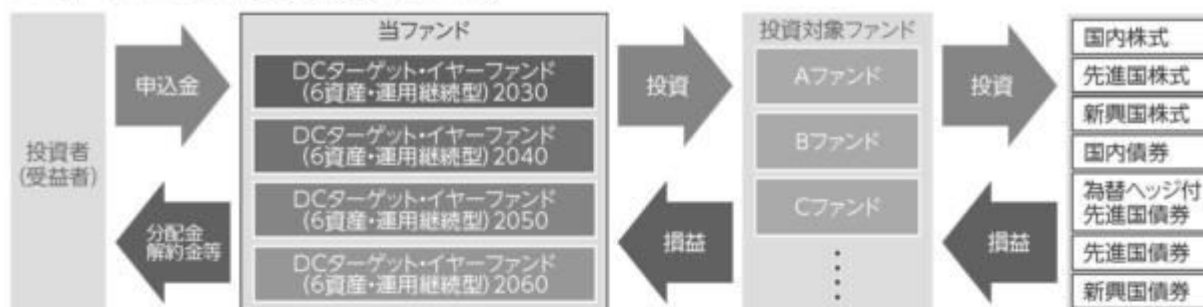
	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	5.1%	30.4%	15.2%	32.4%	9.3%	7.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	5.7%	34.4%	17.2%	22.3%	12.3%	8.1%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	6.4%	38.4%	19.2%	12.1%	15.3%	8.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	7.0%	42.0%	21.0%	3.0%	18.0%	9.0%

■ 2021年3月末現在

	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	5.0%	30.0%	15.0%	33.5%	9.0%	7.5%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	5.7%	34.0%	17.0%	23.3%	12.0%	8.0%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	6.3%	38.0%	19.0%	13.2%	15.0%	8.5%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	7.0%	42.0%	21.0%	3.0%	18.0%	9.0%

ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

- 原則として毎年8月28日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 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。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

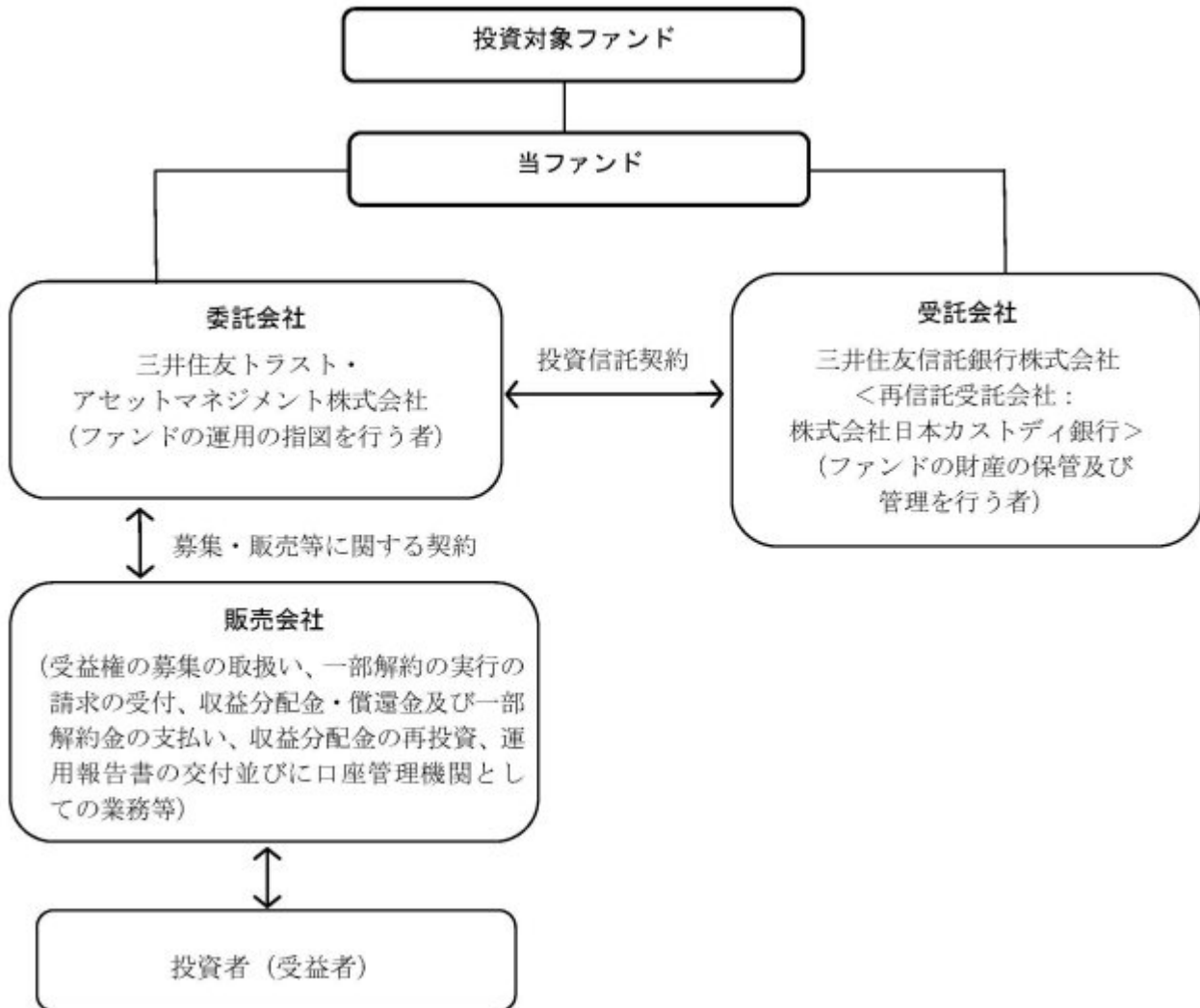
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2019年 3月20日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年 3月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1) 【投資方針】

基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）を投資対象とします。

投資態度

イ．投資対象ファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）及び債券に分散投資します。

ロ．当初設定時の各資産の基本組入比率は以下のとおりとします。

	DC ターゲッ ト・イヤーファ ンド（6資産・ 運用継続型） 2030	DC ターゲッ ト・イヤーファ ンド（6資産・ 運用継続型） 2040	DC ターゲッ ト・イヤーファ ンド（6資産・ 運用継続型） 2050	DC ターゲッ ト・イヤーファ ンド（6資産・ 運用継続型） 2060
国内株式	5.1%	5.7%	6.4%	7.0%
先進国株式	30.4%	34.4%	38.4%	42.0%
新興国株式	15.2%	17.2%	19.2%	21.0%
国内債券 及び為替ヘッジ 付先進国債券	32.4%	22.3%	12.1%	3.0%
先進国債券	9.3%	12.3%	15.3%	18.0%
新興国債券	7.6%	8.1%	8.6%	9.0%

ハ．（ 1 ）年8月の決算日の翌日（第（ 2 ）計算期間開始日）（以下、「ターゲット・イヤー」といいます。）に近づくにしたいが、定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。なお、基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

上記、（ 1 ）及び（ 2 ）となっている箇所には下の表より各々の数字をあてはめてお読みください。

	(1)	(2)
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2030	13
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2040	23
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2050	33
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2060	43

ニ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ホ．投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

ヘ．為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

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】

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（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

・全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

以下の内容は、2021年 3月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記

載内容が変更となることがあります。

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

1. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式
投資態度	<p>原則として東京証券取引所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。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

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

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

数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

2. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式
投資態度	<p>原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに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。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

3. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）

投資態度	<p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

4.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

5. 外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）に採用されている国の国債等に分散投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>公社債等の実質投資割合は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、実質投資割合は取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年2回：6月・12月の各10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.209%（税抜 0.19%）
信託財産留保額	一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2014年5月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。

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。

6. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに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。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

7. 新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券

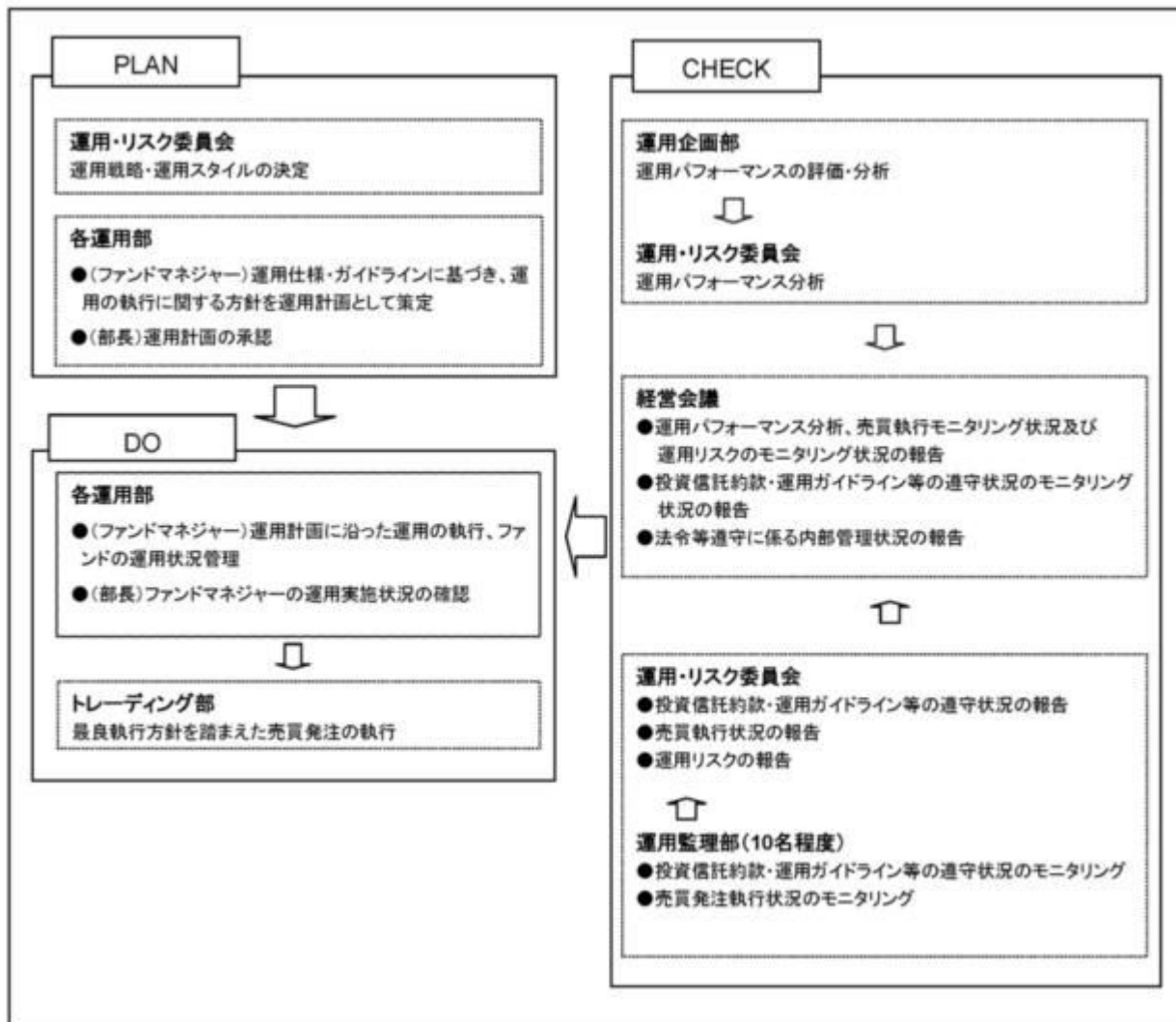
投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建て債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティ

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。

（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）【配分方針】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です

- ・ 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。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。

ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ．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。

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

（二）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

<その他の投資制限>

イ．当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

金利変動リスク

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

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(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。

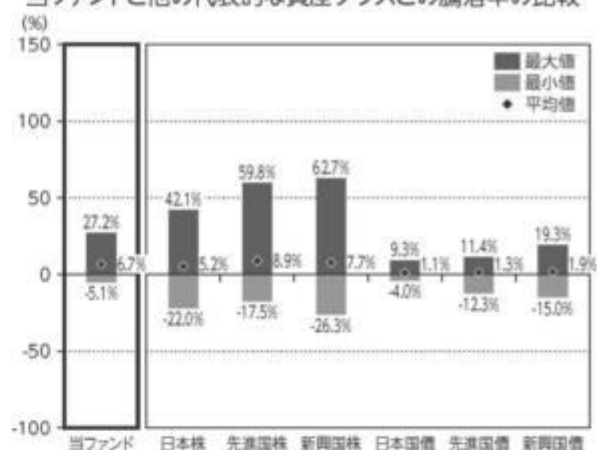
【参考情報】

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030

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



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

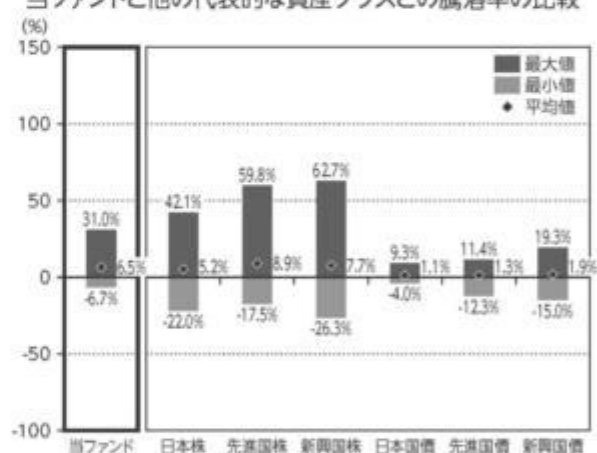


DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

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

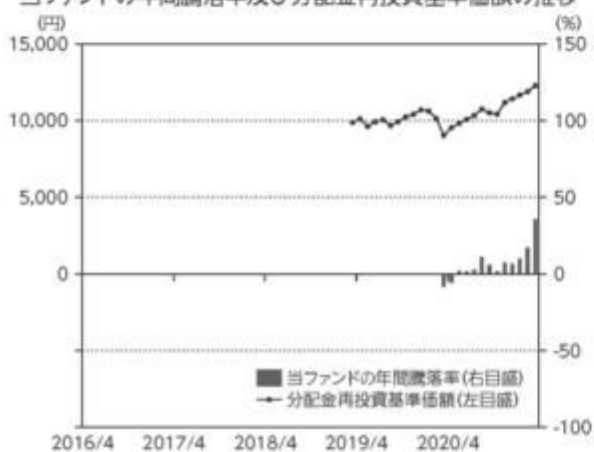


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

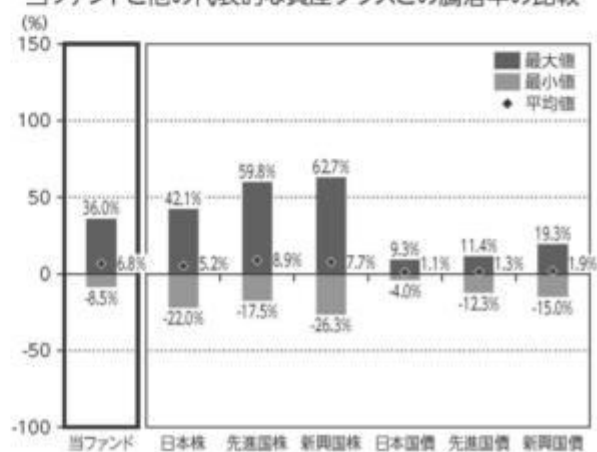


DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050

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

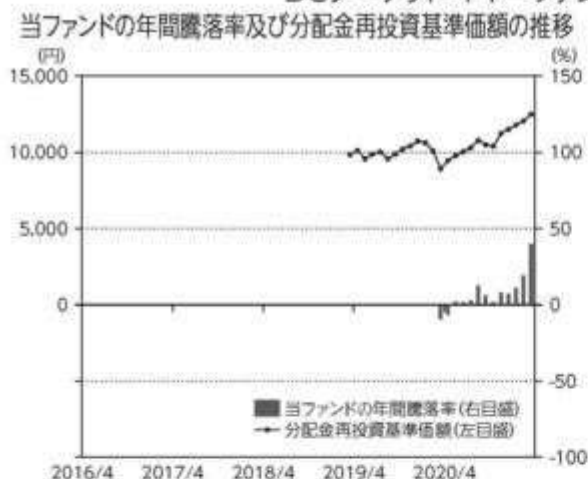


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【参考情報】

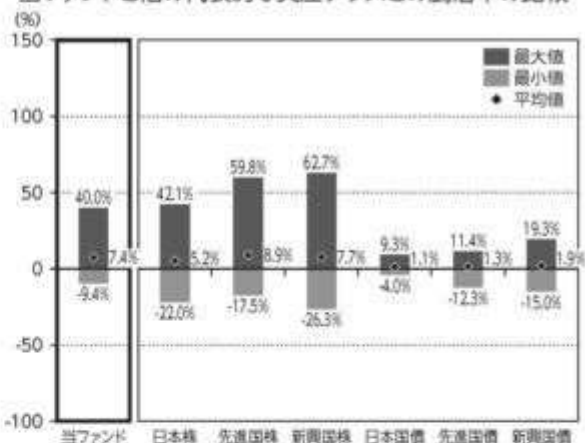
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060



*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2020年3月～2021年3月の1年1ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年4月～2021年3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国内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、有効性の公表、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会社の事業活動・サービスに關し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としてあり、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、欺瞞または誤証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 J.P. Morgan・ガンパ・ボン・インデックス・エマージング マーケットグローバル・デベロップメント	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からの書部による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

< 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.44%（税抜 0.4%）（ ）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 0.198% （税抜 0.18%）	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 0.044% （税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「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）。

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

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

なお上記のほかにも、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券パッシブファンド私募A （為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	年率 0.209% （税抜 0.19%）
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。

実質的な信託報酬率：上限 年率0.649%（税抜 上限0.59%）
（投資対象とする投資信託証券：上限 年率0.209%（税抜 上限0.19%））

（４）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2021年 3月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年3月31日現在の状況について記載してあります。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	4,713,132	23.17
親投資信託受益証券	日本	15,452,123	75.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		178,972	0.88
合計(純資産総額)		20,344,227	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,876,271	3.0249	5,675,569	3.5378	6,637,871	32.63
日本	投資信託受益証券	外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	4,694,823	1.042	4,892,162	1.0039	4,713,132	23.17
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	897,135	3.1564	2,831,784	3.7060	3,324,782	16.34
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	567,499	2.9852	1,694,126	3.0338	1,721,678	8.46
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	842,602	1.6759	1,412,119	1.7181	1,447,674	7.12
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	869,249	1.4069	1,222,994	1.4049	1,221,207	6.00
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	583,565	1.6069	937,786	1.8831	1,098,911	5.40

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	23.17
親投資信託受益証券	75.95
合計	99.12

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	488,321	488,321	9,766	9,766
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	9,108,305	9,108,305	10,876	10,876
2020年 3月末日	2,080,943		9,407	
4月末日	2,682,404		9,847	
5月末日	3,380,790		10,084	
6月末日	6,246,638		10,302	
7月末日	6,558,071		10,519	
8月末日	9,091,617		10,845	
9月末日	9,811,789		10,664	
10月末日	9,627,911		10,593	
11月末日	11,953,181		11,197	
12月末日	16,099,386		11,382	
2021年 1月末日	18,773,640		11,563	
2月末日	18,981,526		11,668	
3月末日	20,344,227		11,967	

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	2.3
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.4
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	7.3

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	10,722,971	2,848,364	8,374,607
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	8,419,740	525,639	16,268,708

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	2,744,193	14.98
親投資信託受益証券	日本	15,436,054	84.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		142,755	0.78
合計(純資産総額)		18,323,002	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,888,036	3.0376	5,735,231	3.5378	6,679,493	36.45
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	903,481	3.1641	2,858,707	3.7060	3,348,300	18.27
日本	投資信託受益証券	外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	2,733,533	1.0387	2,839,572	1.0039	2,744,193	14.98
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	671,114	2.9884	2,005,559	3.0338	2,036,025	11.11
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	797,960	1.6774	1,338,523	1.7181	1,370,975	7.48
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	592,614	1.6037	950,388	1.8831	1,115,951	6.09
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	630,159	1.4057	885,841	1.4049	885,310	4.83

(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。

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	14.98
親投資信託受益証券	84.24
合計	99.22

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	482,826	482,826	9,657	9,657
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	10,262,988	10,262,988	10,807	10,807
2020年 3月末日	2,678,562		9,224	
4月末日	3,269,347		9,679	
5月末日	4,953,096		9,930	
6月末日	6,432,374		10,164	
7月末日	8,097,552		10,396	
8月末日	10,227,592		10,770	
9月末日	10,278,086		10,554	
10月末日	10,509,581		10,475	
11月末日	10,693,370		11,154	
12月末日	14,448,735		11,367	
2021年 1月末日	15,301,421		11,580	
2月末日	17,342,528		11,743	
3月末日	18,323,002		12,086	

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	3.4
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.9
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	8.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	9,066,056	69,464	9,496,592
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	6,065,590	794,410	14,767,772

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	485,416	6.70
親投資信託受益証券	日本	6,709,003	92.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		55,450	0.76
合計(純資産総額)		7,249,869	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	827,255	2.9912	2,474,518	3.5378	2,926,662	40.37
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	405,198	3.0740	1,245,611	3.7060	1,501,663	20.71
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	319,288	2.9893	954,465	3.0338	968,655	13.36
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	326,360	1.6632	542,810	1.7181	560,719	7.73
日本	投資信託受益証券	外国債券バッシブファンド私募A (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	483,531	1.041	503,376	1.0039	485,416	6.70
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	257,165	1.5633	402,028	1.8831	484,267	6.68
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	190,076	1.4057	267,190	1.4049	267,037	3.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	6.70
親投資信託受益証券	92.54
合計	99.24

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2019年 8月28日)	477,285	477,285	9,546	9,546
第2期計算期間末	(2020年 8月28日)	4,942,635	4,942,635	10,801	10,801
	2020年 3月末日	1,098,131		9,029	
	4月末日	1,195,538		9,539	
	5月末日	1,702,428		9,820	

6月末日	2,032,341		10,076
7月末日	2,477,269		10,323
8月末日	4,922,503		10,757
9月末日	4,908,371		10,504
10月末日	4,667,350		10,417
11月末日	5,653,807		11,177
12月末日	6,287,331		11,417
2021年 1月末日	6,540,204		11,667
2月末日	6,664,488		11,888
3月末日	7,249,869		12,277

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	4.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	13.1
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	10.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	4,213,212	137,106	4,576,106
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	1,348,426	318,597	5,605,935

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

(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	14,338,182	99.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		88,837	0.62
合計(純資産総額)		14,427,019	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,787,436	3.0824	5,509,641	3.5378	6,323,591	43.83
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	843,194	3.2589	2,747,898	3.7060	3,124,876	21.66
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	787,036	2.9858	2,349,974	3.0338	2,387,709	16.55
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	700,647	1.6794	1,176,680	1.7181	1,203,781	8.34
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	550,865	1.6619	915,530	1.8831	1,037,333	7.19
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	185,702	1.4061	261,126	1.4049	260,892	1.81

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.38
合計	99.38

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2019年 8月28日)	472,333	472,333	9,447	9,447
第2期計算期間末	(2020年 8月28日)	2,976,184	2,976,184	10,836	10,836
	2020年 3月末日	481,661		8,924	
	4月末日	745,768		9,467	
	5月末日	1,315,647		9,777	
	6月末日	2,221,532		10,046	
	7月末日	2,807,649		10,304	
	8月末日	2,962,351		10,785	
	9月末日	4,528,859		10,499	
	10月末日	6,562,471		10,402	
	11月末日	7,300,569		11,240	
	12月末日	8,132,928		11,507	
	2021年 1月末日	9,675,376		11,790	
	2月末日	10,473,521		12,064	
	3月末日	14,427,019		12,498	

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	5.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	14.7
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	11.3

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	2,820,411	573,769	2,746,642
第3期中間計算期間	2020年 8月29日～2021年 2月28日	7,305,169	1,143,361	8,908,450

(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	463,280,295,000	98.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,587,444,147	1.61
合計(純資産総額)		470,867,739,147	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	7,347,040,000	1.56

(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	1,751,600	7,020.22	12,296,617,352	8,616.00	15,091,785,600	3.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,346,200	5,863.88	7,893,955,256	9,330.00	12,560,046,000	2.67
日本	株式	ソニー	電気機器	1,083,100	8,002.33	8,667,323,623	11,595.00	12,558,544,500	2.67
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,700	47,672.26	8,089,982,522	50,270.00	8,530,819,000	1.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,665,200	458.53	5,348,844,156	591.70	6,902,298,840	1.47

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,183,600	3,990.37	4,723,001,932	5,401.00	6,392,623,600	1.36
日本	株式	任天堂	その他製品	99,000	48,463.65	4,797,901,350	61,810.00	6,119,190,000	1.30
日本	株式	信越化学工業	化学	313,100	14,130.06	4,424,121,786	18,610.00	5,826,791,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,438,500	4,053.68	5,831,218,680	3,985.00	5,732,422,500	1.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,984,500	2,502.47	4,966,151,715	2,842.00	5,639,949,000	1.20
日本	株式	日本電産	電気機器	416,200	8,341.63	3,471,786,406	13,435.00	5,591,647,000	1.19
日本	株式	ダイキン工業	機械	220,300	17,672.47	3,893,245,141	22,320.00	4,917,096,000	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	1,484,300	3,314.58	4,919,831,094	3,225.00	4,786,867,500	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	101,300	25,726.26	2,606,070,138	46,790.00	4,739,827,000	1.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,180,100	3,207.38	3,785,029,138	4,007.00	4,728,660,700	1.00
日本	株式	K D D I	情報・通信業	1,360,600	3,165.17	4,306,530,302	3,395.00	4,619,237,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,361,300	2,824.53	3,845,032,689	3,319.00	4,518,154,700	0.96
日本	株式	村田製作所	電気機器	508,000	6,774.19	3,441,288,520	8,842.00	4,491,736,000	0.95
日本	株式	H O Y A	精密機器	340,200	10,771.46	3,664,450,692	13,005.00	4,424,301,000	0.94
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,191,100	2,497.65	2,974,950,915	3,587.00	4,272,475,700	0.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	831,300	3,766.96	3,131,473,848	5,004.00	4,159,825,200	0.88
日本	株式	ファナック	電気機器	151,800	21,009.31	3,189,213,258	26,185.00	3,974,883,000	0.84
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,317,200	1,385.19	3,209,762,268	1,599.00	3,705,202,800	0.79
日本	株式	S M C	機械	50,600	56,714.42	2,869,749,652	64,310.00	3,254,086,000	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,036,800	2,575.04	2,669,801,472	3,130.00	3,245,184,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	1,382,600	1,727.39	2,388,289,414	2,302.00	3,182,745,200	0.68
日本	株式	花王	化学	414,000	8,386.04	3,471,820,560	7,313.00	3,027,582,000	0.64
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	565,200	4,854.15	2,743,565,580	5,265.00	2,975,778,000	0.63
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	666,200	3,770.10	2,511,640,620	4,463.00	2,973,250,600	0.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	175,700	15,951.29	2,802,641,653	16,625.00	2,921,012,500	0.62

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.37
		食料品	3.28
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.26
		医薬品	5.42
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.60

ガラス・土石製品	0.82
鉄鋼	0.76
非鉄金属	0.75
金属製品	0.63
機械	5.58
電気機器	17.19
輸送用機器	7.24
精密機器	2.50
その他製品	2.34
電気・ガス業	1.34
陸運業	3.36
海運業	0.23
空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.07
卸売業	4.71
小売業	4.63
銀行業	5.08
証券、商品先物取引業	0.78
保険業	1.82
その他金融業	1.10
不動産業	1.99
サービス業	5.49
小計	98.39
合計	98.39

(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	376円		7,353,178,950	7,347,040,000	1.56

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	330,879,033,827	66.02
	イギリス	22,306,613,860	4.45
	カナダ	17,637,607,057	3.52
	フランス	16,439,111,003	3.28
	スイス	16,316,776,731	3.26
	ドイツ	15,221,751,555	3.04
	オーストラリア	10,115,399,821	2.02
	オランダ	9,573,540,453	1.91
	アイルランド	9,260,382,029	1.85
	スウェーデン	5,493,679,152	1.10
	香港	3,994,374,305	0.80
	デンマーク	3,845,083,870	0.77
	スペイン	3,839,140,405	0.77
	イタリア	3,070,650,503	0.61
	フィンランド	1,953,993,749	0.39
	バミューダ	1,693,456,959	0.34
	シンガポール	1,563,417,064	0.31
	ジャージー	1,460,235,884	0.29
	ベルギー	1,408,503,928	0.28
	ノルウェー	1,053,835,419	0.21
	イスラエル	979,690,257	0.20
	ケイマン	947,562,582	0.19
	ニュージーランド	549,786,934	0.11
	ルクセンブルク	494,052,519	0.10
	キュラソー	369,657,205	0.07
	オーストリア	303,616,273	0.06
	ポルトガル	270,186,415	0.05
	パナマ	208,063,724	0.04
	リベリア	159,907,094	0.03
	マン島	115,745,279	0.02
パプアニューギニア	64,687,420	0.01	
	小計	481,589,543,276	96.09
投資信託受益証券	オーストラリア	229,287,233	0.05
	香港	85,134,979	0.02
	小計	314,422,212	0.06
投資証券	アメリカ	9,026,541,262	1.80
	オーストラリア	673,532,411	0.13
	イギリス	287,974,800	0.06

	フランス	254,561,520	0.05
	シンガポール	253,478,823	0.05
	香港	176,266,992	0.04
	カナダ	68,579,431	0.01
	小計	10,740,935,239	2.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,518,693,242	1.70
合計(純資産総額)		501,163,593,969	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	5,987,583,177	1.19
	買建	カナダ	468,955,872	0.09
	買建	ドイツ	1,251,092,310	0.25
	買建	イギリス	379,152,410	0.08
	買建	オーストラリア	198,119,460	0.04

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		38,055,000	0.01

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

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

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	1,525,057	8,925.44	13,611,805,055	13,274.12	20,243,803,350	4.04

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	643,980	20,169.14	12,988,527,801	25,668.11	16,529,751,732	3.30
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	38,239	268,397.57	10,263,254,843	338,251.15	12,934,385,950	2.58
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディ ア・娯楽	215,390	25,113.45	5,409,187,374	31,884.47	6,867,598,147	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	26,929	157,362.08	4,237,603,638	226,564.69	6,101,160,637	1.22
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	26,594	157,214.84	4,180,971,524	227,568.83	6,051,965,555	1.21
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	67,937	18,971.26	1,288,850,871	70,369.49	4,780,692,056	0.95
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	272,941	11,054.39	3,017,197,216	17,102.48	4,667,968,212	0.93
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	235,697	16,277.69	3,836,603,007	18,268.25	4,305,773,394	0.86
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフト ウェア・ サービス	151,432	21,545.27	3,262,643,796	23,459.44	3,552,511,281	0.71
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	84,864	33,662.48	2,856,732,923	41,356.82	3,509,705,817	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	122,653	20,638.55	2,531,381,079	28,584.21	3,505,939,710	0.70
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディ ア・娯楽	161,985	12,982.96	2,103,045,051	20,540.02	3,327,176,160	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	221,818	12,926.49	2,867,330,288	14,995.66	3,326,309,417	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	96,287	27,275.62	2,626,287,883	33,746.62	3,249,361,012	0.65
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバ コ	257,722	12,107.92	3,120,477,487	12,442.65	3,206,745,416	0.64
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	55,706	38,271.33	2,131,943,260	57,001.25	3,175,312,061	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフト ウェア・ サービス	79,568	33,608.23	2,674,140,019	39,656.32	3,155,374,229	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	696,115	2,754.46	1,917,424,264	4,316.58	3,004,838,105	0.60
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフト ウェア・ サービス	99,576	16,604.28	1,653,388,362	26,187.34	2,607,630,906	0.52
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	366,338	6,786.52	2,486,161,262	7,059.97	2,586,337,744	0.52
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	38,356	38,363.68	1,471,477,616	67,015.73	2,570,455,723	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディ ア・娯楽	410,677	4,406.25	1,809,548,817	6,086.83	2,499,723,466	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信 サービス	372,585	6,187.58	2,305,400,203	6,486.49	2,416,772,193	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネル ギー	380,565	4,956.48	1,886,265,361	6,276.14	2,388,482,987	0.48
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	63,299	40,049.27	2,535,079,090	35,687.18	2,258,962,965	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディ ア・娯楽	39,733	46,049.82	1,829,697,677	56,837.40	2,258,320,688	0.45

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフト ウェア・ サービス	43,204	42,419.64	1,832,698,282	51,531.07	2,226,348,633	0.44
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	641,081	3,430.90	2,199,486,662	3,402.11	2,181,033,402	0.44
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	379,822	5,029.55	1,910,335,753	5,731.45	2,176,933,347	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	3.33
		素材	4.43
		資本財	6.69
		商業・専門サービス	1.17
		運輸	2.04
		自動車・自動車部品	2.02
		耐久消費財・アパレル	1.91
		消費者サービス	1.68
		メディア・娯楽	7.00
		小売	5.66
		食品・生活必需品小売り	1.33
		食品・飲料・タバコ	3.97
		家庭用品・パーソナル用品	1.84
		ヘルスケア機器・サービス	5.11
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.29
		銀行	6.21
		各種金融	4.51
		保険	3.24
		不動産	0.49
		ソフトウェア・サービス	11.28
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.59		
電気通信サービス	1.82		
公益事業	3.05		
半導体・半導体製造装置	4.43		
	小計	96.09	
投資信託受益証券			0.06
投資証券			2.14
合計			98.30

(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	274	アメリカドル	54,201,015.5	6,000,594,425	54,083,490	5,987,583,177	1.19
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	5,367,184	471,131,412	5,342,400	468,955,872	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	28	スイスフラン	3,014,706	354,077,220	3,078,040	361,515,798	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	177	ユーロ	6,713,396.5	871,398,866	6,853,440	889,576,512	0.18
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	14	オーストラリアドル	2,380,098	200,785,067	2,348,500	198,119,460	0.04
	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	37	イギリスポンド	2,490,758.75	379,168,204	2,490,655	379,152,410	0.08

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

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

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	イギリスポンド	売建	250,000.00	38,052,300	38,055,000	0.01

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

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

新興国株式インデックス 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	21,847,584,926	23.23
	台湾	12,203,125,249	12.97
	韓国	11,938,948,395	12.69

	中国	10,238,919,311	10.89
	インド	8,662,612,696	9.21
	ブラジル	3,662,986,600	3.89
	南アフリカ	3,293,801,167	3.50
	サウジアラビア	2,400,543,194	2.55
	ロシア	2,332,154,445	2.48
	タイ	1,674,103,667	1.78
	メキシコ	1,508,653,846	1.60
	マレーシア	1,227,710,909	1.31
	インドネシア	1,110,864,575	1.18
	香港	1,054,897,986	1.12
	バミューダ	708,676,259	0.75
	カタール	608,218,800	0.65
	フィリピン	589,932,904	0.63
	ポーランド	514,492,259	0.55
	チリ	510,539,109	0.54
	アラブ首長国連邦	503,559,821	0.54
	クウェート	439,076,589	0.47
	アメリカ	328,691,133	0.35
	トルコ	256,034,976	0.27
	オランダ	212,307,247	0.23
	ハンガリー	188,809,133	0.20
	ルクセンブルク	166,525,767	0.18
	コロンビア	141,827,087	0.15
	ギリシャ	87,323,269	0.09
	チェコ	81,457,519	0.09
	キプロス	77,900,494	0.08
	エジプト	57,365,233	0.06
	ジャージー	56,476,797	0.06
	英ヴァージン諸島	26,627,825	0.03
	シンガポール	25,604,802	0.03
	マン島	23,429,509	0.02
	ペルー	18,893,149	0.02
	パキスタン	17,862,733	0.02
	アルゼンチン	15,888,975	0.02
	小計	88,814,428,355	94.42
投資信託受益証券	ブラジル	182,483,166	0.19
	メキシコ	30,021,045	0.03
	小計	212,504,211	0.23
投資証券	メキシコ	40,351,549	0.04
	南アフリカ	29,554,857	0.03
	小計	69,906,406	0.07

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,963,108,026	5.28
合計(純資産総額)		94,059,946,998	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,975,174,548	5.29

(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		221,400,000	0.24

(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	2,454,389	1,784.39	4,379,598,277	2,316.35	5,685,248,504	6.04
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	571,600	8,868.66	5,069,327,867	8,679.28	4,961,076,448	5.27
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	188,334	32,121.38	6,049,548,855	25,380.26	4,779,967,299	5.08
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	474,322	5,901.06	2,799,004,031	8,039.16	3,813,150,450	4.05
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	359,300	4,774.07	1,715,323,382	4,180.86	1,502,184,435	1.60
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	43,648	25,004.31	1,091,388,469	26,270.50	1,146,655,220	1.22
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,450,620	84.15	795,349,058	93.98	888,207,070	0.94
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	279,072	3,117.06	869,885,285	3,084.53	860,807,631	0.92
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	85,581	9,394.85	804,020,709	9,188.92	786,397,818	0.84

中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	588,000	1,194.73	702,504,768	1,332.15	783,305,376	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	54,927	8,568.47	470,640,551	13,154.10	722,515,251	0.77
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	332,785	1,727.55	574,904,724	2,105.65	700,730,732	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	368,378	1,210.72	446,002,759	1,859.86	685,131,949	0.73
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	170,867	3,290.75	562,281,562	3,960.58	676,733,790	0.72
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	26,907	15,963.27	429,523,837	24,160.24	650,079,666	0.69
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	1,208,248	315.05	380,665,782	502.45	607,096,290	0.65
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	83,239	5,439.13	452,748,364	7,237.20	602,417,291	0.64
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	38,981	12,951.91	504,878,607	14,994.56	584,503,037	0.62
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	147,804	2,723.75	402,582,623	3,767.48	556,848,614	0.59
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	126,816	5,000.77	634,177,737	4,157.16	527,194,466	0.56
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	1,405,800	373.94	525,688,226	364.54	512,475,955	0.54
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	5,924,515	66.92	396,515,940	79.17	469,069,921	0.50
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	40,751	9,724.76	396,293,955	11,392.05	464,237,796	0.49
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	511,368	711.83	364,007,912	899.00	459,721,877	0.49
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	94,235	4,159.96	392,014,335	4,800.99	452,421,858	0.48
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	318,000	1,151.73	366,250,879	1,399.08	444,907,440	0.47
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	257,781	1,362.84	351,314,284	1,705.48	439,642,286	0.47
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	11,900	29,144.40	346,818,360	36,821.70	438,178,230	0.47
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	575,861	489.33	281,790,785	652.96	376,018,563	0.40
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,575	52,777.02	294,231,935	65,526.00	365,307,450	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	4.52
		素材	7.55
		資本財	2.45

商業・専門サービス	0.32
運輸	1.30
自動車・自動車部品	3.12
耐久消費財・アパレル	1.41
消費者サービス	1.31
メディア・娯楽	8.72
小売	10.85
食品・生活必需品小売り	1.18
食品・飲料・タバコ	3.17
家庭用品・パーソナル用品	0.96
ヘルスケア機器・サービス	1.15
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.17
銀行	12.45
各種金融	1.92
保険	2.76
不動産	1.96
ソフトウェア・サービス	2.35
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.86
電気通信サービス	2.31
公益事業	1.88
半導体・半導体製造装置	8.75
小計	94.42
投資信託受益証券	0.23
投資証券	0.07
合計	94.72

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	684	アメリカドル	45,874,483	5,078,764,013	44,938,800	4,975,174,548	5.29

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,000,000.00	220,014,500	221,400,000	0.24

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	518,597,744,100	83.63
地方債証券	日本	33,203,133,761	5.35
特殊債券	日本	40,892,469,726	6.59
社債券	日本	24,843,501,620	4.01
	フランス	1,299,973,000	0.21
	オーストラリア	399,696,000	0.06
	小計	26,543,170,620	4.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		884,586,310	0.14
合計(純資産総額)		620,121,104,517	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)	8,520,000,000	100.99	8,605,145,300	100.94	8,600,343,600	0.100	2025/9/20	1.39
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	7,780,000,000	101.21	7,874,265,100	100.94	7,853,287,600	0.100	2028/3/20	1.27
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,790,000,000	100.98	7,866,880,700	100.80	7,852,475,800	0.100	2024/9/20	1.27
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	100.75	7,355,407,000	0.100	2024/6/20	1.19
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	100.66	7,097,164,500	0.100	2023/12/20	1.14
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	100.59	6,800,222,000	0.100	2023/9/20	1.10
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	100.91	6,781,219,200	0.100	2025/6/20	1.09

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	100.96	6,703,810,400	0.100	2026/9/20	1.08
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	6,550,000,000	100.74	6,598,958,600	100.18	6,562,314,000	0.100	2030/9/20	1.06
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	102.29	6,464,791,200	0.400	2025/9/20	1.04
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	6,350,000,000	101.36	6,436,406,300	100.95	6,410,833,000	0.100	2027/3/20	1.03
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	5,850,000,000	100.67	5,889,195,000	100.39	5,873,166,000	0.100	2022/12/20	0.95
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	5,770,000,000	100.90	5,821,961,000	100.70	5,810,390,000	0.100	2024/3/20	0.94
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	5,540,000,000	101.07	5,599,278,000	100.84	5,586,591,400	0.100	2024/12/20	0.90
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	5,380,000,000	101.31	5,450,478,000	100.94	5,430,948,600	0.100	2026/3/20	0.88
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	102.37	5,210,938,400	0.600	2024/6/20	0.84
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	102.18	4,955,875,500	0.400	2025/6/20	0.80
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	4,880,000,000	101.50	4,953,361,200	100.94	4,925,920,800	0.100	2027/9/20	0.79
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	102.54	4,922,030,800	102.02	4,896,960,000	0.600	2023/12/20	0.79
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	4,820,000,000	101.26	4,881,165,000	100.96	4,866,705,800	0.100	2026/6/20	0.78
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	100.54	4,856,516,700	0.100	2029/9/20	0.78
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	101.23	4,849,085,500	100.67	4,822,380,400	0.100	2029/3/20	0.78
日本	国債証券	第416回利付国債（2年）	4,770,000,000	100.45	4,791,896,700	100.32	4,785,597,900	0.100	2022/9/1	0.77
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	100.27	4,783,069,800	0.100	2022/6/20	0.77
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,740,000,000	99.97	4,738,702,200	100.09	4,744,550,400	0.100	2030/12/20	0.77
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	4,040,000,000	116.73	4,716,165,000	115.21	4,654,564,800	1.400	2034/9/20	0.75
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,610,000,000	101.47	4,677,767,000	100.86	4,649,968,700	0.100	2028/6/20	0.75
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	4,570,000,000	101.22	4,625,754,000	100.61	4,598,105,500	0.100	2029/6/20	0.74
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	4,470,000,000	101.37	4,531,462,500	100.77	4,504,508,400	0.100	2028/12/20	0.73
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	100.33	4,394,497,800	0.100	2022/9/20	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	83.63
地方債証券	5.35
特殊債券	6.59
社債券	4.28
合計	99.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックス 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	125,674,591,942	42.80
	フランス	30,117,501,813	10.26
	イタリア	27,767,139,279	9.46
	ドイツ	21,814,683,400	7.43
	イギリス	19,233,615,927	6.55
	スペイン	17,236,414,422	5.87
	ベルギー	7,194,948,174	2.45
	オーストラリア	6,648,346,305	2.26
	カナダ	5,773,375,377	1.97
	オランダ	5,446,816,545	1.85
	オーストリア	4,368,013,699	1.49
	アイルランド	2,462,967,655	0.84
	メキシコ	2,260,393,520	0.77
	フィンランド	1,849,296,503	0.63
	ポーランド	1,825,319,867	0.62
	デンマーク	1,444,885,839	0.49
	マレーシア	1,387,016,479	0.47
	イスラエル	1,276,759,775	0.43
	シンガポール	1,248,405,851	0.43
	スウェーデン	961,667,589	0.33
ノルウェー	725,466,895	0.25	
	小計	286,717,626,856	97.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,927,550,987	2.36
合計(純資産総額)		293,645,177,843	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	1,862,277,127	0.63
	買建	ドイツ	2,454,279,168	0.84

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		4,417,065,800	1.50

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	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	10,931.87	1,743,634,521	10,051.25	1,603,175,517	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	11,020.64	1,553,910,260	10,094.50	1,423,324,959	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	12,478.22	1,341,409,504	11,849.86	1,273,860,178	2.375	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,946.15	1,293,320,447	11,994.73	1,198,274,182	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,021.11	1,220,143,339	11,762.07	1,193,850,372	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,133.55	1,240,049,473	11,634.06	1,189,001,360	2.000	2026/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,859.58	1,176,679,165	13,488.68	1,145,189,458	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,801.46	1,204,362,812	10,257.10	1,143,667,605	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,554.49	1,155,449,139	11,400.10	1,140,010,275	2.000	2022/10/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,393.18	1,139,318,337	11,284.63	1,128,463,576	1.500	2022/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,092.92	1,125,931,439	11,091.75	1,125,813,450	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,016.86	1,101,686,281	11,019.10	1,101,910,469	0.125	2024/1/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	13,093.18	1,167,912,311	12,197.12	1,087,983,843	2.875	2028/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	23,507.02	1,109,531,684	22,972.78	1,084,315,347	4.500	2041/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	11,064.13	1,106,413,598	10,842.22	1,084,222,819	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,418.69	1,090,485,715	11,285.93	1,077,806,607	1.750	2022/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	11,389.93	1,087,739,260	11,256.30	1,074,977,557	1.750	2022/3/31	0.37
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	13,300.74	1,076,029,974	13,275.29	1,073,971,365	0.000	2025/3/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,367.20	1,079,884,606	11,295.44	1,073,067,489	1.500	2022/9/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,688.82	1,068,882,908	10,556.37	1,055,637,154	0.625	2027/12/31	0.36

アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,348.48	1,105,189,824	11,775.91	1,053,944,068	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,364.77	1,122,640,916	12,400.38	1,041,632,338	3.125	2028/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	16,309.93	1,040,573,735	16,108.18	1,027,701,884	2.500	2030/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,615.80	1,045,422,352	11,404.85	1,026,437,386	1.375	2025/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,476.21	1,032,859,428	11,334.58	1,020,112,641	1.875	2022/7/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,418.54	1,061,785,877	11,751.69	1,004,769,799	2.250	2027/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,873.64	1,042,506,250	11,402.26	1,001,118,878	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	11,018.19	1,046,728,177	10,474.63	995,090,452	0.375	2027/7/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,953.26	1,013,032,246	15,644.01	993,394,966	3.500	2026/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 12/31/24	8,400,000	12,041.87	1,011,517,481	11,772.88	988,922,266	2.250	2024/12/31	0.34

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.64
合計	97.64

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	54	アメリカドル	6,716,401.28	743,572,785	6,672,375	738,698,636	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	36	アメリカドル	4,785,147.74	529,763,706	4,722,750	522,855,652	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	35	アメリカドル	5,542,973	613,662,541	5,426,093.75	600,722,839	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	24	ユーロ	2,690,680.4	349,250,316	2,690,160	349,182,768	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	34	ユーロ	4,592,101.4	596,054,762	4,590,000	595,782,000	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	68	ユーロ	11,653,042.8	1,512,564,955	11,628,000	1,509,314,400	0.51

(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	17,960,000.00	1,956,868,496	1,987,992,400	0.68
	カナダドル	買建	2,420,000.00	209,360,827	212,403,400	0.07
	ユーロ	買建	14,580,000.00	1,887,497,389	1,892,484,000	0.64
	イギリスポンド	買建	2,130,000.00	321,891,030	324,186,000	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。

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	中国	6,773,455,881	10.32
	インドネシア	6,233,205,624	9.50
	メキシコ	6,114,503,797	9.32
	タイ	5,637,858,754	8.59
	ポーランド	5,292,975,678	8.06
	ブラジル	5,233,285,398	7.97
	南アフリカ	4,721,219,188	7.19
	マレーシア	4,676,937,699	7.13
	ロシア	4,647,297,684	7.08
	コロンビア	3,214,202,399	4.90
	ハンガリー	2,617,749,199	3.99
	チェコ	2,568,911,561	3.91
	チリ	1,650,743,784	2.52
	ペルー	1,648,646,287	2.51
	トルコ	1,123,793,475	1.71
	ドミニカ共和国	93,579,015	0.14
	フィリピン	91,736,028	0.14
ウルグアイ	85,541,513	0.13	
	小計	62,425,642,964	95.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,209,980,427	4.89
合計(純資産総額)		65,635,623,391	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		286,110,000	0.44

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	76,100,000,000	3.84	2,923,966,352	3.67	2,796,756,960	9.850	2027/6/28	4.26
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000	1,605.13	1,345,106,367	1,558.41	1,305,954,823	0.000	2024/1/1	1.99
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	113,100,000	876.69	991,543,284	843.00	953,434,176	10.500	2026/12/21	1.45
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,657.91	848,854,634	1,633.33	836,269,683	0.000	2023/7/1	1.27
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000	2,107.88	795,724,934	2,018.50	761,986,960	10.000	2023/1/1	1.16
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	25,750,000	2,933.36	755,340,643	2,785.61	717,296,609	3.885	2029/8/15	1.09
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000	2,168.72	728,690,054	2,022.96	679,714,670	10.000	2025/1/1	1.04
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	173,700,000	432.17	750,693,309	389.95	677,352,824	3.300	2038/6/17	1.03
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	39,000,000	1,684.16	656,825,676	1,684.25	656,858,514	2.940	2024/10/17	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	106,900,000	640.42	684,612,517	602.31	643,872,084	8.500	2029/5/31	0.98
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000	707.67	673,708,476	675.44	643,021,355	8.000	2030/1/31	0.98
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,769.65	632,866,065	2,736.50	625,290,696	3.480	2023/3/15	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	599.25	651,086,537	572.48	621,999,976	7.500	2027/6/3	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	640.47	642,071,502	614.69	616,234,023	10.000	2024/12/5	0.94
中国	国債証券	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000	1,700.63	595,223,272	1,699.62	594,869,632	3.250	2026/6/6	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	555.83	601,413,145	548.86	593,874,743	6.500	2022/6/9	0.90
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	29,350,000	2,199.98	645,694,617	2,013.87	591,072,774	10.000	2027/1/1	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	19,850,000	3,017.07	598,888,561	2,967.39	589,028,197	2.500	2024/4/25	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,937.41	584,546,401	2,910.89	579,268,380	2.500	2023/1/25	0.88
中国	国債証券	CGB 2.68% 05/21/30	35,400,000	1,607.86	569,185,449	1,609.71	569,840,441	2.680	2030/5/21	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	590.76	578,656,316	573.39	561,640,422	8.000	2023/12/7	0.86
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	17,600,000	3,085.22	542,998,908	3,013.83	530,435,678	2.500	2026/7/25	0.81
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	97,800,000	553.55	541,374,254	532.84	521,118,087	5.750	2026/3/5	0.79
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	601.23	536,903,016	577.11	515,361,695	8.750	2048/2/28	0.79

中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,643.08	501,140,534	1,652.03	503,871,493	2.850	2027/6/4	0.77
中国	国債証券	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000	1,698.41	499,333,078	1,699.27	499,586,520	3.190	2024/4/11	0.76
中国	国債証券	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000	1,679.36	470,222,848	1,683.57	471,402,120	3.020	2025/10/22	0.72
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000	437.33	521,299,386	395.44	471,374,314	3.400	2036/6/17	0.72
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	430.82	492,434,015	408.42	466,829,238	3.650	2031/6/20	0.71
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000	455.32	480,363,584	439.73	463,921,090	4.875	2029/6/22	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.11
合計	95.11

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	香港・オフショア人民元	買建	17,000,000.00	287,034,800	286,110,000	0.44

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

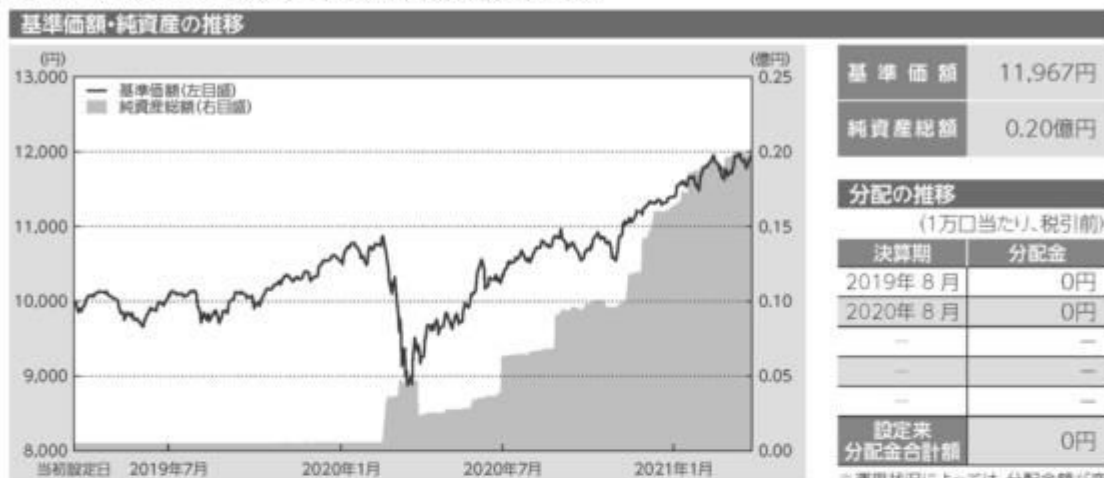
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2019年3月20日
作成基準日：2021年3月31日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030


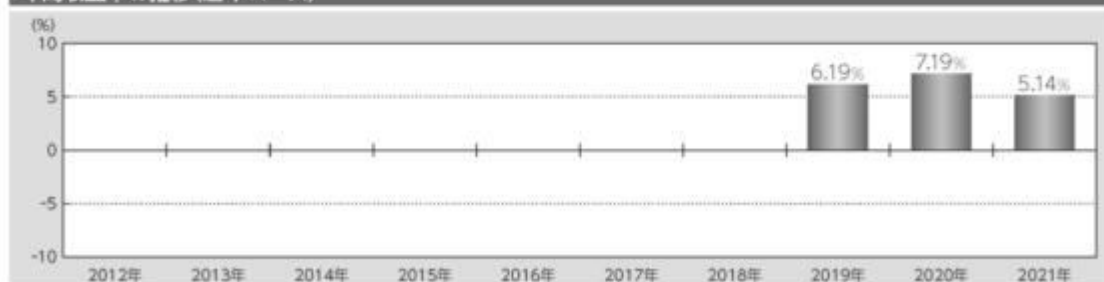
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	32.6%
外国債券バッシュファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	23.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	16.3%
外国債券インデックス マザーファンド	8.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.1%
国内債券インデックス マザーファンド	6.0%
国内株式インデックス マザーファンド	5.4%

※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)


※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2021年3月31日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

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。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
-	-
-	-
-	-
設定来 分配金合計額	0円

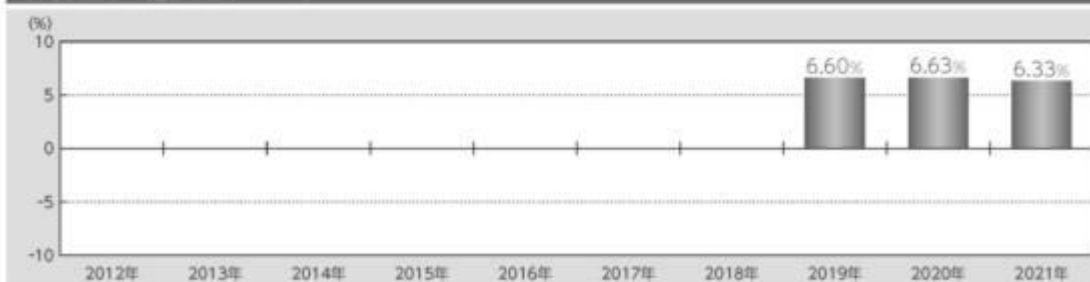
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	36.5%
新興国株式インデックス マザーファンド	18.3%
外国債券バシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	15.0%
外国債券インデックス マザーファンド	11.1%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.5%
国内株式インデックス マザーファンド	6.1%
国内債券インデックス マザーファンド	4.8%

※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)



※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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


運用実績

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2021年3月31日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050**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	12,277円
純資産総額	0.07億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

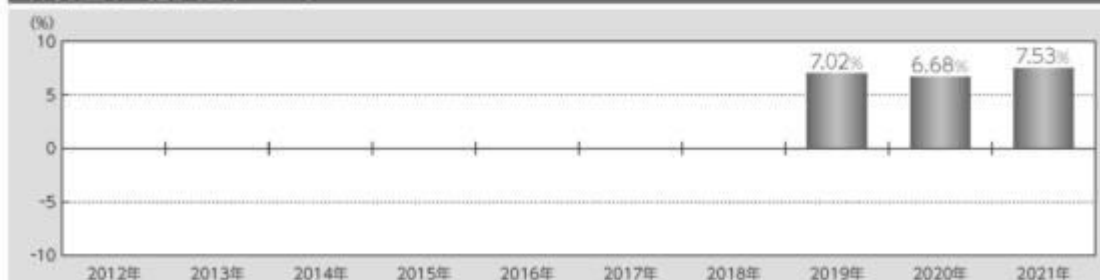
決算期	分配金
2019年8月	0円
2020年8月	0円
—	—
—	—
—	—
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	40.4%
新興国株式インデックス マザーファンド	20.7%
外国債券インデックス マザーファンド	13.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.7%
外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	6.7%
国内株式インデックス マザーファンド	6.7%
国内債券インデックス マザーファンド	3.7%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2021年3月31日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060

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	12,498円
純資産総額	0.14億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
-	-
-	-
-	-
設定来 分配金合計額	0円

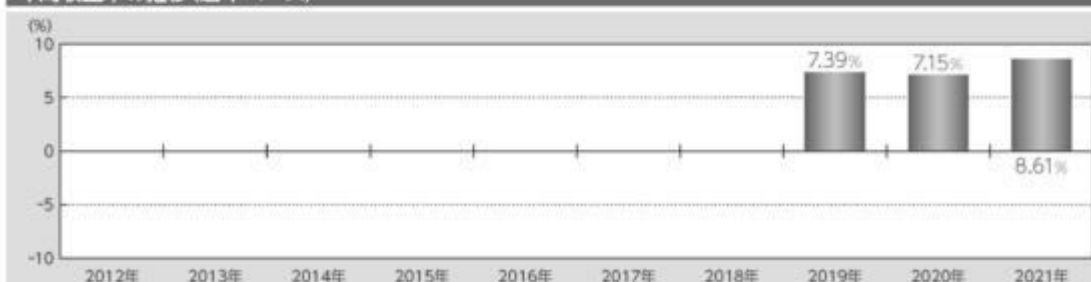
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	43.8%
新興国株式インデックス マザーファンド	21.7%
外国債券インデックス マザーファンド	16.6%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.3%
国内株式インデックス マザーファンド	7.2%
国内債券インデックス マザーファンド	1.8%

※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)



※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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 >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「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 >

1円以上1円単位とします。

< 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 >

ありません。

< 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、申込日当日又はその翌営業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、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 >

1口以上1口単位とします。

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、振り込まれることとなります。

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日又はその翌営業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（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2019年3月20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8月29日から翌年8月28日までとします。

ただし、第1計算期間は2019年3月20日から2019年8月28日までとします。

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

(5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

(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2期計算期間(2019年8月29日から2020年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,435	762,713
投資信託受益証券	137,421	1,767,030
親投資信託受益証券	345,326	6,588,066
流動資産合計	489,182	9,117,809
資産合計	489,182	9,117,809
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	133	945
未払委託者報酬	728	8,502
未払利息	-	1
その他未払費用	-	56
流動負債合計	861	9,504
負債合計	861	9,504
純資産の部		
元本等		
元本	500,000	8,374,607
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	11,679	733,698
(分配準備積立金)	5,460	395,931
元本等合計	488,321	9,108,305
純資産合計	488,321	9,108,305
負債純資産合計	489,182	9,117,809

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	自	2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
営業収益				
受取配当金		1,437		8,378
有価証券売買等損益		12,253		98,467
営業収益合計		10,816		106,845
営業費用				
支払利息		2		5
受託者報酬		133		1,105
委託者報酬		728		9,546
その他費用		-		56
営業費用合計		863		10,712
営業利益又は営業損失（ ）		11,679		96,133
経常利益又は経常損失（ ）		11,679		96,133
当期純利益又は当期純損失（ ）		11,679		96,133
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（ ）		-		304,872
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		11,679
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		466,246
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		466,246
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		121,874
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		121,874
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,679		733,698

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	500,000口	8,374,607口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 11,679円	元本の欠損 - 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9766円 (1万口当たり純資産額) (9,766円)	1口当たり純資産額 1.0876円 (1万口当たり純資産額) (10,876円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日			第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,460円	費用控除後の配当等収益額	A	53,258円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	340,302円
収益調整金額	C	- 円	収益調整金額	C	337,767円

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日			第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日		
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	2,371円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,460円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	733,698円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口	当ファンドの期末残存口数	F	8,374,607口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	109円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	876円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28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2期 (2020年 8月28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

	第2期 (2020年 8月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(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1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	500,000円
期中追加設定元本額	- 円	10,722,971円
期中一部解約元本額	- 円	2,848,364円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	6,921	5,076
親投資信託受益証券	19,174	417,792

合計	12,253	412,716
----	--------	---------

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,695,644	1,767,030	
投資信託受益証券合計		1,695,644	1,767,030	
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	450,611	1,352,959	
	国内株式インデックス マザーファンド	293,067	444,699	
	外国株式インデックス マザーファンド	923,165	2,724,167	
	国内債券インデックス マザーファンド	415,240	583,370	
	外国債券インデックス マザーファンド	270,130	808,634	
	新興国債券インデックス マザーファンド	408,579	674,237	
親投資信託受益証券合計		2,760,792	6,588,066	
合計			8,355,096	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

(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2期計算期間(2019年8月29日から2020年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,939	266,568
投資信託受益証券	90,035	1,580,231
親投資信託受益証券	387,719	8,426,855
流動資産合計	483,693	10,273,654
資産合計	483,693	10,273,654
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	133	1,063
未払委託者報酬	734	9,530
その他未払費用	-	73
流動負債合計	867	10,666
負債合計	867	10,666
純資産の部		
元本等		
元本	500,000	9,496,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	17,174	766,396
(分配準備積立金)	5,588	722,152
元本等合計	482,826	10,262,988
純資産合計	482,826	10,262,988
負債純資産合計	483,693	10,273,654

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	自	2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
営業収益				
受取配当金		941		7,884
有価証券売買等損益		17,246		746,424
営業収益合計		16,305		754,308
営業費用				
支払利息		2		-
受託者報酬		133		1,213
委託者報酬		734		10,483
その他費用		-		73
営業費用合計		869		11,769
営業利益又は営業損失（ ）		17,174		742,539
経常利益又は経常損失（ ）		17,174		742,539
当期純利益又は当期純損失（ ）		17,174		742,539
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（ ）		-		3,448
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		17,174
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		44,479
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,560
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		41,919
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,174		766,396

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	500,000口	9,496,592口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 17,174円	元本の欠損 - 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9657円 (1万口当たり純資産額) (9,657円)	1口当たり純資産額 1.0807円 (1万口当たり純資産額) (10,807円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日			第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,588円	費用控除後の配当等収益額	A	63,729円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	652,911円
収益調整金額	C	- 円	収益調整金額	C	109,972円

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日			第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日		
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	5,512円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,588円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	832,124円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口	当ファンドの期末残存口数	F	9,496,592口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	111円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	876円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28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2期 (2020年 8月28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

	第2期 (2020年 8月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(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1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	500,000円
期中追加設定元本額	- 円	9,066,056円
期中一部解約元本額	- 円	69,464円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	4,535	6,436
親投資信託受益証券	21,781	725,788

合計	17,246	719,352
----	--------	---------

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,516,391	1,580,231	
投資信託受益証券合計		1,516,391	1,580,231	
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	581,384	1,745,605	
	国内株式インデックス マザーファンド	380,146	576,833	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,192,207	3,518,083	
	国内債券インデックス マザーファンド	385,530	541,631	
	外国債券インデックス マザーファンド	409,758	1,226,610	
	新興国債券インデックス マザーファンド	495,754	818,093	
親投資信託受益証券合計		3,444,779	8,426,855	
合計			10,007,086	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

(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2期計算期間(2019年8月29日から2020年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,444	63,420
投資信託受益証券	42,648	373,393
親投資信託受益証券	430,060	4,509,499
流動資産合計	478,152	4,946,312
資産合計		
	478,152	4,946,312
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	133	369
未払委託者報酬	734	3,301
その他未払費用	-	7
流動負債合計	867	3,677
負債合計		
	867	3,677
純資産の部		
元本等		
元本	500,000	4,576,106
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	22,715	366,529
(分配準備積立金)	5,724	295,442
元本等合計	477,285	4,942,635
純資産合計		
	477,285	4,942,635
負債純資産合計		
	478,152	4,946,312

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	自	2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
営業収益				
受取配当金		446		1,439
有価証券売買等損益		22,292		328,309
営業収益合計		21,846		329,748
営業費用				
支払利息		2		1
受託者報酬		133		520
委託者報酬		734		4,236
その他費用		-		7
営業費用合計		869		4,764
営業利益又は営業損失（ ）		22,715		324,984
経常利益又は経常損失（ ）		22,715		324,984
当期純利益又は当期純損失（ ）		22,715		324,984
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（ ）		-		8,052
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		22,715
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		72,312
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		3,917
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		68,395
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,715		366,529

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	500,000口	4,576,106口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 22,715円	元本の欠損 - 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9546円 (1万口当たり純資産額) (9,546円)	1口当たり純資産額 1.0801円 (1万口当たり純資産額) (10,801円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日			第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,724円	費用控除後の配当等収益額	A	26,394円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	263,632円
収益調整金額	C	- 円	収益調整金額	C	71,087円

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日			第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日		
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	5,416円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,724円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	366,529円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口	当ファンドの期末残存口数	F	4,576,106口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	114円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	800円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28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2期 (2020年 8月28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

	第2期 (2020年 8月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(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1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	500,000円
期中追加設定元本額	- 円	4,213,212円
期中一部解約元本額	- 円	137,106円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	2,148	2,095
親投資信託受益証券	24,440	324,096

合計	22,292	322,001
----	--------	---------

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	358,309	373,393	
投資信託受益証券合計		358,309	373,393	
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	319,077	958,028	
	国内株式インデックス マザーファンド	201,399	305,602	
	外国株式インデックス マザーファンド	644,372	1,901,477	
	国内債券インデックス マザーファンド	144,745	203,352	
	外国債券インデックス マザーファンド	242,822	726,887	
	新興国債券インデックス マザーファンド	250,972	414,153	
親投資信託受益証券合計		1,803,387	4,509,499	
合計			4,882,892	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

(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2期計算期間(2019年8月29日から2020年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,998	34,630
親投資信託受益証券	468,201	2,946,608
流動資産合計	473,199	2,981,238
資産合計	473,199	2,981,238
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	2,007
未払受託者報酬	133	309
未払委託者報酬	733	2,729
その他未払費用	-	9
流動負債合計	866	5,054
負債合計	866	5,054
純資産の部		
元本等		
元本	500,000	2,746,642
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	27,667	229,542
(分配準備積立金)	5,917	256,038
元本等合計	472,333	2,976,184
純資産合計	472,333	2,976,184
負債純資産合計	473,199	2,981,238

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	自	2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
営業収益				
有価証券売買等損益		26,799		319,965
営業収益合計		26,799		319,965
営業費用				
支払利息		2		-
受託者報酬		133		460
委託者報酬		733		3,662
その他費用		-		9
営業費用合計		868		4,131
営業利益又は営業損失()		27,667		315,834
経常利益又は経常損失()		27,667		315,834
当期純利益又は当期純損失()		27,667		315,834
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()		-		42,329
期首剰余金又は期首欠損金()		-		27,667
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		33,374
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		33,374
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		49,670
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		49,670
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		27,667		229,542

(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1期 (2019年 8月28日現在)	第2期 (2020年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	500,000口	2,746,642口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 27,667円	元本の欠損 - 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9447円 (9,447円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0836円 (10,836円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日			第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,917円	費用控除後の配当等収益額	A	23,426円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	228,877円
収益調整金額	C	- 円	収益調整金額	C	31,236円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	3,735円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,917円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	287,274円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口	当ファンドの期末残存口数	F	2,746,642口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	118円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,045円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28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2期 (2020年 8月28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1期	第2期
	自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	500,000円
期中追加設定元本額	- 円	2,820,411円
期中一部解約元本額	- 円	573,769円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	(2019年 8月28日現在)	(2020年 8月28日現在)
	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	26,799	275,529
合計	26,799	275,529

（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	207,955	624,384	
	国内株式インデックス マザーファンド	135,163	205,096	
	外国株式インデックス マザーファンド	426,556	1,258,724	
	国内債券インデックス マザーファンド	42,129	59,187	
	外国債券インデックス マザーファンド	177,975	532,768	
	新興国債券インデックス マザーファンド	161,465	266,449	
合計		1,151,243	2,946,608	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,576,383,264
株式	327,403,541,110
派生商品評価勘定	62,368,500
未収配当金	448,445,144
差入委託証拠金	99,217,600
流動資産合計	330,589,955,618
資産合計	330,589,955,618
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,198,200
前受金	53,193,400
未払金	20,665,690
未払解約金	45,898,534
未払利息	5,004

	2020年 8月28日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	128,960,828
負債合計	128,960,828
純資産の部	
元本等	
元本	217,774,818,206
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,686,176,584
元本等合計	330,460,994,790
純資産合計	330,460,994,790
負債純資産合計	330,589,955,618

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	217,774,818,206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 1.5174円 (1万口当たり純資産額) (15,174円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2020年 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2020年 8月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	206,771,932,531円
期中追加設定元本額	54,103,073,799円
期中一部解約元本額	43,100,188,124円
期末元本額	217,774,818,206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）	533,859,102円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,085,609,717円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,351,328円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,377,832,136円
世界経済インデックスファンド	2,339,046,501円
日本株式インデックス・オープン	4,041,113,944円
DCマイセレクション25	6,927,749,838円
DCマイセレクション50	19,533,748,240円
DCマイセレクション75	18,208,920,570円
DC日本株式インデックス・オープン	5,811,523,969円

区分	2020年 8月28日現在
DCマイセレクションS25	2,977,700,112円
DCマイセレクションS50	8,314,903,267円
DCマイセレクションS75	5,369,383,254円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,154,799,931円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	309,483,179円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	692,947,736円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	474,999,901円
DC世界経済インデックスファンド	2,989,623,159円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,040,442,138円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	16,667,317円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	34,140,400円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	31,881,137円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	260,088,206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）	65,535,012円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	243,998,549円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	53,440,067円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	254,231,173円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,467,585,255円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	653,520,076円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,737,206,358円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	626,409,918円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	39,822,658円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	692,574,723円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	33,884,049円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	400,873,310円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	505,364,301円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	52,126,077円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	828,742,385円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,453,815,279円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,950,148,872円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,687,113,627円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,132,578,799円
分散投資コア戦略ファンドA	5,501,749,681円
分散投資コア戦略ファンドS	15,115,390,823円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	340,630,404円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	355,853,720円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,476,493,092円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	209,343,304円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,643,360円
SMT インデックスバランス・オープン	66,766,510円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	12,641,059,306円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円

区分	2020年 8月28日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	25,406,953円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	82,611,309円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	14,587,355円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,159,717円
グローバル経済コア	259,736,840円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	19,450,183円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	46,942,953円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,284,826円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	815,925,174円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	115,450,954円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	293,067円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	380,146円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	201,399円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	135,163円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	49,832,294,235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）	1,832,426,832円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	71,868,171円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,252,443円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	8,077,713,937	
合計	8,077,713,937	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,993,456,600	-	3,046,650,000	53,193,400
合計		2,993,456,600	-	3,046,650,000	53,193,400

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,900	2,691.00	18,567,900	
日本水産	197,700	471.00	93,116,700	
マルハニチロ	28,600	2,337.00	66,838,200	
カネコ種苗	6,000	1,410.00	8,460,000	
サカタのタネ	23,600	3,460.00	81,656,000	
ホクト	15,100	2,135.00	32,238,500	
ホクリヨウ	3,100	651.00	2,018,100	
住石ホールディングス	39,900	117.00	4,668,300	
日鉄鉱業	4,500	4,150.00	18,675,000	
三井松島ホールディングス	7,700	712.00	5,482,400	
国際石油開発帝石	727,000	654.80	476,039,600	
石油資源開発	25,800	1,807.00	46,620,600	
K & O エナジーグループ	9,600	1,490.00	14,304,000	
ヒノキヤグループ	4,900	1,750.00	8,575,000	
ショーボンドホールディングス	30,800	4,975.00	153,230,000	
ミライト・ホールディングス	58,700	1,483.00	87,052,100	
タマホーム	10,700	1,228.00	13,139,600	
サンヨーホームズ	1,700	608.00	1,033,600	
日本アクア	7,900	622.00	4,913,800	
ファーストコーポレーション	6,000	602.00	3,612,000	
ベステラ	3,400	947.00	3,219,800	
T A T E R U	36,700	184.00	6,752,800	
キャンディル	3,300	641.00	2,115,300	
スペースバリューホールディングス	24,100	358.00	8,627,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	677.00	2,572,600	
第一カッター興業	2,400	2,252.00	5,404,800	
明豊ファシリティワークス	6,400	550.00	3,520,000	
安藤・間	117,700	708.00	83,331,600	
東急建設	57,900	477.00	27,618,300	
コムシスホールディングス	70,100	2,939.00	206,023,900	
ピーアールホールディングス	21,500	617.00	13,265,500	
高松コンストラクショングループ	12,300	2,251.00	27,687,300	
東建コーポレーション	6,100	6,750.00	41,175,000	

ソネック	2,000	835.00	1,670,000	
ヤマウラ	8,600	807.00	6,940,200	
大成建設	152,200	3,565.00	542,593,000	
大林組	456,500	1,008.00	460,152,000	
清水建設	463,300	803.00	372,029,900	
飛島建設	13,100	1,088.00	14,252,800	
長谷工コーポレーション	176,700	1,445.00	255,331,500	
松井建設	18,000	716.00	12,888,000	
銭高組	2,000	3,755.00	7,510,000	
鹿島建設	358,400	1,301.00	466,278,400	
不動テトラ	11,900	1,381.00	16,433,900	
大末建設	5,300	845.00	4,478,500	
鉄建建設	9,900	2,040.00	20,196,000	
西松建設	35,200	1,996.00	70,259,200	
三井住友建設	110,300	430.00	47,429,000	
大豊建設	10,200	2,615.00	26,673,000	
前田建設工業	114,300	769.00	87,896,700	
佐田建設	9,800	413.00	4,047,400	
ナカノフドー建設	12,500	375.00	4,687,500	
奥村組	21,500	2,563.00	55,104,500	
東鉄工業	19,600	2,604.00	51,038,400	
イチケン	3,300	1,539.00	5,078,700	
富士ピー・エス	6,700	599.00	4,013,300	
浅沼組	5,100	4,415.00	22,516,500	
戸田建設	189,600	689.00	130,634,400	
熊谷組	21,200	2,679.00	56,794,800	
北野建設	2,800	2,543.00	7,120,400	
植木組	2,000	2,571.00	5,142,000	
矢作建設工業	20,200	871.00	17,594,200	
ピーエス三菱	15,000	567.00	8,505,000	
日本ハウスホールディングス	31,200	262.00	8,174,400	
大東建託	49,800	9,280.00	462,144,000	
新日本建設	19,400	840.00	16,296,000	
N I P P O	37,800	2,686.00	101,530,800	
東亜道路工業	2,800	3,320.00	9,296,000	
前田道路	40,300	1,935.00	77,980,500	
日本道路	4,400	7,600.00	33,440,000	
東亜建設工業	14,200	1,567.00	22,251,400	
日本国土開発	44,400	576.00	25,574,400	
若築建設	8,200	1,159.00	9,503,800	
東洋建設	51,200	393.00	20,121,600	
五洋建設	181,000	663.00	120,003,000	

世紀東急工業	21,900	855.00	18,724,500
福田組	5,300	4,800.00	25,440,000
住友林業	115,600	1,701.00	196,635,600
日本基礎技術	15,300	409.00	6,257,700
巴コーポレーション	20,300	354.00	7,186,200
大和ハウス工業	451,700	2,796.50	1,263,179,050
ライト工業	26,100	1,582.00	41,290,200
積水ハウス	495,100	2,095.50	1,037,482,050
日特建設	11,900	791.00	9,412,900
北陸電気工事	7,900	997.00	7,876,300
ユアテック	26,100	625.00	16,312,500
日本リーテック	9,600	2,907.00	27,907,200
四電工	2,500	2,268.00	5,670,000
中電工	18,400	2,250.00	41,400,000
関電工	64,900	828.00	53,737,200
きんでん	108,400	1,727.00	187,206,800
東京エネシス	15,200	779.00	11,840,800
トーエネック	4,600	3,555.00	16,353,000
住友電設	12,900	2,197.00	28,341,300
日本電設工業	25,000	2,112.00	52,800,000
協和エクシオ	69,200	2,644.00	182,964,800
新日本空調	12,100	2,046.00	24,756,600
九電工	32,000	2,951.00	94,432,000
三機工業	32,900	1,137.00	37,407,300
日揮ホールディングス	140,500	1,146.00	161,013,000
中外炉工業	4,900	1,471.00	7,207,900
ヤマト	14,600	643.00	9,387,800
太平電業	11,000	2,210.00	24,310,000
高砂熱学工業	38,400	1,462.00	56,140,800
三晃金属工業	2,000	2,079.00	4,158,000
朝日工業社	3,100	2,851.00	8,838,100
明星工業	29,500	806.00	23,777,000
大気社	22,200	2,872.00	63,758,400
ダイダン	10,900	2,574.00	28,056,600
日比谷総合設備	14,700	1,788.00	26,283,600
フィル・カンパニー	2,600	1,801.00	4,682,600
OSJBホールディングス	72,000	226.00	16,272,000
東洋エンジニアリング	19,200	320.00	6,144,000
レイズネクスト	24,500	1,274.00	31,213,000
日本製粉	42,700	1,668.00	71,223,600
日清製粉グループ本社	165,100	1,750.00	288,925,000
日東富士製粉	1,100	6,090.00	6,699,000

昭和産業	13,400	3,445.00	46,163,000
鳥越製粉	12,900	928.00	11,971,200
中部飼料	17,800	1,581.00	28,141,800
フィード・ワン	98,100	180.00	17,658,000
東洋精糖	2,500	1,245.00	3,112,500
日本甜菜製糖	7,600	1,754.00	13,330,400
三井製糖	12,800	1,921.00	24,588,800
塩水港精糖	15,800	226.00	3,570,800
日新製糖	6,900	1,801.00	12,426,900
森永製菓	34,300	3,845.00	131,883,500
中村屋	3,800	4,030.00	15,314,000
江崎グリコ	40,200	4,520.00	181,704,000
名糖産業	7,000	1,477.00	10,339,000
井村屋グループ	8,300	2,251.00	18,683,300
不二家	9,300	2,142.00	19,920,600
山崎製パン	109,500	1,726.00	188,997,000
第一屋製パン	2,800	986.00	2,760,800
モロゾフ	2,500	5,270.00	13,175,000
亀田製菓	8,300	5,200.00	43,160,000
寿スピリッツ	14,100	4,650.00	65,565,000
カルビー	66,600	3,305.00	220,113,000
森永乳業	27,000	5,130.00	138,510,000
六甲バター	9,700	1,736.00	16,839,200
ヤクルト本社	100,500	6,000.00	603,000,000
明治ホールディングス	96,600	8,500.00	821,100,000
雪印メグミルク	35,200	2,406.00	84,691,200
プリマハム	22,800	3,105.00	70,794,000
日本ハム	55,800	4,855.00	270,909,000
林兼産業	4,800	560.00	2,688,000
丸大食品	15,600	1,819.00	28,376,400
S Foods	11,700	2,918.00	34,140,600
柿安本店	5,100	2,447.00	12,479,700
伊藤ハム米久ホールディングス	94,100	698.00	65,681,800
サッポロホールディングス	49,900	1,869.00	93,263,100
アサヒグループホールディングス	306,000	3,671.00	1,123,326,000
キリンホールディングス	619,600	2,045.50	1,267,391,800
宝ホールディングス	108,300	978.00	105,917,400
オエノンホールディングス	41,500	421.00	17,471,500
養命酒製造	4,500	1,736.00	7,812,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	111,900	1,700.00	190,230,000
サントリー食品インターナショナル	97,800	3,960.00	387,288,000
ダイドーグループホールディングス	7,500	5,010.00	37,575,000

伊藤園	44,400	6,260.00	277,944,000	
キーコーヒー	14,400	2,130.00	30,672,000	
ユニカフェ	4,400	962.00	4,232,800	
ジャパンフーズ	2,100	1,218.00	2,557,800	
日清オイリオグループ	18,800	3,125.00	58,750,000	
不二製油グループ本社	35,600	3,075.00	109,470,000	
かどや製油	1,600	3,625.00	5,800,000	
J - オイルミルズ	7,600	3,685.00	28,006,000	
キッコーマン	105,200	5,690.00	598,588,000	
味の素	322,700	1,980.00	638,946,000	
キューピー	81,400	1,993.00	162,230,200	
ハウス食品グループ本社	54,600	3,535.00	193,011,000	
カゴメ	59,700	3,265.00	194,920,500	
焼津水産化学工業	7,100	915.00	6,496,500	
アリアケジャパン	13,300	7,150.00	95,095,000	
ピエトロ	1,900	1,665.00	3,163,500	
エバラ食品工業	3,500	2,216.00	7,756,000	
やまみ	1,300	1,991.00	2,588,300	
ニチレイ	69,600	2,781.00	193,557,600	
東洋水産	75,200	6,070.00	456,464,000	
イトアンド	5,100	1,801.00	9,185,100	
大冷	1,900	2,205.00	4,189,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	930.00	7,533,000	
日清食品ホールディングス	62,100	10,620.00	659,502,000	
永谷園ホールディングス	7,100	2,225.00	15,797,500	
一正蒲鉾	5,700	1,001.00	5,705,700	
フジッコ	15,800	2,003.00	31,647,400	
ロック・フィールド	15,700	1,277.00	20,048,900	
日本たばこ産業	783,400	1,978.00	1,549,565,200	
ケンコーマヨネーズ	8,200	1,774.00	14,546,800	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	1,487.00	14,275,200	
なとり	8,200	1,900.00	15,580,000	
イフジ産業	2,500	857.00	2,142,500	
ピククルスコーポレーション	3,200	2,576.00	8,243,200	
北の達人コーポレーション	51,000	536.00	27,336,000	
ユーグレナ	63,000	759.00	47,817,000	
ミヨシ油脂	5,100	1,153.00	5,880,300	
理研ビタミン	13,800	2,163.00	29,849,400	
片倉工業	19,500	1,192.00	23,244,000	
ゲンゼ	10,600	3,795.00	40,227,000	
東洋紡	56,700	1,525.00	86,467,500	
ユニチカ	43,000	371.00	15,953,000	

富士紡ホールディングス	7,000	3,420.00	23,940,000
倉敷紡績	14,400	1,982.00	28,540,800
シキボウ	7,500	1,000.00	7,500,000
日本毛織	47,400	956.00	45,314,400
トーア紡コーポレーション	5,700	454.00	2,587,800
帝国繊維	16,200	2,795.00	45,279,000
帝人	116,600	1,660.00	193,556,000
東レ	1,033,200	505.00	521,766,000
サカイオーベックス	4,000	2,033.00	8,132,000
住江織物	3,100	1,782.00	5,524,200
日本フェルト	9,000	469.00	4,221,000
イチカワ	2,400	1,293.00	3,103,200
日東製網	1,600	1,392.00	2,227,200
アツギ	12,100	499.00	6,037,900
ダイニック	5,400	779.00	4,206,600
セーレン	35,400	1,406.00	49,772,400
ソトー	5,900	954.00	5,628,600
東海染工	2,100	1,131.00	2,375,100
小松マテーレ	23,700	783.00	18,557,100
ワコールホールディングス	35,700	1,868.00	66,687,600
ホギメディカル	16,300	3,360.00	54,768,000
T S Iホールディングス	43,900	328.00	14,399,200
マツオカコーポレーション	4,200	1,944.00	8,164,800
ワールド	20,300	1,588.00	32,236,400
三陽商会	7,400	604.00	4,469,600
ナイガイ	5,700	357.00	2,034,900
オンワードホールディングス	86,400	275.00	23,760,000
ルックホールディングス	5,100	822.00	4,192,200
ゴールドウイン	25,900	7,560.00	195,804,000
デサント	27,900	1,799.00	50,192,100
キング	7,100	551.00	3,912,100
ヤマトインターナショナル	13,100	375.00	4,912,500
特種東海製紙	9,100	4,570.00	41,587,000
王子ホールディングス	596,000	476.00	283,696,000
日本製紙	63,000	1,351.00	85,113,000
三菱製紙	16,200	340.00	5,508,000
北越コーポレーション	85,000	361.00	30,685,000
中越パルプ工業	6,000	1,489.00	8,934,000
巴川製紙所	4,200	790.00	3,318,000
大王製紙	62,900	1,453.00	91,393,700
阿波製紙	3,700	488.00	1,805,600
レンゴー	134,800	780.00	105,144,000

トーマック	8,700	1,634.00	14,215,800
ザ・パック	10,800	2,685.00	28,998,000
クラレ	224,500	1,084.00	243,358,000
旭化成	945,000	884.90	836,230,500
共和レザー	7,800	559.00	4,360,200
昭和電工	108,300	2,094.00	226,780,200
住友化学	1,047,400	346.00	362,400,400
住友精化	6,300	3,460.00	21,798,000
日産化学	79,200	5,530.00	437,976,000
ラサ工業	5,000	1,605.00	8,025,000
クレハ	12,200	4,525.00	55,205,000
多木化学	5,600	5,790.00	32,424,000
テイカ	10,500	1,306.00	13,713,000
石原産業	25,600	716.00	18,329,600
片倉コープアグリ	3,700	1,219.00	4,510,300
日本曹達	21,100	3,060.00	64,566,000
東ソー	220,400	1,568.00	345,587,200
トクヤマ	41,100	2,483.00	102,051,300
セントラル硝子	29,100	2,073.00	60,324,300
東亜合成	89,500	1,042.00	93,259,000
大阪ソーダ	14,500	2,512.00	36,424,000
関東電化工業	33,800	738.00	24,944,400
デンカ	52,000	2,951.00	153,452,000
信越化学工業	244,800	12,795.00	3,132,216,000
日本カーバイド工業	5,000	1,153.00	5,765,000
堺化学工業	9,200	2,009.00	18,482,800
第一稀元素化学工業	15,400	787.00	12,119,800
エア・ウォーター	132,600	1,459.00	193,463,400
大陽日酸	137,000	1,857.00	254,409,000
日本化学工業	4,400	2,184.00	9,609,600
東邦アセチレン	2,100	1,280.00	2,688,000
日本パーカラライジング	71,900	1,015.00	72,978,500
高压ガス工業	22,600	783.00	17,695,800
チタン工業	1,800	1,666.00	2,998,800
四国化成工業	20,800	1,075.00	22,360,000
戸田工業	3,300	2,538.00	8,375,400
ステラ ケミファ	7,800	2,595.00	20,241,000
保土谷化学工業	5,300	5,140.00	27,242,000
日本触媒	22,100	5,520.00	121,992,000
大日精化工業	12,600	2,158.00	27,190,800
カネカ	36,900	2,685.00	99,076,500
三菱瓦斯化学	132,600	1,914.00	253,796,400

三井化学	132,300	2,479.00	327,971,700
J S R	132,900	2,261.00	300,486,900
東京応化工業	24,500	4,990.00	122,255,000
大阪有機化学工業	13,200	2,450.00	32,340,000
三菱ケミカルホールディングス	953,100	618.90	589,873,590
K Hネオケム	23,500	2,236.00	52,546,000
ダイセル	185,600	754.00	139,942,400
住友ベークライト	22,400	2,710.00	60,704,000
積水化学工業	301,500	1,683.00	507,424,500
日本ゼオン	128,600	1,114.00	143,260,400
アイカ工業	42,800	3,630.00	155,364,000
宇部興産	72,000	1,889.00	136,008,000
積水樹脂	25,700	2,225.00	57,182,500
タキロンシーアイ	30,800	697.00	21,467,600
旭有機材	8,100	1,246.00	10,092,600
ニチバン	7,500	1,527.00	11,452,500
リケンテクノス	35,900	388.00	13,929,200
大倉工業	6,700	1,553.00	10,405,100
積水化成成品工業	19,100	557.00	10,638,700
群栄化学工業	3,300	2,393.00	7,896,900
タイガースポリマー	7,500	417.00	3,127,500
ミライアル	5,000	1,002.00	5,010,000
ダイキアクシス	5,000	840.00	4,200,000
ダイキョーニシカワ	30,100	577.00	17,367,700
竹本容器	5,100	919.00	4,686,900
森六ホールディングス	7,700	1,676.00	12,905,200
日本化薬	88,200	1,056.00	93,139,200
カーリットホールディングス	15,200	482.00	7,326,400
日本精化	11,500	1,518.00	17,457,000
扶桑化学工業	14,400	3,540.00	50,976,000
トリケミカル研究所	3,200	9,240.00	29,568,000
A D E K A	65,600	1,545.00	101,352,000
日油	53,700	4,300.00	230,910,000
新日本理化	23,600	159.00	3,752,400
ハリマ化成グループ	11,800	943.00	11,127,400
花王	348,500	8,008.00	2,790,788,000
第一工業製薬	5,300	4,285.00	22,710,500
石原ケミカル	3,900	2,010.00	7,839,000
日華化学	4,800	894.00	4,291,200
ニイタカ	3,000	3,005.00	9,015,000
三洋化成工業	8,500	4,870.00	41,395,000
有機合成薬品工業	10,900	334.00	3,640,600

大日本塗料	16,100	879.00	14,151,900
日本ペイントホールディングス	117,700	9,180.00	1,080,486,000
関西ペイント	160,200	2,495.00	399,699,000
神東塗料	11,200	165.00	1,848,000
中国塗料	40,600	994.00	40,356,400
日本特殊塗料	10,700	975.00	10,432,500
藤倉化成	19,200	513.00	9,849,600
太陽ホールディングス	10,500	5,280.00	55,440,000
D I C	60,200	2,499.00	150,439,800
サカタインクス	31,100	990.00	30,789,000
東洋インキＳＣホールディングス	30,100	1,882.00	56,648,200
T & K T O K A	11,000	765.00	8,415,000
富士フィルムホールディングス	279,100	5,012.00	1,398,849,200
資生堂	289,200	6,071.00	1,755,733,200
ライオン	189,300	2,236.00	423,274,800
高砂香料工業	9,100	1,950.00	17,745,000
マンダム	32,700	1,651.00	53,987,700
ミルボン	19,500	5,690.00	110,955,000
ファンケル	58,900	3,425.00	201,732,500
コーセー	27,400	12,090.00	331,266,000
コタ	8,400	1,202.00	10,096,800
シーボン	1,900	1,830.00	3,477,000
ポーラ・オルビスホールディングス	62,100	1,888.00	117,244,800
ノエビアホールディングス	12,300	4,740.00	58,302,000
アジュバンコスメジャパン	3,300	976.00	3,220,800
エステー	9,400	2,059.00	19,354,600
アグロ カネショウ	5,500	1,477.00	8,123,500
コニシ	23,900	1,475.00	35,252,500
長谷川香料	25,100	2,069.00	51,931,900
星光P M C	8,300	646.00	5,361,800
小林製薬	40,800	9,370.00	382,296,000
荒川化学工業	13,100	1,193.00	15,628,300
メック	10,000	1,831.00	18,310,000
日本高純度化学	4,000	2,607.00	10,428,000
タカラバイオ	38,100	2,823.00	107,556,300
J C U	17,600	3,545.00	62,392,000
新田ゼラチン	9,100	654.00	5,951,400
O A T アグリオ	2,800	1,110.00	3,108,000
デクセリアルズ	37,600	1,016.00	38,201,600
アース製薬	10,100	7,730.00	78,073,000
北興化学工業	13,600	662.00	9,003,200
大成ラミック	4,800	2,752.00	13,209,600

クミアイ化学工業	60,200	1,037.00	62,427,400
日本農薬	25,900	498.00	12,898,200
アキレス	10,000	1,780.00	17,800,000
有沢製作所	23,000	912.00	20,976,000
日東電工	100,500	6,400.00	643,200,000
レック	15,500	1,611.00	24,970,500
三光合成	16,600	258.00	4,282,800
きもと	24,800	154.00	3,819,200
藤森工業	13,100	3,895.00	51,024,500
前澤化成工業	9,200	1,000.00	9,200,000
未来工業	7,800	1,886.00	14,710,800
ウェーブロックホールディングス	5,000	761.00	3,805,000
JSP	8,500	1,559.00	13,251,500
エフピコ	16,000	8,090.00	129,440,000
天馬	9,700	1,936.00	18,779,200
信越ポリマー	26,100	861.00	22,472,100
東リ	36,200	251.00	9,086,200
ニフコ	53,400	2,682.00	143,218,800
バルカー	11,800	1,792.00	21,145,600
ユニ・チャーム	308,600	4,609.00	1,422,337,400
ショーエイコーポレーション	2,200	1,216.00	2,675,200
協和キリン	146,400	2,651.00	388,106,400
武田薬品工業	1,211,200	3,974.00	4,813,308,800
アステラス製薬	1,262,100	1,652.50	2,085,620,250
大日本住友製薬	107,900	1,339.00	144,478,100
塩野義製薬	183,100	5,886.00	1,077,726,600
わかもと製薬	17,300	255.00	4,411,500
あすか製薬	16,600	1,176.00	19,521,600
日本新薬	38,100	8,660.00	329,946,000
バイオフェルミン製薬	2,500	2,427.00	6,067,500
中外製薬	455,300	4,673.00	2,127,616,900
科研製薬	24,900	4,890.00	121,761,000
エーザイ	174,200	9,140.00	1,592,188,000
ロート製薬	74,700	3,375.00	252,112,500
小野薬品工業	334,300	3,188.00	1,065,748,400
久光製薬	38,500	4,955.00	190,767,500
持田製薬	20,200	3,970.00	80,194,000
参天製薬	271,300	2,043.00	554,265,900
扶桑薬品工業	5,100	2,550.00	13,005,000
日本ケミファ	1,900	2,450.00	4,655,000
ツムラ	45,100	2,989.00	134,803,900
日医工	41,200	1,179.00	48,574,800

キッセイ薬品工業	25,800	2,306.00	59,494,800
生化学工業	28,200	1,069.00	30,145,800
栄研化学	25,600	1,879.00	48,102,400
日水製薬	6,100	1,108.00	6,758,800
鳥居薬品	9,100	2,781.00	25,307,100
JCRファーマ	10,300	11,270.00	116,081,000
東和薬品	18,600	2,123.00	39,487,800
富士製薬工業	9,900	1,084.00	10,731,600
沢井製薬	29,900	5,390.00	161,161,000
ゼリア新薬工業	26,400	1,952.00	51,532,800
第一三共	416,600	9,379.00	3,907,291,400
キョーリン製薬ホールディングス	32,100	1,979.00	63,525,900
大幸薬品	17,800	2,556.00	45,496,800
ダイト	9,000	3,355.00	30,195,000
大塚ホールディングス	302,500	4,620.00	1,397,550,000
大正製薬ホールディングス	30,800	6,490.00	199,892,000
ペプチドリーム	74,000	4,165.00	308,210,000
日本コークス工業	123,000	62.00	7,626,000
ニチレキ	17,200	1,615.00	27,778,000
ユシロ化学工業	8,200	1,283.00	10,520,600
ビーピー・カストロール	5,200	1,134.00	5,896,800
富士石油	38,900	180.00	7,002,000
MORESCO	5,300	959.00	5,082,700
出光興産	161,500	2,311.00	373,226,500
ENEOSホールディングス	2,189,900	413.00	904,428,700
コスモエネルギーホールディングス	42,100	1,647.00	69,338,700
横浜ゴム	84,300	1,650.00	139,095,000
TOYO TIRE	76,600	1,729.00	132,441,400
ブリヂストン	387,100	3,338.00	1,292,139,800
住友ゴム工業	130,800	1,003.00	131,192,400
藤倉コンポジット	12,700	352.00	4,470,400
オカモト	8,900	4,305.00	38,314,500
フコク	6,400	639.00	4,089,600
ニッタ	16,400	2,309.00	37,867,600
住友理工	28,200	555.00	15,651,000
三ツ星ベルト	19,200	1,660.00	31,872,000
バンドー化学	25,600	570.00	14,592,000
日東紡績	21,700	4,125.00	89,512,500
AGC	133,700	3,020.00	403,774,000
日本板硝子	69,600	418.00	29,092,800
石塚硝子	2,700	1,835.00	4,954,500
日本山村硝子	6,100	843.00	5,142,300

日本電気硝子	54,000	1,957.00	105,678,000
オハラ	5,800	1,002.00	5,811,600
住友大阪セメント	27,600	3,445.00	95,082,000
太平洋セメント	92,000	2,643.00	243,156,000
日本ヒューム	14,700	762.00	11,201,400
日本コンクリート工業	31,600	276.00	8,721,600
三谷セキサン	6,800	5,720.00	38,896,000
アジアパイルホールディングス	20,800	468.00	9,734,400
東海カーボン	142,400	973.00	138,555,200
日本カーボン	8,000	3,435.00	27,480,000
東洋炭素	8,600	1,667.00	14,336,200
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	3,320.00	26,892,000
TOTO	104,000	4,590.00	477,360,000
日本碍子	174,800	1,508.00	263,598,400
日本特殊陶業	110,800	1,808.00	200,326,400
MARUWA	5,600	8,800.00	49,280,000
品川リフラクトリーズ	3,900	2,197.00	8,568,300
黒崎播磨	2,900	3,005.00	8,714,500
ヨータイ	11,700	691.00	8,084,700
イソライト工業	7,600	418.00	3,176,800
東京窯業	18,700	307.00	5,740,900
ニッカトー	6,700	637.00	4,267,900
フジインコーポレーテッド	13,000	3,535.00	45,955,000
クニミネ工業	6,000	945.00	5,670,000
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,026.00	2,565,000
ニチアス	39,900	2,505.00	99,949,500
ニチハ	20,300	2,509.00	50,932,700
日本製鉄	644,300	1,036.50	667,816,950
神戸製鋼所	263,600	401.00	105,703,600
中山製鋼所	20,100	350.00	7,035,000
合同製鐵	7,800	1,893.00	14,765,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	388,900	794.00	308,786,600
東京製鐵	70,200	700.00	49,140,000
共英製鋼	16,300	1,347.00	21,956,100
大和工業	30,600	2,539.00	77,693,400
東京鐵鋼	6,000	1,553.00	9,318,000
大阪製鐵	7,700	1,070.00	8,239,000
淀川製鋼所	19,500	1,884.00	36,738,000
丸一鋼管	46,800	2,884.00	134,971,200
モリ工業	4,300	2,174.00	9,348,200
大同特殊鋼	23,600	3,500.00	82,600,000
日本高周波鋼業	5,500	338.00	1,859,000

日本冶金工業	11,900	1,519.00	18,076,100
山陽特殊製鋼	9,900	920.00	9,108,000
愛知製鋼	8,100	2,637.00	21,359,700
日立金属	155,100	1,597.00	247,694,700
日本金属	3,300	541.00	1,785,300
大太平洋金属	9,800	1,754.00	17,189,200
新日本電工	93,200	192.00	17,894,400
栗本鐵工所	7,100	1,858.00	13,191,800
虹技	2,200	1,275.00	2,805,000
三菱製鋼	10,800	549.00	5,929,200
日亜鋼業	21,300	279.00	5,942,700
日本精線	2,400	3,315.00	7,956,000
エンビプロ・ホールディングス	6,200	519.00	3,217,800
シンニッタン	22,700	213.00	4,835,100
新家工業	3,300	1,018.00	3,359,400
大紀アルミニウム工業所	23,900	500.00	11,950,000
日本軽金属ホールディングス	364,900	193.00	70,425,700
三井金属鉱業	38,900	2,523.00	98,144,700
東邦亜鉛	7,400	1,855.00	13,727,000
三菱マテリアル	95,100	2,229.00	211,977,900
住友金属鉱山	184,000	3,167.00	582,728,000
D O W Aホールディングス	36,500	3,285.00	119,902,500
古河機械金属	25,700	1,051.00	27,010,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	916.00	13,831,600
東邦チタニウム	26,000	679.00	17,654,000
U A C J	21,900	1,953.00	42,770,700
C Kサンエツ	3,000	3,285.00	9,855,000
古河電気工業	44,800	2,504.00	112,179,200
住友電気工業	538,300	1,246.50	670,990,950
フジクラ	173,800	307.00	53,356,600
昭和電線ホールディングス	16,800	1,075.00	18,060,000
東京特殊電線	2,200	2,293.00	5,044,600
タツタ電線	28,800	599.00	17,251,200
カナレ電気	2,500	1,626.00	4,065,000
平河ヒューテック	7,300	900.00	6,570,000
リョービ	17,800	1,171.00	20,843,800
アーレスティ	19,300	325.00	6,272,500
アサヒホールディングス	25,300	3,485.00	88,170,500
稲葉製作所	8,100	1,281.00	10,376,100
宮地エンジニアリンググループ	4,400	1,597.00	7,026,800
トーカロ	40,000	1,050.00	42,000,000
アルファC o	5,100	922.00	4,702,200

SUMCO	184,200	1,435.00	264,327,000
川田テクノロジーズ	2,900	4,785.00	13,876,500
RS Technologies	4,700	3,135.00	14,734,500
信和	8,300	683.00	5,668,900
東洋製罐グループホールディングス	91,700	1,175.00	107,747,500
ホッカンホールディングス	7,900	1,421.00	11,225,900
コロナ	8,000	1,000.00	8,000,000
横河ブリッジホールディングス	26,800	1,880.00	50,384,000
駒井ハルテック	2,700	1,370.00	3,699,000
高田機工	1,300	2,359.00	3,066,700
三和ホールディングス	135,700	1,046.00	141,942,200
文化シャッター	42,400	740.00	31,376,000
三協立山	18,500	919.00	17,001,500
アルインコ	10,500	924.00	9,702,000
東洋シャッター	3,500	724.00	2,534,000
LIXILグループ	212,400	1,897.00	402,922,800
日本フィルコン	10,000	550.00	5,500,000
ノーリツ	29,800	1,360.00	40,528,000
長府製作所	14,600	2,087.00	30,470,200
リンナイ	28,000	9,670.00	270,760,000
ダイニチ工業	7,800	669.00	5,218,200
日東精工	18,100	465.00	8,416,500
三洋工業	1,900	1,919.00	3,646,100
岡部	29,200	777.00	22,688,400
ジーテクト	17,900	1,058.00	18,938,200
東プレ	26,900	1,152.00	30,988,800
高周波熱錬	27,700	499.00	13,822,300
東京製綱	10,300	521.00	5,366,300
サンコール	10,800	402.00	4,341,600
モリテック スチール	11,200	300.00	3,360,000
パイオラックス	21,300	1,635.00	34,825,500
エイチワン	14,100	528.00	7,444,800
日本発條	154,400	663.00	102,367,200
中央発條	1,700	2,595.00	4,411,500
アドバネクス	2,100	1,377.00	2,891,700
立川ブラインド工業	6,300	1,209.00	7,616,700
三益半導体工業	11,200	2,102.00	23,542,400
日本ドライケミカル	3,600	1,484.00	5,342,400
日本製鋼所	43,800	1,537.00	67,320,600
三浦工業	62,300	4,390.00	273,497,000
タクマ	48,900	1,681.00	82,200,900
ツガミ	30,000	1,101.00	33,030,000

オークマ	16,800	4,830.00	81,144,000
芝浦機械	16,300	2,109.00	34,376,700
アマダ	178,700	929.00	166,012,300
アイダエンジニアリング	37,900	679.00	25,734,100
滝澤鉄工所	4,500	1,010.00	4,545,000
F U J I	61,900	1,881.00	116,433,900
牧野フライス製作所	16,900	3,595.00	60,755,500
オーエスジー	71,100	1,546.00	109,920,600
ダイジェット工業	1,700	1,399.00	2,378,300
旭ダイヤモンド工業	38,100	486.00	18,516,600
D M G 森精機	91,200	1,339.00	122,116,800
ソディック	31,400	745.00	23,393,000
ディスコ	19,500	24,600.00	479,700,000
日東工器	7,900	2,034.00	16,068,600
日進工具	5,700	2,314.00	13,189,800
パンチ工業	13,200	400.00	5,280,000
富士ダイス	6,400	661.00	4,230,400
豊和工業	8,100	822.00	6,658,200
O K K	5,900	352.00	2,076,800
東洋機械金属	10,400	402.00	4,180,800
津田駒工業	2,800	770.00	2,156,000
エンシュウ	3,600	903.00	3,250,800
島精機製作所	22,800	1,469.00	33,493,200
オプトラン	18,100	2,076.00	37,575,600
N C ホールディングス	4,500	590.00	2,655,000
イワキポンプ	9,200	930.00	8,556,000
フリュー	14,100	1,010.00	14,241,000
ヤマシンフィルタ	31,300	1,191.00	37,278,300
日阪製作所	17,800	822.00	14,631,600
やまびこ	28,000	1,061.00	29,708,000
平田機工	6,800	6,010.00	40,868,000
ペガサスミシン製造	14,800	277.00	4,099,600
マルマエ	5,400	866.00	4,676,400
タツモ	6,100	1,327.00	8,094,700
ナプテスコ	84,900	3,280.00	278,472,000
三井海洋開発	15,300	1,788.00	27,356,400
レオン自動機	14,200	1,104.00	15,676,800
S M C	45,700	58,720.00	2,683,504,000
ホソカワミクロン	5,100	5,550.00	28,305,000
ユニオンツール	5,400	2,827.00	15,265,800
オイレス工業	18,600	1,391.00	25,872,600
日精エー・エス・ビー機械	4,200	3,920.00	16,464,000

サトーホールディングス	20,500	1,998.00	40,959,000
技研製作所	12,700	3,785.00	48,069,500
日本エアータック	4,700	1,229.00	5,776,300
カワタ	4,300	797.00	3,427,100
日精樹脂工業	12,300	849.00	10,442,700
オカダアイヨン	4,600	946.00	4,351,600
ワイエイシーホールディングス	6,200	634.00	3,930,800
小松製作所	659,400	2,304.50	1,519,587,300
住友重機械工業	83,400	2,450.00	204,330,000
日立建機	58,400	3,665.00	214,036,000
日工	20,100	641.00	12,884,100
巴工業	5,700	1,871.00	10,664,700
井関農機	14,700	1,153.00	16,949,100
TOWA	14,800	1,056.00	15,628,800
丸山製作所	3,100	1,278.00	3,961,800
北川鉄工所	6,700	1,387.00	9,292,900
ローツェ	6,400	4,775.00	30,560,000
タカキタ	5,200	601.00	3,125,200
クボタ	772,400	1,878.00	1,450,567,200
荏原実業	3,700	2,860.00	10,582,000
三菱化工機	5,100	1,740.00	8,874,000
月島機械	26,900	1,243.00	33,436,700
帝国電機製作所	12,000	1,133.00	13,596,000
新東工業	34,800	708.00	24,638,400
澁谷工業	12,800	2,918.00	37,350,400
アイチ コーポレーション	25,300	802.00	20,290,600
小森コーポレーション	37,100	720.00	26,712,000
鶴見製作所	11,300	1,846.00	20,859,800
住友精密工業	2,200	2,239.00	4,925,800
日本ギア工業	6,000	277.00	1,662,000
酒井重工業	2,800	2,309.00	6,465,200
荏原製作所	60,400	2,688.00	162,355,200
石井鐵工所	1,900	2,600.00	4,940,000
西島製作所	14,900	802.00	11,949,800
北越工業	15,100	1,046.00	15,794,600
ダイキン工業	185,500	19,765.00	3,666,407,500
オルガノ	5,300	5,430.00	28,779,000
トーヨーカネツ	6,400	2,243.00	14,355,200
栗田工業	78,800	3,305.00	260,434,000
椿本チエイン	20,800	2,494.00	51,875,200
大同工業	7,200	568.00	4,089,600
木村化工機	12,500	412.00	5,150,000

アネスト岩田	22,700	803.00	18,228,100	
ダイフク	74,400	9,330.00	694,152,000	
サムコ	3,700	2,614.00	9,671,800	
加藤製作所	8,100	1,049.00	8,496,900	
油研工業	2,600	1,448.00	3,764,800	
タダノ	70,400	864.00	60,825,600	
フジテック	52,900	2,170.00	114,793,000	
C K D	39,900	1,454.00	58,014,600	
キトー	11,100	1,099.00	12,198,900	
平和	40,600	1,770.00	71,862,000	
理想科学工業	12,900	1,317.00	16,989,300	
S A N K Y O	32,400	2,915.00	94,446,000	
日本金銭機械	16,200	549.00	8,893,800	
マースグループホールディングス	9,300	1,652.00	15,363,600	
フクシマガリレイ	9,000	3,340.00	30,060,000	
オーイズミ	6,300	358.00	2,255,400	
ダイコク電機	6,700	1,033.00	6,921,100	
竹内製作所	24,400	2,169.00	52,923,600	
アマノ	38,100	2,191.00	83,477,100	
J U K I	20,300	451.00	9,155,300	
蛇の目ミシン工業	13,300	625.00	8,312,500	
マックス	22,200	1,558.00	34,587,600	
グローリー	37,400	2,205.00	82,467,000	
新晃工業	13,600	1,366.00	18,577,600	
大和冷機工業	23,400	907.00	21,223,800	
セガサミーホールディングス	144,400	1,217.00	175,734,800	
日本ピストンリング	5,400	1,035.00	5,589,000	
リケン	6,800	2,595.00	17,646,000	
T P R	19,600	1,375.00	26,950,000	
ツバキ・ナカシマ	27,900	837.00	23,352,300	
ホシザキ	45,800	8,100.00	370,980,000	
大豊工業	12,000	514.00	6,168,000	
日本精工	274,100	805.00	220,650,500	
N T N	336,900	202.00	68,053,800	
ジェイテクト	139,700	819.00	114,414,300	
不二越	13,500	3,285.00	44,347,500	
日本トムソン	43,400	358.00	15,537,200	
T H K	90,800	2,485.00	225,638,000	
ユーシン精機	11,400	687.00	7,831,800	
前澤給装工業	5,300	2,005.00	10,626,500	
イーグル工業	18,100	735.00	13,303,500	
前澤工業	9,800	437.00	4,282,600	

日本ピラー工業	14,800	1,395.00	20,646,000
キット	59,100	610.00	36,051,000
マキタ	189,800	4,850.00	920,530,000
日立造船	115,800	412.00	47,709,600
三菱重工業	244,000	2,625.00	640,500,000
I H I	105,000	1,551.00	162,855,000
スター精密	22,500	1,315.00	29,587,500
日清紡ホールディングス	89,200	728.00	64,937,600
イビデン	89,300	3,380.00	301,834,000
コニカミノルタ	319,900	338.00	108,126,200
ブラザー工業	178,100	1,720.00	306,332,000
ミネベアミツミ	270,600	1,825.00	493,845,000
日立製作所	699,500	3,530.00	2,469,235,000
三菱電機	1,455,700	1,464.00	2,131,144,800
富士電機	87,800	3,275.00	287,545,000
東洋電機製造	5,400	1,059.00	5,718,600
安川電機	156,700	3,775.00	591,542,500
シンフォニアテクノロジー	19,000	1,049.00	19,931,000
明電舎	26,800	1,595.00	42,746,000
オリジン	4,000	1,238.00	4,952,000
山洋電気	7,200	4,675.00	33,660,000
デンヨー	12,500	2,108.00	26,350,000
東芝テック	18,300	4,380.00	80,154,000
芝浦メカトロニクス	2,800	2,894.00	8,103,200
マブチモーター	40,400	3,720.00	150,288,000
日本電産	350,400	8,767.00	3,071,956,800
トレックス・セミコンダクター	8,900	1,079.00	9,603,100
東光高岳	8,700	1,012.00	8,804,400
ダイヘン	16,000	4,095.00	65,520,000
ヤーマン	24,200	1,307.00	31,629,400
JVCケンウッド	122,500	154.00	18,865,000
ミマキエンジニアリング	14,600	383.00	5,591,800
I - P E X	7,100	1,985.00	14,093,500
日新電機	34,200	1,094.00	37,414,800
大崎電気工業	29,200	540.00	15,768,000
オムロン	130,500	7,700.00	1,004,850,000
日東工業	21,400	1,868.00	39,975,200
I D E C	21,100	1,749.00	36,903,900
正興電機製作所	4,000	983.00	3,932,000
不二電機工業	2,900	1,283.00	3,720,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	49,000	1,749.00	85,701,000
サクサホールディングス	3,500	1,370.00	4,795,000

メルコホールディングス	5,300	2,552.00	13,525,600
テクノメディカ	3,600	1,775.00	6,390,000
日本電気	176,600	5,490.00	969,534,000
富士通	140,300	13,710.00	1,923,513,000
沖電気工業	59,300	1,012.00	60,011,600
岩崎通信機	6,400	838.00	5,363,200
電気興業	7,100	2,331.00	16,550,100
サンケン電気	15,900	2,157.00	34,296,300
ナカヨ	2,900	1,358.00	3,938,200
アイホン	8,300	1,367.00	11,346,100
ルネサスエレクトロニクス	622,500	660.00	410,850,000
セイコーエプソン	180,700	1,243.00	224,610,100
ワコム	98,700	685.00	67,609,500
アルバック	26,800	3,725.00	99,830,000
アクセル	6,800	861.00	5,854,800
E I Z O	11,300	3,960.00	44,748,000
日本信号	37,200	1,006.00	37,423,200
京三製作所	34,400	487.00	16,752,800
能美防災	19,500	2,232.00	43,524,000
ホーチキ	11,000	1,177.00	12,947,000
星和電機	8,300	531.00	4,407,300
エレコム	16,500	4,785.00	78,952,500
パナソニック	1,663,200	970.30	1,613,802,960
シャープ	168,500	1,299.00	218,881,500
アンリツ	93,800	2,313.00	216,959,400
富士通ゼネラル	39,600	2,820.00	111,672,000
ソニー	911,900	8,280.00	7,550,532,000
T D K	70,300	11,030.00	775,409,000
帝国通信工業	6,900	1,169.00	8,066,100
タムラ製作所	48,900	502.00	24,547,800
アルプスアルパイン	129,200	1,675.00	216,410,000
池上通信機	4,600	783.00	3,601,800
鈴木	8,000	666.00	5,328,000
日本トリム	2,100	3,560.00	7,476,000
ローランド ディー . ジー .	9,100	1,246.00	11,338,600
フォスター電機	15,400	1,138.00	17,525,200
S M K	3,800	2,479.00	9,420,200
ヨコオ	9,600	2,564.00	24,614,400
ホシデン	40,400	921.00	37,208,400
ヒロセ電機	22,400	12,040.00	269,696,000
日本航空電子工業	33,500	1,379.00	46,196,500
T O A	15,800	753.00	11,897,400

マクセルホールディングス	31,900	1,016.00	32,410,400
古野電気	19,400	929.00	18,022,600
ユニデンホールディングス	4,100	1,540.00	6,314,000
スマダコーポレーション	13,400	641.00	8,589,400
アイコム	8,100	2,664.00	21,578,400
リオン	6,400	2,183.00	13,971,200
本多通信工業	13,900	430.00	5,977,000
横河電機	133,600	1,696.00	226,585,600
新電元工業	5,200	1,857.00	9,656,400
アズビル	91,900	3,350.00	307,865,000
東亜ディーケーケー	7,900	850.00	6,715,000
日本光電工業	60,300	3,620.00	218,286,000
チノー	5,100	1,353.00	6,900,300
共和電業	15,500	423.00	6,556,500
日本電子材料	5,800	1,853.00	10,747,400
堀場製作所	28,900	5,790.00	167,331,000
アドバンテスト	108,300	4,925.00	533,377,500
小野測器	7,300	499.00	3,642,700
エスペック	13,200	1,762.00	23,258,400
キーエンス	131,900	43,080.00	5,682,252,000
日置電機	7,200	3,375.00	24,300,000
シスメックス	104,100	9,235.00	961,363,500
日本マイクロニクス	25,900	1,064.00	27,557,600
メガチップス	13,800	2,094.00	28,897,200
O B A R A G R O U P	8,700	3,545.00	30,841,500
澤藤電機	2,100	1,565.00	3,286,500
原田工業	7,600	855.00	6,498,000
コーセル	20,100	859.00	17,265,900
イリソ電子工業	12,400	3,820.00	47,368,000
オブテックスグループ	24,300	1,328.00	32,270,400
千代田インテグレ	6,500	1,530.00	9,945,000
アイ・オー・データ機器	5,300	1,025.00	5,432,500
レーザーテック	64,000	7,850.00	502,400,000
スタンレー電気	102,300	3,030.00	309,969,000
岩崎電気	6,100	1,389.00	8,472,900
ウシオ電機	80,800	1,312.00	106,009,600
岡谷電機産業	13,400	300.00	4,020,000
ヘリオス テクノ ホールディング	15,500	291.00	4,510,500
エノモト	5,000	972.00	4,860,000
日本セラミック	15,000	2,480.00	37,200,000
遠藤照明	8,300	616.00	5,112,800
古河電池	10,900	1,107.00	12,066,300

双信電機	8,600	380.00	3,268,000
山一電機	11,000	1,316.00	14,476,000
図研	9,700	2,548.00	24,715,600
日本電子	28,900	3,095.00	89,445,500
カシオ計算機	128,900	1,670.00	215,263,000
ファナック	136,900	18,590.00	2,544,971,000
日本シイエムケイ	35,600	446.00	15,877,600
エンプラス	7,700	2,131.00	16,408,700
大真空	5,700	1,668.00	9,507,600
ローム	60,600	6,770.00	410,262,000
浜松ホトニクス	104,500	4,800.00	501,600,000
三井ハイテック	16,400	1,590.00	26,076,000
新光電気工業	49,200	1,578.00	77,637,600
京セラ	204,900	6,077.00	1,245,177,300
太陽誘電	64,900	2,861.00	185,678,900
村田製作所	427,700	6,284.00	2,687,666,800
双葉電子工業	23,700	870.00	20,619,000
北陸電気工業	6,600	854.00	5,636,400
ニチコン	50,100	765.00	38,326,500
日本ケミコン	11,100	1,691.00	18,770,100
K O A	22,600	1,087.00	24,566,200
市光工業	23,100	493.00	11,388,300
小糸製作所	87,300	5,040.00	439,992,000
ミツバ	26,800	378.00	10,130,400
S C R E E Nホールディングス	25,300	5,030.00	127,259,000
キャノン電子	13,800	1,468.00	20,258,400
キャノン	723,400	1,821.50	1,317,673,100
リコー	370,500	770.00	285,285,000
象印マホービン	39,800	1,576.00	62,724,800
M U T O Hホールディングス	2,200	1,500.00	3,300,000
東京エレクトロン	92,400	27,155.00	2,509,122,000
トヨタ紡織	42,500	1,480.00	62,900,000
芦森工業	3,100	893.00	2,768,300
ユニプレス	28,300	899.00	25,441,700
豊田自動織機	117,800	6,210.00	731,538,000
モリタホールディングス	25,500	2,001.00	51,025,500
三櫻工業	18,600	636.00	11,829,600
デンソー	320,500	4,373.00	1,401,546,500
東海理化電機製作所	38,400	1,590.00	61,056,000
三井E & Sホールディングス	52,600	417.00	21,934,200
川崎重工業	113,300	1,484.00	168,137,200
名村造船所	46,800	153.00	7,160,400

日本車輛製造	5,300	2,523.00	13,371,900
三菱ロジスネクスト	19,300	1,006.00	19,415,800
近畿車輛	2,200	1,237.00	2,721,400
日産自動車	1,716,800	433.00	743,374,400
いすゞ自動車	421,800	1,018.00	429,392,400
トヨタ自動車	1,624,200	7,056.00	11,460,355,200
日野自動車	181,800	696.00	126,532,800
三菱自動車工業	538,800	249.00	134,161,200
エフテック	10,300	472.00	4,861,600
レシップホールディングス	5,700	554.00	3,157,800
G M B	2,700	617.00	1,665,900
ファルテック	2,700	600.00	1,620,000
武蔵精密工業	32,500	1,040.00	33,800,000
日産車体	28,400	919.00	26,099,600
新明和工業	39,200	918.00	35,985,600
極東開発工業	27,000	1,303.00	35,181,000
日信工業	29,600	2,235.00	66,156,000
トピー工業	12,000	1,138.00	13,656,000
ティラド	5,300	1,285.00	6,810,500
曙ブレーキ工業	79,900	175.00	13,982,500
タチエス	24,000	860.00	20,640,000
N O K	78,300	1,125.00	88,087,500
フタバ産業	40,600	540.00	21,924,000
K Y B	16,300	2,105.00	34,311,500
大同メタル工業	28,100	512.00	14,387,200
プレス工業	72,400	302.00	21,864,800
ミクニ	18,700	265.00	4,955,500
太平洋工業	30,600	966.00	29,559,600
ケーヒン	33,500	2,577.00	86,329,500
河西工業	19,800	402.00	7,959,600
アイシン精機	119,900	3,575.00	428,642,500
マツダ	428,300	670.00	286,961,000
今仙電機製作所	13,600	646.00	8,785,600
本田技研工業	1,146,100	2,711.50	3,107,650,150
スズキ	288,500	4,293.00	1,238,530,500
S U B A R U	451,900	2,191.50	990,338,850
安永	7,100	998.00	7,085,800
ヤマハ発動機	205,700	1,657.00	340,844,900
ショーワ	34,400	2,278.00	78,363,200
T B K	17,500	420.00	7,350,000
エクセディ	19,800	1,426.00	28,234,800
豊田合成	47,000	2,310.00	108,570,000

愛三工業	22,900	475.00	10,877,500
盟和産業	2,300	904.00	2,079,200
日本プラスト	11,600	409.00	4,744,400
ヨロズ	13,700	949.00	13,001,300
エフ・シー・シー	23,800	1,948.00	46,362,400
シマノ	54,500	22,270.00	1,213,715,000
テイ・エス テック	33,800	3,115.00	105,287,000
ジャムコ	7,400	723.00	5,350,200
テルモ	411,900	4,236.00	1,744,808,400
クリエートメディック	4,800	990.00	4,752,000
日機装	47,000	1,057.00	49,679,000
日本エム・ディ・エム	8,400	1,870.00	15,708,000
島津製作所	174,000	3,170.00	551,580,000
JMS	12,300	873.00	10,737,900
長野計器	10,600	859.00	9,105,400
ブイ・テクノロジー	6,800	3,850.00	26,180,000
東京計器	9,300	915.00	8,509,500
愛知時計電機	1,900	4,520.00	8,588,000
インターアクション	7,800	1,684.00	13,135,200
オーバル	13,200	217.00	2,864,400
東京精密	26,400	3,190.00	84,216,000
マニー	58,000	2,621.00	152,018,000
ニコン	222,300	816.00	181,396,800
トプコン	73,400	850.00	62,390,000
オリンパス	805,500	2,082.00	1,677,051,000
理研計器	12,800	2,562.00	32,793,600
タムロン	11,800	1,750.00	20,650,000
HOYA	288,800	10,325.00	2,981,860,000
シード	6,200	697.00	4,321,400
ノーリツ鋼機	9,800	1,546.00	15,150,800
エー・アンド・デイ	13,300	638.00	8,485,400
朝日インテック	164,900	3,045.00	502,120,500
シチズン時計	170,600	323.00	55,103,800
リズム時計工業	4,600	622.00	2,861,200
大研医器	10,100	553.00	5,585,300
メニコン	20,600	6,290.00	129,574,000
シンシア	1,700	387.00	657,900
松風	6,600	1,396.00	9,213,600
セイコーホールディングス	20,600	1,493.00	30,755,800
ニプロ	100,800	1,195.00	120,456,000
中本パックス	3,700	1,520.00	5,624,000
スノーピーク	8,600	1,498.00	12,882,800

パラマウントベッドホールディングス	15,400	4,250.00	65,450,000
トランザクション	8,000	1,085.00	8,680,000
粧美堂	4,200	378.00	1,587,600
ニホンフラッシュ	13,600	1,374.00	18,686,400
前田工織	16,000	2,524.00	40,384,000
永大産業	19,000	293.00	5,567,000
アートネイチャー	15,500	607.00	9,408,500
バンダイナムコホールディングス	150,500	6,474.00	974,337,000
アイフィスジャパン	3,700	753.00	2,786,100
共立印刷	24,300	131.00	3,183,300
S H O E I	12,700	3,180.00	40,386,000
フランスベッドホールディングス	20,600	857.00	17,654,200
パイロットコーポレーション	25,700	3,075.00	79,027,500
萩原工業	8,100	1,433.00	11,607,300
トッパン・フォームズ	31,200	961.00	29,983,200
フジシールインターナショナル	32,600	1,922.00	62,657,200
タカラトミー	65,300	861.00	56,223,300
廣済堂	10,100	759.00	7,665,900
エステールホールディングス	3,900	624.00	2,433,600
タカノ	5,700	624.00	3,556,800
プロネクサス	12,500	1,120.00	14,000,000
ホクシン	9,000	114.00	1,026,000
ウッドワン	4,900	1,214.00	5,948,600
大建工業	9,800	1,618.00	15,856,400
凸版印刷	205,500	1,674.00	344,007,000
大日本印刷	190,500	2,244.00	427,482,000
共同印刷	4,500	2,626.00	11,817,000
N I S S H A	29,900	1,149.00	34,355,100
光村印刷	1,300	1,497.00	1,946,100
T A K A R A & C O M P A N Y	7,000	2,290.00	16,030,000
アシックス	128,700	1,411.00	181,595,700
ツツミ	4,500	1,862.00	8,379,000
小松ウオール工業	4,400	1,709.00	7,519,600
ヤマハ	86,600	5,040.00	436,464,000
河合楽器製作所	4,500	2,584.00	11,628,000
クリナップ	13,500	509.00	6,871,500
ピジョン	93,500	4,780.00	446,930,000
オリバー	3,100	2,464.00	7,638,400
兼松サステック	900	1,380.00	1,242,000
キングジム	12,100	886.00	10,720,600
リンテック	34,600	2,487.00	86,050,200
イトーキ	28,900	357.00	10,317,300

任天堂	89,300	56,390.00	5,035,627,000
三菱鉛筆	24,000	1,326.00	31,824,000
タカラスタANDARD	30,100	1,337.00	40,243,700
コクヨ	69,800	1,188.00	82,922,400
ナカバヤシ	14,300	614.00	8,780,200
グローブライド	6,500	3,185.00	20,702,500
オカムラ	50,800	730.00	37,084,000
美津濃	13,200	1,905.00	25,146,000
東京電力ホールディングス	1,162,100	311.00	361,413,100
中部電力	445,400	1,307.00	582,137,800
関西電力	551,500	1,033.00	569,699,500
中国電力	210,000	1,294.00	271,740,000
北陸電力	133,100	779.00	103,684,900
東北電力	363,600	1,076.00	391,233,600
四国電力	131,100	786.00	103,044,600
九州電力	300,000	935.00	280,500,000
北海道電力	136,200	447.00	60,881,400
沖縄電力	28,300	1,654.00	46,808,200
電源開発	115,800	1,581.00	183,079,800
エフオン	7,800	638.00	4,976,400
イーレックス	20,800	1,231.00	25,604,800
レノバ	24,300	1,109.00	26,948,700
東京瓦斯	279,900	2,316.00	648,248,400
大阪瓦斯	282,500	2,040.00	576,300,000
東邦瓦斯	71,600	4,610.00	330,076,000
北海道瓦斯	7,800	1,564.00	12,199,200
広島ガス	30,000	364.00	10,920,000
西部瓦斯	16,400	2,455.00	40,262,000
静岡ガス	41,300	862.00	35,600,600
メタウォーター	7,000	4,500.00	31,500,000
SBSホールディングス	10,800	2,042.00	22,053,600
東武鉄道	151,700	3,270.00	496,059,000
相鉄ホールディングス	46,600	2,863.00	133,415,800
東急	367,100	1,394.00	511,737,400
京浜急行電鉄	186,900	1,563.00	292,124,700
小田急電鉄	216,500	2,588.00	560,302,000
京王電鉄	75,500	6,280.00	474,140,000
京成電鉄	101,300	3,045.00	308,458,500
富士急行	19,800	3,235.00	64,053,000
新京成電鉄	3,700	2,225.00	8,232,500
東日本旅客鉄道	256,200	6,794.00	1,740,622,800
西日本旅客鉄道	129,700	5,380.00	697,786,000

東海旅客鉄道	121,000	15,385.00	1,861,585,000
西武ホールディングス	190,000	1,133.00	215,270,000
鴻池運輸	23,200	1,092.00	25,334,400
西日本鉄道	40,400	3,015.00	121,806,000
ハマキョウレックス	11,200	3,335.00	37,352,000
サカイ引越センター	7,700	4,600.00	35,420,000
近鉄グループホールディングス	137,900	4,700.00	648,130,000
阪急阪神ホールディングス	183,900	3,415.00	628,018,500
南海電気鉄道	65,300	2,301.00	150,255,300
京阪ホールディングス	61,400	4,560.00	279,984,000
神戸電鉄	3,300	3,670.00	12,111,000
名古屋鉄道	113,300	2,923.00	331,175,900
山陽電気鉄道	9,800	2,091.00	20,491,800
日本通運	47,700	6,130.00	292,401,000
ヤマトホールディングス	241,700	2,718.00	656,940,600
山九	38,300	4,330.00	165,839,000
丸運	7,900	224.00	1,769,600
丸全昭和運輸	11,200	3,355.00	37,576,000
センコーグループホールディングス	76,000	923.00	70,148,000
トナミホールディングス	3,300	5,800.00	19,140,000
ニッコンホールディングス	49,300	2,227.00	109,791,100
日本石油輸送	1,500	2,639.00	3,958,500
福山通運	17,600	5,110.00	89,936,000
セイノーホールディングス	103,200	1,630.00	168,216,000
エスライン	4,100	928.00	3,804,800
神奈川中央交通	3,400	3,980.00	13,532,000
日立物流	25,300	3,680.00	93,104,000
丸和運輸機関	14,500	4,110.00	59,595,000
C & F ロジホールディングス	13,900	1,657.00	23,032,300
九州旅客鉄道	120,900	2,294.00	277,344,600
S Gホールディングス	144,700	4,825.00	698,177,500
日本郵船	115,900	1,634.00	189,380,600
商船三井	87,700	1,940.00	170,138,000
川崎汽船	42,500	1,157.00	49,172,500
N S ユナイテッド海運	8,200	1,386.00	11,365,200
飯野海運	67,900	349.00	23,697,100
共栄タンカー	3,600	770.00	2,772,000
乾汽船	8,000	807.00	6,456,000
日本航空	243,800	2,081.50	507,469,700
A N A ホールディングス	252,000	2,580.00	650,160,000
パスコ	2,700	1,305.00	3,523,500
トランコム	3,800	7,370.00	28,006,000

日新	11,900	1,614.00	19,206,600
三菱倉庫	43,700	3,145.00	137,436,500
三井倉庫ホールディングス	15,700	1,720.00	27,004,000
住友倉庫	49,600	1,295.00	64,232,000
澁澤倉庫	7,600	1,936.00	14,713,600
東陽倉庫	24,900	329.00	8,192,100
日本トランスシティ	30,300	510.00	15,453,000
ケイヒン	2,700	1,291.00	3,485,700
中央倉庫	8,400	1,013.00	8,509,200
川西倉庫	2,500	1,058.00	2,645,000
安田倉庫	11,300	888.00	10,034,400
ファイズホールディングス	2,900	1,036.00	3,004,400
東洋埠頭	4,200	1,425.00	5,985,000
宇徳	11,800	470.00	5,546,000
上組	76,900	2,154.00	165,642,600
サンリツ	3,300	606.00	1,999,800
キムラユニティー	3,700	1,068.00	3,951,600
キューソー流通システム	3,400	1,440.00	4,896,000
近鉄エクスプレス	29,300	2,157.00	63,200,100
東海運	7,800	281.00	2,191,800
エーアイティー	9,700	920.00	8,924,000
内外トランスライン	4,800	1,088.00	5,222,400
日本コンセプト	4,400	1,232.00	5,420,800
NEC ネットエスアイ	40,700	1,928.00	78,469,600
クロスキャット	4,100	1,132.00	4,641,200
システナ	51,200	1,676.00	85,811,200
デジタルアーツ	7,100	7,880.00	55,948,000
日鉄ソリューションズ	21,500	3,070.00	66,005,000
キューブシステム	7,900	1,089.00	8,603,100
エイジア	2,800	1,851.00	5,182,800
コア	6,300	1,303.00	8,208,900
ラクーンホールディングス	6,900	1,240.00	8,556,000
ソリトンシステムズ	7,300	1,734.00	12,658,200
ソフトクリエイトホールディングス	6,400	2,644.00	16,921,600
T I S	143,000	2,124.00	303,732,000
ネオス	5,700	629.00	3,585,300
電算システム	5,100	3,545.00	18,079,500
グリー	88,400	452.00	39,956,800
コーエーテクモホールディングス	29,300	4,205.00	123,206,500
三菱総合研究所	6,200	3,925.00	24,335,000
電算	1,700	2,203.00	3,745,100
A G S	8,500	809.00	6,876,500

ファインデックス	12,300	1,175.00	14,452,500
ブレインパッド	3,800	3,805.00	14,459,000
K L a b	25,900	863.00	22,351,700
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,600	940.00	16,544,000
イーブুকイニシアティブジャパン	2,200	3,350.00	7,370,000
ネクソン	359,900	2,447.00	880,675,300
アイスタイル	41,200	296.00	12,195,200
エムアップホールディングス	4,200	3,575.00	15,015,000
エイチーム	10,200	898.00	9,159,600
エニグモ	13,700	1,506.00	20,632,200
テクノスジャパン	11,500	738.00	8,487,000
コロプラ	47,300	953.00	45,076,900
ブロードリーフ	71,500	506.00	36,179,000
クロス・マーケティンググループ	7,400	320.00	2,368,000
デジタルハーツホールディングス	7,900	1,037.00	8,192,300
システム情報	11,000	1,192.00	13,112,000
メディアドゥ	4,600	6,460.00	29,716,000
じげん	36,400	328.00	11,939,200
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	791.00	2,847,600
サイバーリンクス	2,500	1,800.00	4,500,000
フィックスターズ	15,500	1,120.00	17,360,000
C A R T A H O L D I N G S	6,000	1,123.00	6,738,000
オブティム	7,600	2,944.00	22,374,400
セレス	4,900	1,811.00	8,873,900
S H I F T	5,800	11,930.00	69,194,000
ティーガイア	12,800	2,107.00	26,969,600
セック	2,200	3,025.00	6,655,000
日本アジアグループ	15,100	286.00	4,318,600
テクマトリックス	20,300	2,076.00	42,142,800
プロシップ	4,400	1,498.00	6,591,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,600	2,142.00	74,113,200
G M O ペイメントゲートウェイ	30,300	11,100.00	336,330,000
ザッパラス	7,100	400.00	2,840,000
システムリサーチ	4,000	1,716.00	6,864,000
インターネットイニシアティブ	21,200	4,255.00	90,206,000
さくらインターネット	15,900	591.00	9,396,900
ヴィンクス	4,300	1,148.00	4,936,400
G M O クラウド	3,200	8,380.00	26,816,000
S R A ホールディングス	7,700	2,357.00	18,148,900
システムインテグレータ	5,000	740.00	3,700,000
朝日ネット	10,500	928.00	9,744,000
e B A S E	17,300	1,159.00	20,050,700

アバント	14,000	1,001.00	14,014,000
アドソル日進	5,200	2,483.00	12,911,600
フリービット	7,900	846.00	6,683,400
コムチュア	16,200	2,177.00	35,267,400
サイバーコム	2,700	1,876.00	5,065,200
アステリア	9,300	750.00	6,975,000
アイル	8,100	1,643.00	13,308,300
マークラインズ	6,100	2,058.00	12,553,800
メディカル・データ・ビジョン	16,500	1,741.00	28,726,500
ショーケース	3,600	732.00	2,635,200
モバイルファクトリー	3,500	1,278.00	4,473,000
テラスカイ	5,200	4,620.00	24,024,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,219.00	7,192,100
P C Iホールディングス	5,700	1,041.00	5,933,700
パイプドHD	2,100	1,487.00	3,122,700
アイビーシー	2,700	909.00	2,454,300
ネオジャパン	2,800	2,693.00	7,540,400
P R T I M E S	2,600	2,197.00	5,712,200
ランドコンピュータ	2,500	1,026.00	2,565,000
ダブルスタンダード	1,900	4,505.00	8,559,500
オープンドア	7,400	1,305.00	9,657,000
マイネット	4,700	1,414.00	6,645,800
アカツキ	5,200	3,945.00	20,514,000
ベネフィットジャパン	1,300	1,772.00	2,303,600
U b i c o mホールディングス	3,300	1,821.00	6,009,300
L I N E	43,700	5,400.00	235,980,000
カナミックネットワーク	13,500	805.00	10,867,500
ノムラシステムコーポレーション	7,000	393.00	2,751,000
チェンジ	10,000	6,830.00	68,300,000
シンクロ・フード	7,200	335.00	2,412,000
オークネット	7,900	1,140.00	9,006,000
セグエグループ	4,000	1,026.00	4,104,000
エイトレッド	2,500	2,009.00	5,022,500
A O I T Y O H o l d i n g s	15,300	404.00	6,181,200
マクロミル	29,600	824.00	24,390,400
ビーグリー	3,000	1,589.00	4,767,000
オロ	4,600	3,045.00	14,007,000
ユーザーローカル	1,500	3,780.00	5,670,000
テモナ	3,300	1,329.00	4,385,700
ニーズウェル	3,200	714.00	2,284,800
サインポスト	3,200	1,378.00	4,409,600
ソルクシーズ	5,900	808.00	4,767,200

フェイス	5,300	985.00	5,220,500
プロトコーポレーション	13,100	1,178.00	15,431,800
ハイマックス	1,900	2,414.00	4,586,600
野村総合研究所	202,600	2,830.00	573,358,000
サイバネットシステム	10,600	772.00	8,183,200
C Eホールディングス	8,300	540.00	4,482,000
日本システム技術	2,500	1,614.00	4,035,000
インテージホールディングス	18,200	913.00	16,616,600
東邦システムサイエンス	4,100	957.00	3,923,700
ソースネクスト	69,100	279.00	19,278,900
インフォコム	15,700	3,445.00	54,086,500
HEROZ	2,100	3,640.00	7,644,000
ラクスル	11,600	3,020.00	35,032,000
F I G	17,000	230.00	3,910,000
システムサポート	3,400	1,698.00	5,773,200
イーソル	8,100	1,164.00	9,428,400
アルテリア・ネットワークス	16,000	1,767.00	28,272,000
東海ソフト	1,300	1,244.00	1,617,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,072.00	3,001,600
東名	1,000	1,284.00	1,284,000
ヴィッツ	600	3,710.00	2,226,000
トピラシステムズ	1,600	1,899.00	3,038,400
L i n k - U	1,100	2,274.00	2,501,400
フォーカスシステムズ	9,300	803.00	7,467,900
クレスコ	9,000	1,263.00	11,367,000
フジ・メディア・ホールディングス	138,000	1,053.00	145,314,000
オービック	49,500	18,570.00	919,215,000
ジャストシステム	23,300	7,970.00	185,701,000
T D Cソフト	12,900	938.00	12,100,200
Zホールディングス	1,962,200	691.00	1,355,880,200
トレンドマイクロ	76,300	6,610.00	504,343,000
I Dホールディングス	5,700	1,378.00	7,854,600
日本オラクル	29,000	12,420.00	360,180,000
アルファシステムズ	4,500	3,705.00	16,672,500
フューチャー	17,400	1,884.00	32,781,600
C A C H o l d i n g s	9,600	1,291.00	12,393,600
S Bテクノロジー	5,200	3,035.00	15,782,000
トーセ	4,200	896.00	3,763,200
オービックビジネスコンサルタント	14,600	6,280.00	91,688,000
伊藤忠テクノソリューションズ	65,200	3,875.00	252,650,000
アイティフォー	17,700	790.00	13,983,000
東計電算	2,200	4,345.00	9,559,000

エクスネット	2,600	964.00	2,506,400
大塚商会	77,400	5,260.00	407,124,000
サイボウズ	16,800	3,040.00	51,072,000
ソフトブレーン	11,600	865.00	10,034,000
電通国際情報サービス	8,900	5,550.00	49,395,000
A C C E S S	13,800	896.00	12,364,800
デジタルガレージ	25,800	3,165.00	81,657,000
E Mシステムズ	20,600	838.00	17,262,800
ウェザーニューズ	4,900	4,595.00	22,515,500
C I J	10,200	844.00	8,608,800
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,943.00	5,003,100
日本エンタープライズ	15,700	302.00	4,741,400
WOWOW	7,000	2,655.00	18,585,000
スカラ	10,000	765.00	7,650,000
インテリジェント ウェイブ	8,800	783.00	6,890,400
I M A G I C A G R O U P	13,100	391.00	5,122,100
ネットワンシステムズ	54,500	4,020.00	219,090,000
システムソフト	34,600	91.00	3,148,600
アルゴグラフィックス	12,200	3,410.00	41,602,000
マーベラス	22,300	782.00	17,438,600
エイベックス	25,000	907.00	22,675,000
日本ユニシス	44,700	2,985.00	133,429,500
兼松エレクトロニクス	7,900	3,950.00	31,205,000
都築電気	4,700	1,599.00	7,515,300
東京放送ホールディングス	87,100	1,811.00	157,738,100
日本テレビホールディングス	119,500	1,260.00	150,570,000
朝日放送グループホールディングス	14,700	714.00	10,495,800
テレビ朝日ホールディングス	39,500	1,677.00	66,241,500
スカパーJ S A Tホールディングス	94,900	406.00	38,529,400
テレビ東京ホールディングス	11,900	2,286.00	27,203,400
日本BS放送	5,200	1,072.00	5,574,400
ビジョン	18,200	792.00	14,414,400
スマートバリュー	4,000	850.00	3,400,000
ワイヤレスゲート	6,300	753.00	4,743,900
コネクシオ	8,400	1,287.00	10,810,800
クロップス	3,100	770.00	2,387,000
日本電信電話	1,909,600	2,541.50	4,853,248,400
K D D I	1,041,500	3,231.00	3,365,086,500
ソフトバンク	1,298,400	1,431.50	1,858,659,600
光通信	14,700	25,560.00	375,732,000
N T T ドコモ	1,021,500	3,062.00	3,127,833,000
エムティーアイ	14,300	702.00	10,038,600

GMOインターネット	51,300	2,761.00	141,639,300
ファイバーゲート	4,800	1,743.00	8,366,400
アйдママーケティングコミュニケーション	5,100	438.00	2,233,800
KADOKAWA	38,600	2,756.00	106,381,600
学研ホールディングス	19,400	1,564.00	30,341,600
ゼンリン	28,800	1,105.00	31,824,000
昭文社ホールディングス	7,400	455.00	3,367,000
インプレスホールディングス	11,800	154.00	1,817,200
アイネット	7,600	1,476.00	11,217,600
松竹	9,500	14,020.00	133,190,000
東宝	84,400	3,985.00	336,334,000
東映	5,400	15,400.00	83,160,000
エヌ・ティ・ティ・データ	380,600	1,209.00	460,145,400
ピー・シー・エー	2,500	4,680.00	11,700,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,367.00	7,108,400
D T S	32,100	2,221.00	71,294,100
スクウェア・エニックス・ホールディングス	61,000	6,850.00	417,850,000
シーイーシー	15,500	1,611.00	24,970,500
カブコン	67,400	5,040.00	339,696,000
アイ・エス・ピー	3,100	2,381.00	7,381,100
ジャステック	9,400	1,231.00	11,571,400
S C S K	33,000	5,670.00	187,110,000
日本システムウエア	4,900	1,892.00	9,270,800
アイネス	14,300	1,315.00	18,804,500
T K C	12,100	6,010.00	72,721,000
富士ソフト	15,300	4,795.00	73,363,500
N S D	46,100	1,868.00	86,114,800
コナミホールディングス	52,000	3,950.00	205,400,000
福井コンピュータホールディングス	5,800	2,668.00	15,474,400
J B C Cホールディングス	9,900	1,613.00	15,968,700
ミロク情報サービス	12,800	2,107.00	26,969,600
ソフトバンクグループ	1,133,400	6,397.00	7,250,359,800
ハウスイ	1,200	881.00	1,057,200
高千穂交易	5,500	933.00	5,131,500
カワニシホールディングス	1,700	1,350.00	2,295,000
伊藤忠食品	3,500	5,300.00	18,550,000
エレマテック	13,400	934.00	12,515,600
J A L U X	4,100	1,579.00	6,473,900
あらた	11,400	5,020.00	57,228,000
トーマンデバイス	2,200	3,655.00	8,041,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	2,923.00	15,199,600
フィールズ	11,000	326.00	3,586,000

双日	791,900	236.00	186,888,400
アルフレッサ ホールディングス	159,300	2,133.00	339,786,900
横浜冷凍	37,500	894.00	33,525,000
ラサ商事	7,600	938.00	7,128,800
アルコニックス	15,200	1,382.00	21,006,400
神戸物産	49,500	6,260.00	309,870,000
ハイパー	2,200	532.00	1,170,400
あい ホールディングス	20,500	1,727.00	35,403,500
ディーブイエックス	5,100	895.00	4,564,500
ダイワボウホールディングス	12,200	6,210.00	75,762,000
マクニカ・富士エレホールディングス	34,200	1,770.00	60,534,000
ラクト・ジャパン	6,200	3,465.00	21,483,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,000	1,050.00	28,350,000
八洲電機	11,100	966.00	10,722,600
メディアスホールディングス	8,200	810.00	6,642,000
レスターホールディングス	15,000	1,921.00	28,815,000
ジューテックホールディングス	3,300	996.00	3,286,800
大光	6,100	671.00	4,093,100
O C H Iホールディングス	4,200	1,542.00	6,476,400
T O K A Iホールディングス	75,800	1,020.00	77,316,000
黒谷	3,900	489.00	1,907,100
C o m i n i x	2,500	719.00	1,797,500
三洋貿易	14,400	996.00	14,342,400
ビューティガレージ	2,300	1,995.00	4,588,500
ウイン・パートナーズ	10,400	931.00	9,682,400
ミタチ産業	4,300	548.00	2,356,400
シップヘルスケアホールディングス	23,000	4,875.00	112,125,000
明治電機工業	4,500	1,388.00	6,246,000
デリカフーズホールディングス	5,100	647.00	3,299,700
スターティアホールディングス	3,300	605.00	1,996,500
コメダホールディングス	31,300	1,796.00	56,214,800
ピーバンドットコム	1,500	914.00	1,371,000
アセンテック	3,100	1,924.00	5,964,400
富士興産	4,400	603.00	2,653,200
協栄産業	1,600	1,247.00	1,995,200
小野建	12,900	1,125.00	14,512,500
南陽	3,200	1,484.00	4,748,800
佐島電機	9,800	824.00	8,075,200
エコトレーディング	3,300	547.00	1,805,100
伯東	8,800	1,098.00	9,662,400
コンドーテック	11,100	1,173.00	13,020,300
中山福	8,300	475.00	3,942,500

ナガイレーベン	19,000	2,659.00	50,521,000
三菱食品	15,800	2,728.00	43,102,400
松田産業	10,500	1,559.00	16,369,500
第一興商	21,300	3,230.00	68,799,000
メディカルホールディングス	154,700	2,027.00	313,576,900
S P K	6,200	1,350.00	8,370,000
萩原電気ホールディングス	5,300	1,892.00	10,027,600
アズワン	9,400	13,260.00	124,644,000
スズデン	5,000	1,138.00	5,690,000
尾家産業	4,200	1,500.00	6,300,000
シモジマ	8,800	1,225.00	10,780,000
ドウシシャ	13,500	2,047.00	27,634,500
小津産業	3,200	1,759.00	5,628,800
高速	8,500	1,442.00	12,257,000
たけびし	5,000	1,480.00	7,400,000
リックス	3,200	1,447.00	4,630,400
丸文	12,700	477.00	6,057,900
ハピネット	12,000	1,252.00	15,024,000
橋本総業ホールディングス	2,900	2,035.00	5,901,500
日本ライフライン	42,500	1,384.00	58,820,000
タカショー	9,300	578.00	5,375,400
マルカ	4,700	1,939.00	9,113,300
I D O M	38,700	524.00	20,278,800
進和	8,500	1,980.00	16,830,000
エスケイジャパン	3,200	294.00	940,800
ダイترون	6,100	1,406.00	8,576,600
シークス	18,300	876.00	16,030,800
田中商事	4,400	707.00	3,110,800
オーハシテクニカ	7,400	1,437.00	10,633,800
白銅	5,100	1,166.00	5,946,600
ダイコー通産	900	1,189.00	1,070,100
伊藤忠商事	1,002,800	2,614.00	2,621,319,200
丸紅	1,492,400	584.20	871,860,080
高島	2,300	1,785.00	4,105,500
長瀬産業	80,600	1,359.00	109,535,400
蝶理	9,200	1,557.00	14,324,400
豊田通商	160,000	3,035.00	485,600,000
三共生興	21,800	406.00	8,850,800
兼松	53,500	1,329.00	71,101,500
ツカモトコーポレーション	2,600	1,150.00	2,990,000
三井物産	1,241,400	1,783.00	2,213,416,200
日本紙パルプ商事	8,200	3,830.00	31,406,000

カメイ	18,700	1,000.00	18,700,000
東都水産	1,800	3,035.00	5,463,000
OUGホールディングス	2,300	2,800.00	6,440,000
スターゼン	5,300	3,925.00	20,802,500
山善	56,000	992.00	55,552,000
椿本興業	2,700	3,175.00	8,572,500
住友商事	904,600	1,260.00	1,139,796,000
内田洋行	5,700	5,970.00	34,029,000
三菱商事	940,100	2,332.50	2,192,783,250
第一実業	7,000	3,560.00	24,920,000
キャノンマーケティングジャパン	35,600	1,920.00	68,352,000
西華産業	8,100	1,238.00	10,027,800
佐藤商事	11,900	905.00	10,769,500
菱洋エレクトロ	14,500	2,955.00	42,847,500
東京産業	13,000	501.00	6,513,000
ユアサ商事	13,600	2,986.00	40,609,600
神鋼商事	3,600	1,757.00	6,325,200
トルク	8,600	296.00	2,545,600
阪和興業	26,800	2,069.00	55,449,200
正栄食品工業	9,300	4,000.00	37,200,000
カナデン	11,700	1,380.00	16,146,000
菱電商事	10,300	1,413.00	14,553,900
フルサト工業	7,900	1,334.00	10,538,600
岩谷産業	31,800	3,795.00	120,681,000
ナイス	6,100	1,204.00	7,344,400
昭光通商	4,600	563.00	2,589,800
ニチモウ	2,200	1,893.00	4,164,600
極東貿易	4,100	1,306.00	5,354,600
イワキ	18,900	458.00	8,656,200
三愛石油	35,300	937.00	33,076,100
稲畑産業	31,600	1,297.00	40,985,200
G S Iクレオス	3,500	1,695.00	5,932,500
明和産業	13,300	462.00	6,144,600
クワザワ	5,100	520.00	2,652,000
ヤマエ久野	10,500	1,214.00	12,747,000
ワキタ	30,600	950.00	29,070,000
東邦ホールディングス	46,000	2,040.00	93,840,000
サンゲツ	38,700	1,614.00	62,461,800
ミツウロコグループホールディングス	21,200	1,117.00	23,680,400
シナネンホールディングス	5,900	2,937.00	17,328,300
伊藤忠エネクス	31,700	940.00	29,798,000
サンリオ	40,300	1,731.00	69,759,300

サンワテクノス	10,200	810.00	8,262,000	
リョーサン	15,800	1,957.00	30,920,600	
新光商事	22,500	845.00	19,012,500	
トーホー	6,500	1,851.00	12,031,500	
三信電気	7,700	1,756.00	13,521,200	
東陽テクニカ	15,400	942.00	14,506,800	
モスフードサービス	18,800	2,868.00	53,918,400	
加賀電子	14,300	2,088.00	29,858,400	
ソーダニッカ	14,800	530.00	7,844,000	
立花エレテック	10,600	1,734.00	18,380,400	
フォーバル	6,300	962.00	6,060,600	
PALTAC	23,000	5,820.00	133,860,000	
三谷産業	18,900	347.00	6,558,300	
西本Wismettacホールディングス	3,300	1,866.00	6,157,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,583.00	2,057,900	
コア商事ホールディングス	1,400	1,875.00	2,625,000	
国際紙パルプ商事	34,000	275.00	9,350,000	
ヤマタネ	7,200	1,248.00	8,985,600	
丸紅建材リース	1,400	1,730.00	2,422,000	
日鉄物産	10,200	3,140.00	32,028,000	
泉州電業	4,000	2,990.00	11,960,000	
トラスコ中山	32,800	2,450.00	80,360,000	
オートバックスセブン	53,200	1,385.00	73,682,000	
モリト	10,500	590.00	6,195,000	
加藤産業	20,700	3,655.00	75,658,500	
北恵	3,600	1,006.00	3,621,600	
イノテック	7,500	995.00	7,462,500	
イエローハット	27,100	1,751.00	47,452,100	
JKホールディングス	13,000	754.00	9,802,000	
日伝	13,000	2,119.00	27,547,000	
北沢産業	10,900	262.00	2,855,800	
杉本商事	7,700	1,903.00	14,653,100	
因幡電機産業	40,800	2,586.00	105,508,800	
東テク	4,800	2,220.00	10,656,000	
ミスミグループ本社	179,700	2,746.00	493,456,200	
アルテック	10,600	235.00	2,491,000	
タキヒヨー	4,400	1,720.00	7,568,000	
蔵王産業	2,800	1,420.00	3,976,000	
スズケン	60,700	3,985.00	241,889,500	
ジェコス	9,900	916.00	9,068,400	
グローセル	14,400	402.00	5,788,800	
ローソン	36,300	5,130.00	186,219,000	

サンエー	12,000	4,295.00	51,540,000
カワチ薬品	11,200	2,966.00	33,219,200
エービーシー・マート	22,400	5,570.00	124,768,000
ハードオフコーポレーション	6,000	662.00	3,972,000
アスクル	15,100	3,120.00	47,112,000
ゲオホールディングス	25,900	1,684.00	43,615,600
アダストリア	20,000	1,678.00	33,560,000
ジーフット	8,700	478.00	4,158,600
くら寿司	8,500	4,735.00	40,247,500
キャンドウ	6,900	2,127.00	14,676,300
パルグループホールディングス	14,800	1,136.00	16,812,800
エディオン	66,000	1,191.00	78,606,000
サーラコーポレーション	29,500	576.00	16,992,000
ワッツ	6,500	916.00	5,954,000
ハローズ	5,400	3,710.00	20,034,000
フジオフードグループ本社	12,300	1,256.00	15,448,800
あみやき亭	3,200	2,772.00	8,870,400
ひらまつ	26,400	181.00	4,778,400
大黒天物産	3,500	5,740.00	20,090,000
ハニーズホールディングス	12,800	1,107.00	14,169,600
ファーマライズホールディングス	3,800	728.00	2,766,400
アルペン	11,100	1,771.00	19,658,100
ハブ	4,500	603.00	2,713,500
クオールホールディングス	21,300	1,127.00	24,005,100
ジinzホールディングス	7,600	7,310.00	55,556,000
ビックカメラ	85,200	1,183.00	100,791,600
D C Mホールディングス	81,300	1,293.00	105,120,900
Monotaro	102,000	4,110.00	419,220,000
東京一番フーズ	4,100	533.00	2,185,300
きちりホールディングス	4,200	588.00	2,469,600
アークランドサービスホールディングス	12,100	1,940.00	23,474,000
J.フロント リテイリング	171,500	715.00	122,622,500
ドトール・日レスホールディングス	20,800	1,610.00	33,488,000
マツモトキヨシホールディングス	59,300	3,685.00	218,520,500
broncoビリー	7,600	2,122.00	16,127,200
Z O Z O	98,700	2,950.00	291,165,000
トレジャー・ファクトリー	4,500	765.00	3,442,500
物語コーポレーション	3,800	9,010.00	34,238,000
ココカラファイン	15,000	6,080.00	91,200,000
三越伊勢丹ホールディングス	251,100	570.00	143,127,000
Hamee	5,200	2,302.00	11,970,400
ウエルシアホールディングス	85,400	4,525.00	386,435,000

クリエイトSDホールディングス	24,200	3,795.00	91,839,000
丸善CHIホールディングス	16,700	372.00	6,212,400
ティーライフ	2,300	1,337.00	3,075,100
チムニー	4,500	1,379.00	6,205,500
シュッピン	10,000	819.00	8,190,000
オイシックス・ラ・大地	14,200	3,100.00	44,020,000
ネクステージ	24,200	1,032.00	24,974,400
ジョイフル本田	42,100	1,506.00	63,402,600
鳥貴族	4,400	1,430.00	6,292,000
キリン堂ホールディングス	5,700	2,637.00	15,030,900
ホットランド	10,900	1,129.00	12,306,100
すかいらーくホールディングス	160,800	1,638.00	263,390,400
SFPホールディングス	8,300	1,338.00	11,105,400
綿半ホールディングス	5,500	2,424.00	13,332,000
ヨシックス	2,500	1,763.00	4,407,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,800	1,233.00	51,539,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,900	514.00	4,060,600
B E E N O S	6,800	1,550.00	10,540,000
あさひ	10,800	1,764.00	19,051,200
日本調剤	8,800	1,590.00	13,992,000
コスモス薬品	12,700	18,370.00	233,299,000
トーエル	7,200	749.00	5,392,800
オンリー	2,900	503.00	1,458,700
セブン&アイ・ホールディングス	560,900	3,407.00	1,910,986,300
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	77,100	627.00	48,341,700
ツルハホールディングス	31,200	14,180.00	442,416,000
サンマルクホールディングス	11,500	1,597.00	18,365,500
フェリシモ	3,400	1,010.00	3,434,000
トリドールホールディングス	35,600	1,348.00	47,988,800
T O K Y O B A S E	13,600	338.00	4,596,800
ウイルプラスホールディングス	2,200	594.00	1,306,800
J Mホールディングス	10,900	3,380.00	36,842,000
サツドラホールディングス	2,300	1,971.00	4,533,300
アレンザホールディングス	7,300	1,190.00	8,687,000
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,563.00	6,095,700
パロックジャパンリミテッド	10,300	615.00	6,334,500
クスリのアオキホールディングス	12,800	9,000.00	115,200,000
力の源ホールディングス	6,500	663.00	4,309,500
スシローグローバルホールディングス	78,800	2,418.00	190,538,400
メディカルシステムネットワーク	14,300	465.00	6,649,500
はるやまホールディングス	7,000	716.00	5,012,000

ノジマ	25,600	3,075.00	78,720,000
カップ・クリエイト	20,100	1,433.00	28,803,300
ライトオン	10,700	568.00	6,077,600
良品計画	190,500	1,624.00	309,372,000
三城ホールディングス	16,100	276.00	4,443,600
アドヴァン	22,100	1,325.00	29,282,500
アルビス	5,500	2,574.00	14,157,000
コナカ	17,700	286.00	5,062,200
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,606.00	3,051,400
G - 7ホールディングス	8,500	3,125.00	26,562,500
イオン北海道	19,100	777.00	14,840,700
コジマ	25,100	538.00	13,503,800
ヒマラヤ	5,300	874.00	4,632,200
コーナン商事	20,400	3,825.00	78,030,000
エコス	5,400	2,195.00	11,853,000
ワタミ	17,200	957.00	16,460,400
マルシェ	4,200	558.00	2,343,600
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	315,200	2,457.00	774,446,400
西松屋チェーン	31,600	1,346.00	42,533,600
ゼンショーホールディングス	68,800	2,325.00	159,960,000
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,656.00	15,069,600
ハークスレイ	3,200	966.00	3,091,200
サイゼリヤ	21,400	1,932.00	41,344,800
V Tホールディングス	60,000	392.00	23,520,000
魚力	4,100	1,702.00	6,978,200
フジ・コーポレーション	3,900	2,102.00	8,197,800
ユナイテッドアローズ	15,200	1,601.00	24,335,200
ハイデイ日高	20,800	1,738.00	36,150,400
京都きもの友禅	10,100	234.00	2,363,400
コロワイド	47,600	1,626.00	77,397,600
ピーシーデポコーポレーション	19,400	699.00	13,560,600
壱番屋	10,100	5,110.00	51,611,000
P L A N T	3,900	799.00	3,116,100
スギホールディングス	28,700	7,570.00	217,259,000
薬王堂ホールディングス	6,300	2,483.00	15,642,900
スクロール	22,300	809.00	18,040,700
ヨンドシーホールディングス	14,700	1,673.00	24,593,100
ファミリーマート	114,600	2,371.00	271,716,600
木曽路	18,800	2,317.00	43,559,600
S R Sホールディングス	17,100	918.00	15,697,800
タカキュー	11,100	128.00	1,420,800
リテールパートナーズ	19,100	1,874.00	35,793,400

ケーヨー	29,600	835.00	24,716,000
上新電機	17,000	2,381.00	40,477,000
日本瓦斯	22,700	4,120.00	93,524,000
ロイヤルホールディングス	25,000	1,805.00	45,125,000
いなげや	17,800	1,768.00	31,470,400
鳥忠	27,000	2,913.00	78,651,000
チヨダ	15,300	994.00	15,208,200
ライフコーポレーション	10,900	4,685.00	51,066,500
リンガーハット	17,700	2,450.00	43,365,000
MrMaxHD	20,000	745.00	14,900,000
テンアライド	13,200	386.00	5,095,200
AOKIホールディングス	29,100	564.00	16,412,400
オークワ	22,600	1,468.00	33,176,800
コメリ	22,200	3,210.00	71,262,000
青山商事	30,000	634.00	19,020,000
しまむら	16,700	8,860.00	147,962,000
はせがわ	8,300	291.00	2,415,300
高島屋	104,600	823.00	86,085,800
松屋	29,100	622.00	18,100,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,100	734.00	49,985,400
近鉄百貨店	5,600	2,758.00	15,444,800
丸井グループ	131,500	1,906.00	250,639,000
アクシアル リテイリング	11,900	4,600.00	54,740,000
イオン	551,700	2,616.50	1,443,523,050
イズミ	29,200	4,070.00	118,844,000
平和堂	29,200	2,175.00	63,510,000
フジ	17,400	1,840.00	32,016,000
ヤオコー	16,300	8,250.00	134,475,000
ゼビオホールディングス	17,600	746.00	13,129,600
ケースホールディングス	138,500	1,502.00	208,027,000
Olympicグループ	7,600	906.00	6,885,600
日産東京販売ホールディングス	22,000	253.00	5,566,000
シルバーライフ	2,000	2,092.00	4,184,000
一家ダイニングプロジェクト	1,500	586.00	879,000
Genky DrugStores	6,400	3,285.00	21,024,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	616.00	2,217,600
ブックオフグループホールディングス	8,400	852.00	7,156,800
アインホールディングス	17,600	6,690.00	117,744,000
元気寿司	3,700	2,239.00	8,284,300
ヤマダ電機	437,200	561.00	245,269,200
アーランドサカモト	22,500	2,097.00	47,182,500
ニトリホールディングス	62,100	21,640.00	1,343,844,000

グルメ杵屋	10,500	978.00	10,269,000
愛眼	11,400	219.00	2,496,600
ケーユーホールディングス	7,800	791.00	6,169,800
吉野家ホールディングス	47,200	2,088.00	98,553,600
松屋フーズホールディングス	7,000	3,505.00	24,535,000
サガミホールディングス	19,300	1,311.00	25,302,300
関西スーパーマーケット	12,100	1,224.00	14,810,400
王将フードサービス	10,600	5,820.00	61,692,000
プレナス	16,200	1,732.00	28,058,400
ミニストップ	10,700	1,498.00	16,028,600
アークス	29,400	2,606.00	76,616,400
パローホールディングス	31,800	2,659.00	84,556,200
ベルク	7,100	7,300.00	51,830,000
大庄	7,900	1,239.00	9,788,100
ファーストリテイリング	19,200	61,310.00	1,177,152,000
サンドラッグ	54,000	3,955.00	213,570,000
サックスパー ホールディングス	12,600	538.00	6,778,800
ヤマザワ	3,500	1,727.00	6,044,500
やまや	2,900	2,116.00	6,136,400
ベルーナ	31,000	995.00	30,845,000
島根銀行	3,800	585.00	2,223,000
じもとホールディングス	97,000	102.00	9,894,000
めぶきフィナンシャルグループ	746,000	256.00	190,976,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,400	1,124.00	21,805,600
九州フィナンシャルグループ	314,100	487.00	152,966,700
ゆうちょ銀行	406,800	851.00	346,186,800
富山第一銀行	34,200	266.00	9,097,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	820,000	352.00	288,640,000
西日本フィナンシャルホールディングス	95,500	714.00	68,187,000
関西みらいフィナンシャルグループ	84,300	440.00	37,092,000
三十三フィナンシャルグループ	13,300	1,352.00	17,981,600
第四北越フィナンシャルグループ	24,900	2,046.00	50,945,400
新生銀行	105,400	1,217.00	128,271,800
あおぞら銀行	85,500	1,889.00	161,509,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,821,400	440.60	4,327,308,840
りそなホールディングス	1,560,900	386.50	603,287,850
三井住友トラスト・ホールディングス	271,400	3,079.00	835,640,600
三井住友フィナンシャルグループ	993,000	3,118.00	3,096,174,000
千葉銀行	479,100	548.00	262,546,800
群馬銀行	275,800	348.00	95,978,400
武蔵野銀行	21,400	1,550.00	33,170,000
千葉興業銀行	39,400	225.00	8,865,000

筑波銀行	59,700	169.00	10,089,300
七十七銀行	48,500	1,580.00	76,630,000
青森銀行	11,100	2,222.00	24,664,200
秋田銀行	9,200	1,485.00	13,662,000
山形銀行	16,100	1,338.00	21,541,800
岩手銀行	9,400	2,488.00	23,387,200
東邦銀行	128,400	225.00	28,890,000
東北銀行	6,900	1,013.00	6,989,700
みちのく銀行	9,200	1,041.00	9,577,200
ふくおかフィナンシャルグループ	120,900	1,748.00	211,333,200
静岡銀行	349,700	742.00	259,477,400
十六銀行	18,000	1,946.00	35,028,000
スルガ銀行	146,900	380.00	55,822,000
八十二銀行	346,500	407.00	141,025,500
山梨中央銀行	16,700	829.00	13,844,300
大垣共立銀行	28,400	2,240.00	63,616,000
福井銀行	12,300	1,743.00	21,438,900
北國銀行	14,300	3,075.00	43,972,500
清水銀行	5,900	1,655.00	9,764,500
富山銀行	2,800	2,380.00	6,664,000
滋賀銀行	28,800	2,502.00	72,057,600
南都銀行	23,900	1,979.00	47,298,100
百五銀行	129,200	330.00	42,636,000
京都銀行	51,400	4,570.00	234,898,000
紀陽銀行	50,800	1,574.00	79,959,200
ほくほくフィナンシャルグループ	95,600	988.00	94,452,800
広島銀行	211,900	538.00	114,002,200
山陰合同銀行	85,100	538.00	45,783,800
中国銀行	123,600	985.00	121,746,000
鳥取銀行	4,900	1,116.00	5,468,400
伊予銀行	204,900	679.00	139,127,100
百十四銀行	15,300	1,779.00	27,218,700
四国銀行	21,800	780.00	17,004,000
阿波銀行	23,500	2,407.00	56,564,500
大分銀行	8,300	2,474.00	20,534,200
宮崎銀行	9,600	2,410.00	23,136,000
佐賀銀行	8,700	1,265.00	11,005,500
沖縄銀行	13,100	2,970.00	38,907,000
琉球銀行	33,100	887.00	29,359,700
セブン銀行	479,700	266.00	127,600,200
みずほフィナンシャルグループ	19,509,400	144.20	2,813,255,480
高知銀行	5,200	664.00	3,452,800

山口フィナンシャルグループ	179,200	706.00	126,515,200
長野銀行	4,700	1,117.00	5,249,900
名古屋銀行	10,700	2,430.00	26,001,000
北洋銀行	216,400	224.00	48,473,600
愛知銀行	5,200	2,988.00	15,537,600
中京銀行	5,900	2,041.00	12,041,900
大光銀行	4,900	1,260.00	6,174,000
愛媛銀行	20,000	1,161.00	23,220,000
トマト銀行	5,500	1,016.00	5,588,000
京葉銀行	61,200	499.00	30,538,800
栃木銀行	69,400	167.00	11,589,800
北日本銀行	4,500	1,738.00	7,821,000
東和銀行	25,200	681.00	17,161,200
福島銀行	13,500	154.00	2,079,000
大東銀行	7,500	631.00	4,732,500
トモニホールディングス	111,000	344.00	38,184,000
フィデアホールディングス	139,400	103.00	14,358,200
池田泉州ホールディングス	165,100	165.00	27,241,500
F P G	44,700	532.00	23,780,400
マーキュリアインベストメント	5,900	598.00	3,528,200
S B Iホールディングス	160,400	2,392.00	383,676,800
ジャフコ	22,100	4,260.00	94,146,000
大和証券グループ本社	1,152,500	472.50	544,556,250
野村ホールディングス	2,526,600	540.50	1,365,627,300
岡三証券グループ	123,000	317.00	38,991,000
丸三証券	43,100	414.00	17,843,400
東洋証券	53,100	106.00	5,628,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	165,700	249.00	41,259,300
光世証券	3,800	573.00	2,177,400
水戸証券	42,500	198.00	8,415,000
いちよし証券	27,300	465.00	12,694,500
松井証券	82,200	933.00	76,692,600
マネックスグループ	106,100	267.00	28,328,700
極東証券	19,600	583.00	11,426,800
岩井コスモホールディングス	13,700	1,228.00	16,823,600
藍澤證券	26,100	689.00	17,982,900
マネーパートナーズグループ	16,200	207.00	3,353,400
スパークス・グループ	67,300	199.00	13,392,700
かんぽ生命保険	50,900	1,676.00	85,308,400
S O M P Oホールディングス	270,000	3,993.00	1,078,110,000
アニコム ホールディングス	11,900	4,455.00	53,014,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	375,400	2,951.50	1,107,993,100

第一生命ホールディングス	812,400	1,585.50	1,288,060,200
東京海上ホールディングス	507,600	4,943.00	2,509,066,800
T & Dホールディングス	429,100	1,107.00	475,013,700
アドバンスクリエイト	3,000	2,092.00	6,276,000
全国保証	40,500	3,675.00	148,837,500
イントラスト	5,100	835.00	4,258,500
日本モーゲージサービス	5,800	1,345.00	7,801,000
C a s a	5,100	1,081.00	5,513,100
アルヒ	22,900	1,676.00	38,380,400
プレミアグループ	7,800	1,849.00	14,422,200
クレディセゾン	100,600	1,185.00	119,211,000
芙蓉総合リース	15,100	6,370.00	96,187,000
みずほリース	22,200	2,667.00	59,207,400
東京センチュリー	28,900	5,420.00	156,638,000
日本証券金融	63,400	534.00	33,855,600
アイフル	219,400	244.00	53,533,600
リコーリース	11,300	2,712.00	30,645,600
イオンフィナンシャルサービス	88,000	913.00	80,344,000
アコム	288,800	413.00	119,274,400
ジャックス	15,900	1,738.00	27,634,200
オリエントコーポレーション	389,100	114.00	44,357,400
日立キャピタル	33,900	2,644.00	89,631,600
アプラスフィナンシャル	69,800	71.00	4,955,800
オリックス	890,800	1,306.50	1,163,830,200
三菱UFJリース	364,600	498.00	181,570,800
九州リースサービス	7,200	570.00	4,104,000
日本取引所グループ	412,100	2,717.00	1,119,675,700
イー・ギャランティ	15,400	2,240.00	34,496,000
アサックス	7,600	680.00	5,168,000
NECキャピタルソリューション	5,900	1,792.00	10,572,800
いちご	189,400	275.00	52,085,000
日本駐車場開発	155,300	131.00	20,344,300
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	1,284.00	11,427,600
ADワークスグループ	26,600	164.00	4,362,400
ヒューリック	306,500	956.00	293,014,000
三栄建築設計	7,200	1,322.00	9,518,400
野村不動産ホールディングス	88,100	1,997.00	175,935,700
三重交通グループホールディングス	33,100	456.00	15,093,600
サムティ	21,800	1,340.00	29,212,000
ディア・ライフ	23,600	555.00	13,098,000
日本商業開発	10,300	1,627.00	16,758,100
ハウスコム	3,900	1,258.00	4,906,200

日本管理センター	9,300	1,160.00	10,788,000
サンセイランディック	6,800	716.00	4,868,800
フージャースホールディングス	28,600	617.00	17,646,200
オープンハウス	45,700	3,595.00	164,291,500
東急不動産ホールディングス	394,600	441.00	174,018,600
飯田グループホールディングス	120,700	2,068.00	249,607,600
イーランド	4,900	714.00	3,498,600
ムゲンエステート	12,700	476.00	6,045,200
ハウズドゥ	7,000	968.00	6,776,000
シーアールイー	5,000	1,409.00	7,045,000
グッドコムアセット	4,400	1,873.00	8,241,200
ジェイ・エス・ビー	3,300	2,734.00	9,022,200
テンポイノベーション	5,700	736.00	4,195,200
パーク24	78,100	1,858.00	145,109,800
パラカ	4,800	1,686.00	8,092,800
三井不動産	709,100	1,872.00	1,327,435,200
三菱地所	1,007,100	1,649.00	1,660,707,900
平和不動産	27,000	2,767.00	74,709,000
東京建物	143,300	1,248.00	178,838,400
ダイビル	38,700	1,136.00	43,963,200
京阪神ビルディング	24,200	1,484.00	35,912,800
住友不動産	323,400	3,089.00	998,982,600
テーオーシー	30,800	666.00	20,512,800
東京楽天地	2,800	4,010.00	11,228,000
スターツコーポレーション	20,400	2,162.00	44,104,800
フジ住宅	20,300	507.00	10,292,100
空港施設	18,700	415.00	7,760,500
明和地所	11,400	512.00	5,836,800
ゴールドクレスト	12,600	1,448.00	18,244,800
エスリード	7,100	1,270.00	9,017,000
日神グループホールディングス	26,100	395.00	10,309,500
日本エスコン	26,000	746.00	19,396,000
タカラレーベン	65,600	346.00	22,697,600
A V A N T I A	10,200	805.00	8,211,000
イオンモール	73,300	1,374.00	100,714,200
毎日コムネット	6,100	761.00	4,642,100
ファースト住建	8,000	970.00	7,760,000
カチタス	36,200	2,589.00	93,721,800
トーセイ	21,800	922.00	20,099,600
穴吹興産	4,400	1,472.00	6,476,800
サンフロンティア不動産	22,000	798.00	17,556,000
エフ・ジェー・ネクスト	14,800	815.00	12,062,000

インテリックス	4,000	477.00	1,908,000
ランドビジネス	4,800	375.00	1,800,000
サンネクスタグループ	6,200	911.00	5,648,200
グランディハウス	16,300	342.00	5,574,600
日本空港ビルデング	46,200	4,645.00	214,599,000
日本工営	9,400	2,764.00	25,981,600
L I F U L L	48,900	454.00	22,200,600
ミクシィ	26,600	2,262.00	60,169,200
ジェイエシーリクルートメント	9,500	1,233.00	11,713,500
日本M&Aセンター	106,400	5,210.00	554,344,000
メンバーズ	4,200	1,523.00	6,396,600
中広	2,300	537.00	1,235,100
UTグループ	21,900	2,985.00	65,371,500
アイティメディア	5,600	2,504.00	14,022,400
タケエイ	13,500	969.00	13,081,500
E・Jホールディングス	2,500	2,265.00	5,662,500
ビーネックスグループ	17,600	1,077.00	18,955,200
コシダカホールディングス	33,900	434.00	14,712,600
アルトナー	3,500	948.00	3,318,000
パソナグループ	15,200	1,368.00	20,793,600
C D S	3,600	1,267.00	4,561,200
リンクアンドモチベーション	26,100	334.00	8,717,400
G C A	18,100	621.00	11,240,100
エス・エム・エス	43,300	2,926.00	126,695,800
サニーサイドアップグループ	5,100	669.00	3,411,900
パーソルホールディングス	139,200	1,676.00	233,299,200
リニカル	6,900	788.00	5,437,200
クックパッド	44,200	361.00	15,956,200
エスクリ	4,900	351.00	1,719,900
アイ・ケイ・ケイ	7,100	524.00	3,720,400
学情	5,100	992.00	5,059,200
スタジオアリス	7,100	1,533.00	10,884,300
シミックホールディングス	7,000	1,285.00	8,995,000
エプコ	3,500	942.00	3,297,000
N J S	3,500	1,787.00	6,254,500
総合警備保障	55,400	4,960.00	274,784,000
カカクコム	102,800	2,737.00	281,363,600
アイロムグループ	5,000	1,988.00	9,940,000
セントケア・ホールディング	9,300	599.00	5,570,700
サイネックス	2,600	664.00	1,726,400
ルネサンス	7,900	923.00	7,291,700
ディップ	19,700	2,272.00	44,758,400

デジタルホールディングス	9,800	1,221.00	11,965,800
ツクイ	33,000	612.00	20,196,000
キャリアデザインセンター	3,400	858.00	2,917,200
ベネフィット・ワン	50,700	2,503.00	126,902,100
エムスリー	306,800	6,040.00	1,853,072,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,100	258.00	2,863,800
アウトソーシング	79,900	838.00	66,956,200
ウェルネット	14,300	603.00	8,622,900
ワールドホールディングス	4,900	1,738.00	8,516,200
ディー・エヌ・エー	59,000	1,685.00	99,415,000
博報堂D Yホールディングス	193,600	1,340.00	259,424,000
ぐるなび	24,500	619.00	15,165,500
タカミヤ	15,100	521.00	7,867,100
ジャパンベストレスキューシステム	11,000	919.00	10,109,000
ファンコミュニケーションズ	38,600	455.00	17,563,000
ライク	4,700	1,891.00	8,887,700
ビジネス・ブレークスルー	6,200	377.00	2,337,400
エスプール	36,000	705.00	25,380,000
WDBホールディングス	6,400	2,843.00	18,195,200
手間いらず	900	5,490.00	4,941,000
ティア	8,500	444.00	3,774,000
C D G	1,600	1,700.00	2,720,000
バリューコマース	9,400	3,485.00	32,759,000
インフォマート	141,000	710.00	100,110,000
J Pホールディングス	44,300	266.00	11,783,800
エコナックホールディングス	27,100	88.00	2,384,800
E P Sホールディングス	19,000	1,004.00	19,076,000
レッグス	3,600	942.00	3,391,200
プレステージ・インターナショナル	52,300	914.00	47,802,200
アミューズ	7,700	2,219.00	17,086,300
ドリームインキュベータ	4,400	1,366.00	6,010,400
クイック	8,800	1,196.00	10,524,800
T A C	9,300	198.00	1,841,400
ケネディクス	120,000	497.00	59,640,000
電通グループ	156,500	2,752.00	430,688,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,700	534.00	3,043,800
ぴあ	4,000	2,917.00	11,668,000
イオンファンタジー	5,500	1,723.00	9,476,500
シーティーエス	15,900	816.00	12,974,400
ネクシィーズグループ	4,500	801.00	3,604,500
H . U . グループホールディングス	39,000	2,546.00	99,294,000
アルプス技研	12,400	1,797.00	22,282,800

ダイオーズ	2,900	960.00	2,784,000
日本空調サービス	14,800	718.00	10,626,400
オリエンタルランド	147,900	14,145.00	2,092,045,500
ダスキン	34,600	2,664.00	92,174,400
明光ネットワークジャパン	17,800	744.00	13,243,200
ファルコホールディングス	7,800	1,373.00	10,709,400
ラウンドワン	39,100	836.00	32,687,600
リゾートトラスト	63,900	1,454.00	92,910,600
ビー・エム・エル	18,000	2,745.00	49,410,000
りらいあコミュニケーションズ	25,300	1,214.00	30,714,200
リソー教育	64,100	294.00	18,845,400
早稲田アカデミー	6,200	960.00	5,952,000
ユー・エス・エス	155,800	1,777.00	276,856,600
東京個別指導学院	5,300	515.00	2,729,500
サイバーエージェント	85,700	5,610.00	480,777,000
楽天	648,500	903.00	585,595,500
クリーク・アンド・リバー社	7,400	1,187.00	8,783,800
テー・オー・ダブリュー	22,700	303.00	6,878,100
山田コンサルティンググループ	9,200	1,077.00	9,908,400
セントラルスポーツ	5,300	2,219.00	11,760,700
フルキャストホールディングス	12,300	1,528.00	18,794,400
エン・ジャパン	24,800	2,954.00	73,259,200
リソルホールディングス	1,600	3,360.00	5,376,000
テクノプロ・ホールディングス	27,800	5,540.00	154,012,000
アトラ	3,200	252.00	806,400
インターワークス	3,200	330.00	1,056,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,700	12,600.00	71,820,000
Keeper 技研	5,200	2,362.00	12,282,400
ファーストロジック	2,900	755.00	2,189,500
三機サービス	2,800	1,119.00	3,133,200
Gunosy	8,800	899.00	7,911,200
デザインワン・ジャパン	4,800	288.00	1,382,400
イー・ガーディアン	6,200	3,230.00	20,026,000
リブセンス	8,300	282.00	2,340,600
ジャパンマテリアル	42,900	1,395.00	59,845,500
ベクトル	17,500	951.00	16,642,500
ウチヤマホールディングス	7,500	298.00	2,235,000
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	968.00	11,616,000
キャリアリンク	4,700	799.00	3,755,300
I B J	11,600	856.00	9,929,600
アサンテ	5,700	1,398.00	7,968,600
N・フィールド	9,800	577.00	5,654,600

バリューHR	5,600	1,375.00	7,700,000
M&Aキャピタルパートナーズ	11,300	3,940.00	44,522,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	2,364.00	12,765,600
E R Iホールディングス	4,200	579.00	2,431,800
アビスト	2,200	2,877.00	6,329,400
シグマクシス	9,600	1,353.00	12,988,800
ウィルグループ	9,300	759.00	7,058,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,200	303.00	6,423,600
リクルートホールディングス	996,600	3,965.00	3,951,519,000
エラン	9,700	2,360.00	22,892,000
土木管理総合試験所	7,300	351.00	2,562,300
ネットマーケティング	5,600	574.00	3,214,400
日本郵政	1,140,300	784.70	894,793,410
ベルシステム24ホールディングス	23,400	1,696.00	39,686,400
鎌倉新書	10,700	912.00	9,758,400
S M N	3,100	904.00	2,802,400
L I T A L I C O	4,900	2,650.00	12,985,000
グローバルキッズCOMPANY	2,800	679.00	1,901,200
エアトリ	7,300	1,241.00	9,059,300
ハイアス・アンド・カンパニー	8,700	325.00	2,827,500
アトラエ	4,300	3,395.00	14,598,500
ストライク	5,300	4,740.00	25,122,000
ソラスト	38,500	1,229.00	47,316,500
セラク	4,500	1,483.00	6,673,500
インソース	5,800	2,542.00	14,743,600
ベйкаレント・コンサルティング	8,400	10,990.00	92,316,000
Orchestra Holdings	3,000	1,582.00	4,746,000
アイモバイル	5,100	855.00	4,360,500
キャリアインデックス	6,100	460.00	2,806,000
MS - J a p a n	4,700	802.00	3,769,400
船場	3,000	904.00	2,712,000
グレイステクノロジー	6,500	4,135.00	26,877,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,700	3,665.00	53,875,500
フルテック	2,100	1,294.00	2,717,400
グリーンズ	3,900	475.00	1,852,500
GameWith	4,400	653.00	2,873,200
ソウルドアウト	3,400	1,531.00	5,205,400
MS&Consulting	2,900	615.00	1,783,500
エル・ティー・エス	1,000	3,350.00	3,350,000
ミダック	1,900	1,640.00	3,116,000
日総工産	9,500	710.00	6,745,000
キュービーネットホールディングス	5,800	1,926.00	11,170,800

R P Aホールディングス	10,800	778.00	8,402,400
スプリックス	4,100	837.00	3,431,700
マネジメントソリューションズ	6,900	1,064.00	7,341,600
プロレド・パートナーズ	1,900	5,350.00	10,165,000
and factory	1,300	885.00	1,150,500
ピアラ	800	2,130.00	1,704,000
ギークス	1,600	1,187.00	1,899,200
カーブスホールディングス	38,400	658.00	25,267,200
フォーラムエンジニアリング	7,500	749.00	5,617,500
アドバンテッジリスクマネジメント	7,300	716.00	5,226,800
リログループ	76,100	2,376.00	180,813,600
東祥	8,800	1,315.00	11,572,000
エイチ・アイ・エス	21,700	1,830.00	39,711,000
ラックランド	4,000	2,187.00	8,748,000
共立メンテナンス	23,100	3,775.00	87,202,500
イチネンホールディングス	15,700	1,194.00	18,745,800
建設技術研究所	9,100	1,796.00	16,343,600
スペース	9,200	791.00	7,277,200
長大	5,700	1,211.00	6,902,700
燦ホールディングス	6,200	1,141.00	7,074,200
スバル興業	900	7,450.00	6,705,000
東京テアトル	5,600	1,227.00	6,871,200
タナベ経営	2,800	1,342.00	3,757,600
ナガワ	4,500	6,690.00	30,105,000
よみうりランド	3,100	3,940.00	12,214,000
東京都競馬	9,100	4,845.00	44,089,500
カナモト	24,600	2,325.00	57,195,000
東京ドーム	56,500	789.00	44,578,500
西尾レントオール	12,900	2,308.00	29,773,200
トランス・コスモス	13,300	2,814.00	37,426,200
乃村工藝社	59,800	733.00	43,833,400
藤田観光	5,500	1,477.00	8,123,500
K N T - C Tホールディングス	8,600	989.00	8,505,400
日本管財	15,000	1,989.00	29,835,000
トーカイ	13,500	2,080.00	28,080,000
セコム	147,600	10,105.00	1,491,498,000
セントラル警備保障	6,700	3,440.00	23,048,000
丹青社	26,500	666.00	17,649,000
メイテック	17,100	5,060.00	86,526,000
応用地質	16,400	1,216.00	19,942,400
船井総研ホールディングス	28,800	2,103.00	60,566,400
進学会ホールディングス	5,900	424.00	2,501,600

オオバ	10,100	696.00	7,029,600	
いであ	3,500	1,802.00	6,307,000	
学究社	4,200	1,074.00	4,510,800	
ベネッセホールディングス	46,400	2,679.00	124,305,600	
イオンディライト	17,200	3,050.00	52,460,000	
ナック	7,900	926.00	7,315,400	
ダイセキ	23,400	2,500.00	58,500,000	
ステップ	5,200	1,486.00	7,727,200	
合 計	170,405,600		327,403,541,110	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,464,274,789
コール・ローン	1,436,182,181
株式	419,304,734,133
投資信託受益証券	268,886,721
投資証券	9,773,792,473
派生商品評価勘定	260,075,423
未収入金	4,337,193
未収配当金	653,041,632
差入委託証拠金	2,368,203,128
流動資産合計	437,533,527,673
資産合計	437,533,527,673
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,947,769
前受金	249,843,654
未払株式払込金	6,161,349
未払解約金	1,131,512,279
未払利息	2,789

	2020年 8月28日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,396,467,840
負債合計	1,396,467,840
純資産の部	
元本等	
元本	147,798,871,638
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	288,338,188,195
元本等合計	436,137,059,833
純資産合計	436,137,059,833
負債純資産合計	437,533,527,673

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2020年 8月28日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	147,798,871,638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 2.9509円 (1万口当たり純資産額) (29,509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 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年 8月28日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2020年 8月28日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	137,096,412,688円
期中追加設定元本額	41,741,719,338円
期中一部解約元本額	31,039,260,388円
期末元本額	147,798,871,638円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,328,439,461円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,796,494円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,869,179,936円
世界経済インデックスファンド	7,988,744,876円
外国株式インデックス・オープン	759,425,540円
D Cマイセレクション2 5	997,327,232円
D Cマイセレクション5 0	4,744,380,741円
D Cマイセレクション7 5	4,981,218,704円
D C外国株式インデックス・オープン	9,807,455,434円
D CマイセレクションS 2 5	421,281,327円
D CマイセレクションS 5 0	2,019,348,869円
D CマイセレクションS 7 5	1,478,385,589円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	82,991,423円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	184,150,774円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	126,217,290円
D C世界経済インデックスファンド	10,316,176,384円

区分	2020年 8月28日現在
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	2,073,190,396円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	8,240,554円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	8,261,727円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	37,719,995円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	37,217,310円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	129,579,355円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	28,244,806円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	134,591,779円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	546,461,889円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	304,662,109円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,055,944,817円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,640,634,576円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	62,577,881円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	288,072,610円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	7,214,536円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	99,182,548円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,657,830,069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)	1,768,821,602円
外国株式ファンド・シリーズ1	978,341,785円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,219,471,357円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,428,373,745円
分散投資コア戦略ファンドA	2,109,567,375円
分散投資コア戦略ファンドS	6,011,426,415円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,174,622,507円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,177,602,390円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,407,310,544円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	728,379,118円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,071,894円
SMT インデックスバランス・オープン	218,267,646円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,130,596,173円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	34,182,827,245円
SMT 世界経済インデックス・オープン	129,454,310円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	428,885,323円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	76,808,648円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,439,435円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	74,576,245円
グローバル経済コア	922,354,278円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,911,838円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,403,269円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	456,833,550円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	74,392,808円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	923,165円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	1,192,207円

区分	2020年 8月28日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	644,372円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	426,556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）	1,049,854,871円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,486,701,696円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	982,598,027円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	353,902,461円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	63,038,928円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	368,096,231円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	794,988,771円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	364,516,757円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	349,101,065円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	47,536,141,986
投資信託受益証券	19,622,748
投資証券	322,451,348
合計	47,838,970,586

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,586,974,633	-	6,836,818,287	249,843,654
合計		6,586,974,633	-	6,836,818,287	249,843,654

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2020年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	372,972,000	-	374,256,000	1,284,000
	アメリカドル	297,540,000	-	298,620,000	1,080,000
	ユーロ	75,432,000	-	75,636,000	204,000
合計		372,972,000	-	374,256,000	1,284,000

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	14.73	854,045.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	19.07	684,212.53	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	51.96	1,141,872.96	
	CHEVRON CORP	177,002	84.91	15,029,239.82	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	51.81	997,083.45	
	CONOCOPHILLIPS	100,048	38.15	3,816,831.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	16,913	39.77	672,630.01	
	EOG RESOURCES INC	55,564	44.95	2,497,601.80	
	EXXON MOBIL	398,806	39.74	15,848,550.44	
	HALLIBURTON CO	77,539	16.02	1,242,174.78	
	HESS CORP	24,844	46.42	1,153,258.48	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	24.96	352,185.60	
	KINDER MORGAN INC	194,644	13.86	2,697,765.84	
	MARATHON PETROLEUM CORP	62,097	34.98	2,172,153.06	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	12.07	448,545.34	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,482	13.04	1,049,485.28	
	ONEOK INC	41,832	27.04	1,131,137.28	

PHILLIPS 66	42,441	60.26	2,557,494.66
PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	105.38	1,669,640.72
SCHLUMBERGER	132,260	18.70	2,473,262.00
VALERO ENERGY CORP	39,247	53.44	2,097,359.68
WILLIAMS COS	114,214	20.96	2,393,925.44
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	21,038	292.75	6,158,874.50
ALBEMARLE CORP	10,180	91.13	927,703.40
AMCOR PLC	153,458	11.07	1,698,780.06
AVERY DENNISON CORP	7,457	116.29	867,174.53
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	23.86	420,079.16
BALL CORP	29,987	79.34	2,379,168.58
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	102.97	1,138,127.41
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	33.24	633,920.04
CORTEVA INC	70,180	29.29	2,055,572.20
CROWN HOLDINGS INC	12,992	76.97	999,994.24
DOW INC	70,834	46.16	3,269,697.44
DUPONT DE NEMOURS INC	70,752	56.58	4,003,148.16
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	14,194	73.89	1,048,794.66
ECOLAB INC	23,561	197.68	4,657,538.48
FMC CORP	12,118	109.41	1,325,830.38
FREEMONT-MCMORAN INC	138,927	14.90	2,070,012.30
INT'L PAPER CO	33,803	36.60	1,237,189.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,795	123.58	1,086,886.10
LINDE PLC	50,427	250.93	12,653,647.11
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	68.92	1,758,355.96
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	209.08	1,250,507.48
MOSAIC CO/THE	31,911	18.42	587,800.62
NEWMONT CORPORATION	74,251	64.76	4,808,494.76
NUCOR CORP	29,015	45.55	1,321,633.25
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	102.10	907,669.00
PPG INDUSTRIES INC	22,118	120.79	2,671,633.22
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	86.14	1,070,720.20
SEALED AIR CORP	14,689	40.66	597,254.74
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,930	671.80	5,327,374.00
STEEL DYNAMICS INC	18,273	29.79	544,352.67
VULCAN MATERIALS CO	12,657	124.06	1,570,227.42
WESTROCK CO	24,734	30.84	762,796.56
3 M COMPANY	54,004	164.08	8,860,976.32
AERCAP HOLDINGS NV	10,498	31.41	329,742.18
ALLEGION PLC	8,963	103.24	925,340.12
AMETEK INC	22,247	100.91	2,244,944.77
BOEING CO	50,222	174.20	8,748,672.40

CARRIER GLOBAL CORP	75,551	30.28	2,287,684.28
CATERPILLAR	51,485	143.37	7,381,404.45
CUMMINS INC	13,804	207.67	2,866,676.68
DEERE&CO	27,735	209.83	5,819,635.05
DOVER CORP	13,872	111.52	1,547,005.44
EATON CORP	37,990	102.09	3,878,399.10
EMERSON ELECTRIC CO	56,559	69.59	3,935,940.81
FASTENAL CO	55,807	48.35	2,698,268.45
FORTIVE CORP	28,503	70.84	2,019,152.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	84.86	1,087,056.60
GENERAL DYNAMICS CORP	22,742	152.44	3,466,790.48
GENERAL ELECTRIC CO	816,436	6.48	5,290,505.28
GRAINGER (WW) INC	4,461	362.47	1,616,978.67
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	40.50	616,729.13
HEICO CORP	3,640	108.25	394,030.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	87.59	564,867.91
HONEYWELL INTL INC	65,906	165.99	10,939,736.94
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	17.43	637,066.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	153.44	540,415.68
IDEX CORP	6,916	178.74	1,236,165.84
ILLINOIS TOOL WORKS	29,759	198.67	5,912,220.53
INGERSOLL-RAND INC	31,562	35.29	1,113,822.98
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	89.08	1,071,276.08
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	42.18	847,818.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	20.51	420,455.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	69,045	40.90	2,823,940.50
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	20,428	181.17	3,700,940.76
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	283.07	866,760.34
LOCKHEED MARTIN CORP	23,810	395.02	9,405,426.20
MASCO CORP	27,698	58.40	1,617,563.20
NORDSON CORP	4,880	189.12	922,905.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,837	348.99	5,177,964.63
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	63.23	2,372,326.37
OWENS CORNING	10,458	69.05	722,124.90
PACCAR INC	32,395	86.33	2,796,660.35
PARKER HANNIFIN CORP	12,505	207.79	2,598,413.95
PENTAIR PLC	14,533	45.60	662,704.80
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	142,229	60.90	8,661,746.10
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,244	232.01	2,608,720.44
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,116	428.06	4,330,254.96
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.29	570,958.12
SMITH (A.O.) CORP	12,146	49.20	597,583.20

SNAP-ON INC	4,900	147.62	723,338.00
STANLEY BLACK&DECKER	14,798	159.48	2,359,985.04
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	321.64	1,126,061.64
TEXTRON	21,534	39.32	846,716.88
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,896	118.92	2,603,872.32
TRANSDIGM GROUP INC	4,664	498.32	2,324,164.48
UNITED RENTALS INC	6,643	179.02	1,189,229.86
WABTEC CORP	17,764	66.23	1,176,509.72
XYLEM INC	17,545	81.21	1,424,829.45
CINTAS CORP	8,272	328.78	2,719,668.16
COPART INC	19,784	103.08	2,039,334.72
COSTAR GROUP INC	3,584	846.27	3,033,031.68
EQUIFAX INC	11,791	166.19	1,959,546.29
IHS MARKIT LTD	35,672	80.24	2,862,321.28
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	15.28	532,492.72
REPUBLIC SERVICES INC	21,742	92.68	2,015,048.56
ROBERT HALF INTL INC	9,566	53.99	516,468.34
ROLLINS INC	14,566	55.18	803,751.88
TRANSUNION	17,091	86.28	1,474,611.48
VERISK ANALYTICS INC	14,560	186.61	2,717,041.60
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	101.00	2,487,529.00
WASTE MANAGEMENT INC	39,501	114.27	4,513,779.27
AMERCO	1,179	354.48	417,931.92
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	98.26	1,295,656.36
CSX CORP	72,174	76.19	5,498,937.06
DELTA AIR LINES INC	12,549	30.82	386,760.18
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	87.50	1,388,450.00
FEDEX CORP	22,100	218.21	4,822,441.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	142.80	1,187,953.20
KANSAS CITY SOUTHERN	8,711	182.44	1,589,234.84
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	46.02	492,414.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,985	212.85	5,105,207.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,106	199.07	1,812,731.42
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	37.65	431,657.25
UBER TECHNOLOGIES INC	87,546	32.80	2,871,508.80
UNION PACIFIC CORP	64,130	194.44	12,469,437.20
UNITED PARCEL SERVICE B	65,801	160.21	10,541,978.21
XPO LOGISTICS INC	8,001	88.40	707,288.40
APTIV PLC	24,462	85.34	2,087,587.08
AUTOLIV INC	6,776	77.46	524,868.96
BORGWARNER INC	19,890	40.76	810,716.40
FORD MOTOR COMPANY	375,147	6.91	2,592,265.77

GENERAL MOTORS CO	119,364	29.69	3,543,917.16
LEAR CORP	5,287	114.68	606,313.16
TESLA INC	13,758	2,238.75	30,800,722.50
DR HORTON INC	32,171	72.50	2,332,397.50
GARMIN LTD	12,854	102.57	1,318,434.78
HASBRO INC	12,468	80.68	1,005,918.24
LENNAR CORP-CL A	24,928	75.80	1,889,542.40
LULULEMON ATHLETICA INC	11,527	374.84	4,320,780.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	96.96	490,811.52
NEWELL BRANDS INC	37,563	16.19	608,144.97
NIKE B	117,323	110.84	13,004,081.32
NVR INC	337	4,218.28	1,421,560.36
PULTE GROUP INC	23,283	45.75	1,065,197.25
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	68.24	312,402.72
VF CORP	32,491	66.62	2,164,550.42
WHIRLPOOL CORP	6,079	177.83	1,081,028.57
ARAMARK	24,034	26.20	629,690.80
CARNIVAL CORPORATION	40,341	16.12	650,296.92
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,444	1,279.63	3,127,415.72
DARDEN RESTAURANTS INC	13,394	85.76	1,148,669.44
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	416.32	1,549,126.72
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,491	88.80	2,263,600.80
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	50.53	1,672,543.00
MARRIOTT INTL A	26,598	101.79	2,707,410.42
MCDONALD'S CORP	70,444	212.19	14,947,512.36
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	19.05	336,461.10
MGM RESORTS INTERNATIONAL	49,467	22.81	1,128,342.27
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,686	66.60	1,244,487.60
STARBUCKS CORP	110,556	83.41	9,221,475.96
VAIL RESORTS INC	3,574	223.06	797,216.44
WYNN RESORTS LTD	9,302	86.52	804,809.04
YUM BRANDS INC	29,166	95.47	2,784,478.02
ACTIVISION BLIZZARD INC	71,494	83.90	5,998,346.60
ALPHABET INC-CL A	28,027	1,628.52	45,642,530.04
ALPHABET INC-CL C	28,718	1,634.33	46,934,688.94
ALTICE USA INC- A	29,505	27.35	806,961.75
CABLE ONE INC	401	1,868.27	749,176.27
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,769	614.29	8,458,159.01
COMCAST CORP-CL A	428,069	44.54	19,066,193.26
DISCOVERY INC - A	12,804	22.86	292,699.44
DISCOVERY INC-C	28,190	20.61	580,995.90
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	34.71	836,615.13

ELECTRONIC ARTS INC	26,822	141.77	3,802,554.94
FACEBOOK INC-A	225,016	293.22	65,979,191.52
FOX CORP - CLASS A	33,968	27.57	936,497.76
FOX CORP- CLASS B	15,092	27.64	417,142.88
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	131.09	1,025,254.89
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	18.40	622,545.60
LIBERTY BROADBAND-A	3,021	139.00	419,919.00
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	141.23	1,440,687.23
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	40.00	747,720.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	36.29	626,510.56
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	36.24	231,356.16
LIVE NATION ENTERTAINMENT	16,947	57.26	970,385.22
MATCH GROUP INC	21,635	111.53	2,412,951.55
NETFLIX INC	41,368	526.27	21,770,737.36
NEWS CORP-CLASS A	33,479	15.06	504,193.74
OMNICOM GROUP	20,835	54.96	1,145,091.60
PINTEREST INC- CLASS A	32,190	34.49	1,110,233.10
ROKU INC	8,355	160.97	1,344,904.35
SIRIUS XM HOLDINGS INC	89,917	5.90	530,510.30
SNAP INC - A	79,559	21.74	1,729,612.66
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,751	172.67	1,856,375.17
THE WALT DISNEY CO	170,184	133.73	22,758,706.32
TWITTER INC	71,690	40.39	2,895,559.10
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	28.27	1,525,901.52
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	85.24	1,054,248.32
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	154.72	957,097.92
AMAZON.COM	39,784	3,400.00	135,265,600.00
AUTOZONE INC	2,285	1,195.89	2,732,608.65
BEST BUY COMPANY INC	22,720	111.22	2,526,918.40
BOOKING HOLDINGS INC	3,859	1,893.50	7,307,016.50
BURLINGTON STORES INC	6,766	201.94	1,366,326.04
CARMAX INC	15,777	106.54	1,680,881.58
DOLLAR GENERAL CORP	23,753	201.34	4,782,429.02
DOLLAR TREE INC	22,651	96.72	2,190,804.72
EBAY	74,325	56.31	4,185,240.75
EXPEDIA GROUP INC	13,383	97.73	1,307,987.50
GENUINE PARTS CO	13,937	93.65	1,305,200.05
HOME DEPOT	102,166	288.63	29,488,172.58
LKQ CORP	29,351	31.76	932,187.76
LOWES COMPANIES	72,304	166.31	12,024,878.24
MERCADOLIBRE INC	4,280	1,201.40	5,141,992.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,237	462.58	3,347,691.46

ROSS STORES INC	34,327	90.86	3,118,951.22
TARGET (DAYTON HUDSON)	46,428	150.31	6,978,592.68
TIFFANY & CO	10,426	123.23	1,284,795.98
TJX COMPANIES INC	112,543	53.67	6,040,182.81
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	151.02	1,693,236.24
ULTA BEAUTY INC	5,362	223.95	1,200,819.90
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	331.29	1,987,740.00
COSTCO WHOLESALE CORP	41,563	346.36	14,395,760.68
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	4.27	144,753.00
KROGER CO	76,549	36.16	2,768,011.84
SYSCO CORP	45,437	60.03	2,727,583.11
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,429	39.34	2,849,356.86
WALMART INC	133,620	136.63	18,256,500.60
ALTRIA GROUP INC	172,226	43.75	7,534,887.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	44.72	2,333,892.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	72.90	2,114,829.00
BUNGE LIMITED	13,606	46.24	629,141.44
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	53.29	845,659.01
COCA-COLA CO	384,034	48.23	18,521,959.82
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16,995	41.50	705,292.50
CONAGRA BRANDS INC	45,992	38.77	1,783,109.84
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,999	182.65	2,922,217.35
GENERAL MILLS INC	57,694	64.71	3,733,378.74
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	148.70	2,066,335.20
HORMEL FOODS CORP	27,157	51.31	1,393,425.67
INGREDION INC	5,835	78.92	460,498.20
JM SMUCKER CO	10,802	120.92	1,306,177.84
KELLOGG CO	24,092	70.46	1,697,522.32
KEURIG DR PEPPER INC	31,200	29.93	933,816.00
KRAFT HEINZ CO/THE	64,187	34.76	2,231,140.12
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	62.45	807,103.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,808	205.45	2,425,953.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	37.57	683,886.71
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	131,861	58.13	7,665,079.93
MONSTER BEVERAGE CORP	37,118	83.34	3,093,414.12
PEPSICO INC	130,934	138.40	18,121,265.60
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146,196	80.00	11,695,680.00
TYSON FOODS INC	28,214	63.96	1,804,567.44
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	96.10	2,253,929.40
CLOROX COMPANY	11,988	220.69	2,645,631.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	75,547	79.06	5,972,745.82
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,244	216.41	4,597,414.04

KIMBERLY-CLARK CORP	31,739	156.20	4,957,631.80
PROCTER & GAMBLE CO	230,557	138.21	31,865,282.97
ABBOTT LABORATORIES	166,071	111.29	18,482,041.59
ABIOMED INC	4,421	311.10	1,375,373.10
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	305.64	2,174,017.32
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	98.13	1,433,090.52
ANTHEM INC	23,196	274.59	6,369,389.64
BAXTER INTERNATIONAL	47,484	86.27	4,096,444.68
BECTON DICKINSON & CO	25,005	246.57	6,165,482.85
BOSTON SCIENTIFIC CORP	133,021	40.78	5,424,596.38
CARDINAL HEALTH	27,968	50.67	1,417,138.56
CENTENE CORP	55,738	60.49	3,371,591.62
CERNER CORP	30,009	73.24	2,197,859.16
CIGNA CORP	34,360	177.08	6,084,468.80
CVS HEALTH CORP	122,285	63.39	7,751,646.15
DANAHER CORP	58,889	204.39	12,036,322.71
DAVITA INC	9,056	86.95	787,419.20
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	44.73	903,009.24
DEXCOM INC	8,490	427.75	3,631,597.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	59,721	83.70	4,998,647.70
HCA HEALTHCARE INC	25,918	134.42	3,483,897.56
HENRY SCHEIN INC	14,096	66.45	936,679.20
HOLOGIC INC	24,459	61.54	1,505,206.86
HUMANA INC	12,640	407.45	5,150,168.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,195	386.28	3,165,564.60
INSULET CORP	5,923	216.33	1,281,322.59
INTUITIVE SURGICAL INC	10,851	709.39	7,697,590.89
LABORATORY CRP OF AMER	8,614	174.26	1,501,075.64
MASIMO CORP	5,273	219.89	1,159,479.97
MCKESSON CORP	15,443	154.26	2,382,237.18
MEDTRONIC PLC	126,090	106.86	13,473,977.40
MOLINA HEALTHCARE INC	5,020	183.74	922,374.80
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	110.01	1,418,468.94
RESMED INC	13,491	180.68	2,437,553.88
STERIS PLC	8,111	156.93	1,272,859.23
STRYKER CORP	30,954	196.20	6,073,174.80
TELADOC HEALTH INC	6,315	215.77	1,362,587.55
TELEFLEX INC	4,427	380.28	1,683,499.56
THE COOPER COS INC	4,688	312.43	1,464,671.84
UNITEDHEALTH GROUP INC	88,310	311.67	27,523,577.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	111.94	811,341.12
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	172.15	1,417,999.55

VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	270.22	3,330,461.50
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,079	273.92	1,939,079.68
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,652	140.53	2,761,695.56
ABBVIE INC	166,385	94.30	15,690,105.50
AGILENT TECHNOLOGIES	29,560	99.02	2,927,031.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	106.11	2,199,235.86
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	133.05	1,418,978.25
AMGEN	55,528	252.81	14,038,033.68
AVANTOR INC	37,516	21.85	819,724.60
BEIGENE LTD-ADR	3,859	244.55	943,718.45
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	497.15	1,064,398.15
BIOGEN INC	16,218	279.26	4,529,038.68
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	75.43	1,295,208.53
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	209,587	62.51	13,101,283.37
CATALENT INC	13,739	87.71	1,205,047.69
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	28.13	1,014,395.93
EXACT SCIENCES CORP	13,278	74.00	982,572.00
GILEAD SCIENCES INC	118,620	65.55	7,775,541.00
ILLUMINA INC	14,031	351.11	4,926,424.41
INCYTE CORP	17,504	94.30	1,650,627.20
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	52.61	674,302.37
IQVIA HOLDINGS INC	17,736	158.50	2,811,156.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	130.06	646,528.26
JOHNSON & JOHNSON	246,279	152.98	37,675,761.42
LILLY (ELI) & CO	81,003	148.97	12,067,016.91
MERCK & CO	236,561	85.82	20,301,665.02
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	968.68	2,190,185.48
MODERNA INC	25,034	68.03	1,703,063.02
MYLAN NV	49,481	16.18	800,602.58
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	114.17	967,476.58
PERKINELMER INC	10,645	114.50	1,218,852.50
PERRIGO CO PLC	14,477	52.39	758,450.03
PFIZER	521,538	37.86	19,745,428.68
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,527	614.97	5,858,819.19
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	149.34	1,067,332.98
SEATTLE GENETICS INC	11,471	154.11	1,767,795.81
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	9.48	1,028,428.32
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,540	420.53	15,786,696.20
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,285	274.34	6,662,346.90
WATERS CORP	5,276	215.76	1,138,349.76
ZOETIS INC	43,948	159.61	7,014,540.28
BANK OF AMERICA CORP	740,193	26.05	19,282,027.65

CITIGROUP	197,888	51.72	10,234,767.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	26.01	1,040,660.10
COMERICA INC	14,360	40.09	575,692.40
EAST WEST BANCORP INC	13,827	37.90	524,043.30
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	20.94	1,422,684.54
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	114.84	1,822,740.48
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	9.64	954,475.68
JPMORGAN CHASE & CO	287,074	102.35	29,382,023.90
KEY CORP	94,322	12.67	1,195,059.74
M & T BANK CORP	11,721	105.87	1,240,902.27
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	10.72	393,638.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,023	112.50	4,502,587.50
REGIONS FINL CORP	92,434	11.70	1,081,477.80
SIGNATURE BANK	5,223	99.47	519,531.81
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	252.04	1,245,833.72
TRUIST FINANCIAL CORP	128,020	39.21	5,019,664.20
US BANCORP	127,646	36.94	4,715,243.24
WELLS FARGO & CO	365,686	24.59	8,992,218.74
ZIONS BANCORPORATION	15,186	33.29	505,541.94
ALLY FINANCIAL INC	36,028	23.14	833,687.92
AMERICAN EXPRESS	64,225	101.53	6,520,764.25
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	159.10	1,885,335.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	47.30	716,736.90
BANK NEW YORK CO	73,913	37.55	2,775,433.15
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	129,847	216.87	28,159,918.89
BLACKROCK INC	14,048	594.98	8,358,279.04
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,438	53.54	3,342,930.52
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,052	69.61	2,927,239.72
CARLYLE GROUP INC/THE	16,087	26.62	428,235.94
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	92.41	980,654.92
CME GROUP INC	34,191	176.45	6,033,001.95
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	53.71	1,487,981.84
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	54.51	1,150,597.08
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	21.44	862,209.60
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	353.93	1,285,827.69
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	21.35	556,594.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,708	210.15	6,453,286.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	51,389	105.01	5,396,358.89
INVESCO LTD	44,943	10.82	486,283.26
KKR & CO INC	47,403	34.82	1,650,572.46
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	496.20	1,782,846.60
MOODY'S CORP	15,637	292.16	4,568,505.92

MORGAN STANLEY	111,986	52.61	5,891,583.46
MSCI INC	7,815	369.89	2,890,690.35
NASDAQ INC	10,979	131.85	1,447,581.15
NORTHERN TRUST CORP	19,520	84.28	1,645,145.60
PRICE T ROWE GROUP INC	21,748	138.14	3,004,268.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	76.74	918,424.32
S&P GLOBAL INC	22,731	363.98	8,273,629.38
SCHWAB (CHARLES) CORP	110,150	36.08	3,974,212.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	52.89	648,484.29
STATE STREET CORP	34,742	69.25	2,405,883.50
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	25.58	1,358,170.10
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	39.05	1,010,496.85
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	57.31	519,285.91
VOYA FINANCIAL INC	12,505	52.14	652,010.70
AFLAC	62,907	36.88	2,320,010.16
ALLEGHANY CORP	1,276	561.88	716,958.88
ALLSTATE CORP	29,185	94.13	2,747,184.05
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	67.42	426,026.98
AMERICAN INT'L GROUP	83,130	29.68	2,467,298.40
AON PLC	21,468	199.58	4,284,583.44
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	32.31	1,253,498.76
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	106.00	1,890,298.00
ASSURANT INC	5,819	123.66	719,577.54
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	15,847	37.22	589,825.34
BROWN & BROWN INC	22,945	46.06	1,056,846.70
CHUBB LTD	41,989	127.76	5,364,514.64
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	80.46	1,194,911.46
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	211.47	458,044.02
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	221.88	871,100.88
FNF GROUP	24,961	33.20	828,705.20
GLOBE LIFE INC	9,867	85.09	839,583.03
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	41.49	1,430,616.69
LINCOLN NATIONAL CORP	20,790	37.01	769,437.90
LOEWS CORP	25,707	36.78	945,503.46
MARKEL CORP	1,312	1,111.62	1,458,445.44
MARSH & MCLENNAN COS	46,842	114.68	5,371,840.56
METLIFE INC	74,667	39.07	2,917,239.69
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	44.34	1,180,109.10
PROGRESSIVE CORP	55,794	93.31	5,206,138.14
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,690	69.36	2,614,178.40
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	93.96	510,296.76
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,122	185.65	950,899.30

TRAVELERS COS INC/THE	24,049	117.18	2,818,061.82
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	205.56	2,470,008.96
MR BERKLEY CORP	14,085	63.23	890,594.55
CBRE GROUP INC-A	30,111	47.35	1,425,755.85
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.90	384,930.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	104.38	468,039.92
WEYERHAEUSER CO	69,607	30.16	2,099,347.12
ACCENTURE PLC-CL A	59,753	240.87	14,392,705.11
ADOBE INC	45,456	510.32	23,197,105.92
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	15,447	114.06	1,761,884.82
ANSYS INC	8,044	332.34	2,673,342.96
AUTODESK INC	20,964	243.11	5,096,558.04
AUTOMATIC DATA PROCESS	40,135	141.01	5,659,436.35
AVALARA INC	6,485	128.88	835,786.80
BLACK KNIGHT INC	14,413	83.51	1,203,629.63
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	88.58	1,190,338.04
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	138.81	1,522,884.51
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,369	109.36	2,883,713.84
CDK GLOBAL INC	10,687	46.64	498,441.68
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	127.63	1,338,328.18
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	142.24	1,485,554.56
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	52,296	67.41	3,525,273.36
COUPA SOFTWARE INC	6,059	324.74	1,967,599.66
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,119	117.13	1,068,108.47
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	111.64	346,084.00
DATADOG INC - CLASS A	9,168	83.54	765,894.72
DOCUSIGN INC	15,817	214.77	3,397,017.09
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	20.31	491,847.27
DYNATRACE INC	14,169	42.68	604,732.92
EPAM SYSTEMS INC	5,266	323.73	1,704,762.18
FAIR ISAAC CORP	2,615	425.01	1,111,401.15
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	57,789	151.20	8,737,696.80
FISERV INC	55,147	99.00	5,459,553.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,052	248.00	1,996,896.00
FORTINET INC	13,898	132.07	1,835,508.86
GARTNER INC	8,569	130.72	1,120,139.68
GLOBAL PAYMENTS INC	27,817	174.63	4,857,682.71
GODADDY INC - CLASS A	16,351	83.32	1,362,365.32
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	109.33	866,221.59
INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,458	124.65	10,403,039.70
INTUIT INC	24,280	345.00	8,376,600.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	165.85	1,220,656.00

LEIDOS HOLDINGS	12,829	91.68	1,176,162.72
MASTERCARD INC-CLASS A	83,731	356.00	29,808,236.00
MICROSOFT CORP	676,327	226.58	153,242,171.66
MONGODB INC	4,623	227.21	1,050,391.83
NORTONLIFELOCK INC	50,376	24.17	1,217,587.92
OKTA INC	10,381	218.44	2,267,625.64
ORACLE CORP	208,169	57.18	11,903,103.42
PALO ALTO NETWORKS INC	9,363	255.37	2,391,029.31
PAYCHEX INC	30,214	76.54	2,312,579.56
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	293.00	1,393,215.00
PAYPAL HOLDINGS INC	105,027	204.34	21,461,217.18
PTC INC	9,984	89.42	892,769.28
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,050	285.70	2,014,185.00
SALESFORCE.COM INC	79,356	276.32	21,927,649.92
SERVICENOW INC	17,785	480.55	8,546,581.75
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	31,963	30.85	986,058.55
SPLUNK INC	14,752	215.39	3,177,433.28
SQUARE INC - A	33,186	155.61	5,164,073.46
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	63.74	1,387,938.50
SYNOPSYS INC	14,359	217.17	3,118,344.03
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,705	474.10	1,756,540.50
TWILIO INC - A	11,282	261.52	2,950,468.64
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	340.38	1,263,830.94
VERISIGN INC	10,096	207.87	2,098,655.52
VISA INC-CLASS A SHARES	159,051	211.03	33,564,532.53
VMWARE INC-CLASS A	7,867	142.90	1,124,194.30
WESTERN UNION CO	38,757	23.85	924,354.45
WIX.COM LTD	5,010	291.05	1,458,160.50
WORKDAY INC-CLASS A	15,669	216.63	3,394,375.47
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,002	294.68	2,947,389.36
AMPHENOL CORPORATION	27,456	108.10	2,967,993.60
APPLE INC	409,896	500.04	204,964,395.84
ARISTA NETWORKS INC	5,179	222.18	1,150,670.22
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	76.49	599,605.11
CDW CORP/DE	13,742	114.84	1,578,131.28
CISCO SYSTEMS	399,683	42.29	16,902,594.07
COGNEX CORP	16,230	66.62	1,081,242.60
CORNING	72,399	32.13	2,326,179.87
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	62.43	1,344,117.90
F5 NETWORKS INC	5,350	128.76	688,866.00
FLIR SYSTEMS INC	11,686	36.07	421,514.02
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	9.57	1,184,565.03

HP INC	126,556	18.70	2,366,597.20
IPG PHOTONICS CORP	3,207	155.31	498,079.17
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	23.87	747,226.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	95.61	1,685,030.64
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,366	151.81	2,484,522.46
NETAPP INC	20,586	43.91	903,931.26
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	45.55	1,040,179.80
TE CONNECTIVITY LTD	31,955	95.45	3,050,104.75
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	52.04	1,242,923.36
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	35.24	1,002,718.96
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	277.26	1,431,216.12
AT&T INC	676,285	29.90	20,220,921.50
CENTURYLINK INC	93,962	11.34	1,065,529.08
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	23.41	363,307.14
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,106	22.81	960,437.86
T-MOBILE US INC	51,428	115.24	5,926,562.72
VERIZON COMMUNICATIONS	387,339	59.43	23,019,556.77
AES CORP	61,761	17.91	1,106,139.51
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	54.00	1,304,424.00
AMEREN CORPORATION	23,120	78.93	1,824,861.60
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,150	78.37	3,695,145.50
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	141.37	2,392,263.14
ATMOS ENERGY CORP	11,419	98.98	1,130,252.62
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	19.76	951,681.12
CMS ENERGY CORP	26,742	59.72	1,597,032.24
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	71.07	2,256,117.15
DOMINION ENERGY INC	78,420	78.00	6,116,760.00
DTE ENERGY COMPANY	18,360	117.02	2,148,487.20
DUKE ENERGY CORP	66,920	79.55	5,323,486.00
EDISON INTL	33,630	51.75	1,740,352.50
ENERGY CORP	18,696	97.26	1,818,372.96
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	42.40	883,361.60
EVERGY INC	21,330	52.92	1,128,783.60
EVERSOURCE ENERGY	30,920	84.28	2,605,937.60
EXELON CORP	92,804	36.89	3,423,539.56
FIRSTENERGY CORP	50,559	28.10	1,420,707.90
NEXTERA ENERGY INC	45,973	278.88	12,820,950.24
NISOURCE INC	35,781	22.18	793,622.58
NRG ENERGY INC	23,078	33.73	778,420.94
OGE ENERGY CORP	19,225	31.54	606,356.50
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	73.23	788,833.56
PPL CORPORATION	69,904	27.65	1,932,845.60

	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	52.29	2,472,794.10	
	SEMPRA ENERGY	27,061	123.59	3,344,468.99	
	SOUTHERN CO	98,387	52.20	5,135,801.40	
	UGI CORP	18,019	33.80	609,042.20	
	VISTRA CORP	46,057	19.10	879,688.70	
	WEC ENERGY GROUP INC	30,120	92.35	2,781,582.00	
	XCEL ENERGY INC	50,065	68.63	3,435,960.95	
	ADVANCED MICRO DEVICES	109,297	83.80	9,159,088.60	
	ANALOG DEVICES	35,161	119.04	4,185,565.44	
	APPLIED MATERIALS	84,668	62.03	5,251,956.04	
	BROADCOM INC	37,568	339.14	12,740,811.52	
	INTEL CORP	403,460	49.40	19,930,924.00	
	KLA CORP	15,075	204.45	3,082,083.75	
	LAM RESEARCH CORP	13,850	341.45	4,729,082.50	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	61,408	35.91	2,205,161.28	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,878	70.04	1,812,495.12	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	107.41	2,453,674.04	
	MICRON TECHNOLOGY	105,648	44.62	4,714,013.76	
	NVIDIA CORP	57,334	505.13	28,961,123.42	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,742	126.05	3,244,779.10	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	21.33	767,794.68	
	QORVO INC	10,609	127.14	1,348,828.26	
	QUALCOMM	107,369	116.02	12,456,951.38	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,107	140.10	2,256,590.70	
	TERADYNE INC	16,048	84.78	1,360,549.44	
	TEXAS INSTRUMENTS	87,799	141.49	12,422,680.51	
	XILINX INC	23,543	103.72	2,441,879.96	
	アメリカドル 小計	27,736,546		2,833,078,924.10 (302,176,198,044)	
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	14.86	610,181.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,748	26.27	2,804,269.96	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	6.32	610,929.12	
	ENBRIDGE	188,432	42.57	8,021,550.24	
	IMPERIAL OIL	24,763	21.94	543,300.22	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	13.86	491,406.30	
	KEYERA CORP	18,607	24.53	456,429.71	
	PARKLAND CORP	17,004	37.60	639,350.40	
	PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	32.96	1,773,775.36	
	SUNCOR ENERGY	147,329	21.59	3,180,833.11	
	TC ENERGY CORP	86,686	62.68	5,433,478.48	
	AGNICO EAGLE MINES	23,423	104.13	2,439,036.99	
	B2GOLD CORP	90,243	8.38	756,236.34	

BARRICK GOLD CORP	170,934	37.48	6,406,606.32
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	49.38	648,803.82
FRANCO-NEVADA CORP	17,244	195.16	3,365,339.04
KINROSS GOLD CORP	125,340	11.10	1,391,274.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,848	67.95	1,824,321.60
LUNDIN MINING CORP	62,243	7.87	489,852.41
NUTRIEN LTD	55,504	49.14	2,727,466.56
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	44.64	821,867.04
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	14.92	681,500.84
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,391	67.48	2,725,584.68
YAMANA GOLD INC	81,672	7.71	629,691.12
CAE INC	25,999	20.75	539,479.25
WSP GLOBAL INC	9,471	89.08	843,676.68
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	12,370	79.28	980,693.60
THOMSON REUTERS CORP	15,191	101.51	1,542,038.41
AIR CANADA	19,591	17.19	336,769.29
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,459	140.33	9,326,191.47
CP RAILWAY LIMITED	13,160	395.38	5,203,200.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	66.01	1,846,827.78
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,923	26.86	347,111.78
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	28,808	71.62	2,063,228.96
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.22	504,944.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	24.97	1,125,822.39
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	138.96	751,634.64
DOLLARAMA INC	26,700	52.04	1,389,468.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	84,121	44.90	3,777,032.90
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	34.74	529,889.22
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	69.81	1,250,087.67
METRO INC	24,937	59.89	1,493,476.93
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	98.70	679,352.10
SAPUTO INC	24,489	33.73	826,013.97
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	22.27	619,106.00
CANOPY GROWTH CORP	25,606	21.65	554,369.90
CRONOS GROUP INC	15,900	7.09	112,731.00
BANK MONTREAL	61,534	83.67	5,148,549.78
BANK NOVA SCOTIA	112,518	57.54	6,474,285.72
CANADIAN IMPERIAL BANK	42,951	104.01	4,467,333.51
NATIONAL BANK OF CANADA	33,228	71.40	2,372,479.20
ROYAL BANK OF CANADA	133,379	101.90	13,591,320.10
TORONTO-DOMINION BANK	168,842	66.40	11,211,108.80
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	126,501	45.57	5,764,650.57
CI FINANCIAL CORP	18,671	19.05	355,682.55

	IGM FINANCIAL INC	7,685	32.48	249,608.80
	ONEX CORP	6,603	65.75	434,147.25
	TMX GROUP LTD	6,205	138.00	856,290.00
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	415.27	1,105,864.01
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	27.28	648,936.64
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	49.49	407,302.70
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	142.40	1,857,323.20
	MANULIFE FINANCIAL CORP	178,574	20.01	3,573,265.74
	POWER CORP OF CANADA	51,551	26.70	1,376,411.70
	SUN LIFE FINANCIAL INC	56,979	56.91	3,242,674.89
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.60	260,040.00
	CGI INC - CL A	23,396	92.93	2,174,190.28
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,845	1,526.13	2,815,709.85
	OPEN TEXT CORP	24,643	60.20	1,483,508.60
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,799	1,380.20	13,524,579.80
	BCE INC	15,355	57.72	886,290.60
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	56.07	1,963,459.26
	TELUS CORP	32,908	24.44	804,271.52
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.18	942,051.24
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	17.59	429,108.05
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	40.48	212,155.68
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.32	343,995.68
	EMERA INC	23,704	53.46	1,267,215.84
	FORTIS INC	42,633	52.78	2,250,169.74
	HYDRO ONE LTD	32,299	27.45	886,607.55
	カナダドル 小計	3,580,602		179,496,820.57 (14,576,936,798)
ユーロ	ENI	248,488	7.98	1,984,425.16
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	9.10	447,960.56
	NESTE OIL OYJ	40,117	44.31	1,777,584.27
	OMV AG	14,984	27.54	412,659.36
	REPSOL SA	140,401	6.88	966,239.68
	TENARIS SA	40,648	4.89	199,012.60
	TOTAL SE	231,499	33.28	7,704,286.72
	VOPAK	6,360	46.50	295,740.00
	AIR LIQUIDE	44,090	140.00	6,172,600.00
	AKZO NOBEL	19,521	84.18	1,643,277.78
	ARCELORMITTAL	66,229	10.18	674,476.13
	ARKEMA	5,949	93.36	555,398.64
	BASF SE	85,260	51.79	4,415,615.40
	COVESTRO AG	15,098	40.12	605,731.76
	CRH PLC	72,257	32.17	2,324,507.69

EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	24.56	485,158.24
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	39.40	227,022.80
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	53.04	786,742.32
KONINKLIJKE DSM NV	15,650	134.45	2,104,142.50
LANXESS	7,293	50.50	368,296.50
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	30.60	598,689.00
SOLVAY SA	6,906	73.28	506,071.68
STORA ENSO OYJ R	54,792	12.15	665,722.80
SYMRISE AG	12,476	115.85	1,445,344.60
THYSSEN KRUPP	33,044	6.14	203,154.51
UMICORE	17,605	38.66	680,609.30
UPM KYMMENE OYJ	50,623	25.55	1,293,417.65
VOESTALPINE AG	12,422	20.62	256,141.64
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,394	21.25	497,122.50
AIRBUS SE	56,107	72.11	4,045,875.77
ALSTOM	18,760	47.65	893,914.00
ANDRITZ AG	5,242	28.52	149,501.84
BOUYGUES ORD	19,381	33.93	657,597.33
BRENTAG AG	15,254	52.58	802,055.32
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	6.61	615,273.96
DASSAULT AVIATION SA	213	782.50	166,672.50
EIFFAGE	7,209	79.80	575,278.20
FERROVIAL SA	46,711	23.08	1,078,089.88
GEA GROUP AG	13,382	30.58	409,221.56
HOCHTIEF AG	2,222	77.65	172,538.30
KINGSPAN GROUP PLC	15,306	72.00	1,102,032.00
KION GROUP AG	5,887	70.18	413,149.66
KNORR-BREMSE AG	4,123	106.26	438,109.98
KONE OYJ-B	32,286	72.78	2,349,775.08
LEGRAND SA	24,584	70.92	1,743,497.28
LEONARDO SPA	35,425	5.89	208,865.80
MTU AERO ENGINES AG	4,753	160.45	762,618.85
PRYSMIAN SPA	21,155	23.37	494,392.35
SAFRAN SA	29,413	100.95	2,969,242.35
SAINT-GOBAIN	46,472	34.16	1,587,483.52
SCHNEIDER ELECTRIC SE	51,442	105.55	5,429,703.10
SIEMENS	71,400	119.20	8,510,880.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	22.20	557,264.40
THALES SA	9,665	67.94	656,640.10
VINCI S.A.	49,409	81.34	4,018,928.06
WARTSILA OYJ	34,386	7.06	242,765.16
BUREAU VERITAS SA	25,073	19.08	478,392.84

RANDSTAD NV	12,365	44.78	553,704.70
TELEPERFORMANCE	5,732	259.60	1,488,027.20
WOLTERS KLUWER	25,709	69.82	1,795,002.38
ADP	2,382	89.35	212,831.70
AENA SME SA	6,542	124.20	812,516.40
ATLANTIA SPA	51,427	13.85	712,263.95
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.98	209,075.64
DEUTSCHE POST AG-REG	91,113	39.47	3,596,230.11
FRAPORT AG	3,561	36.96	131,614.56
GETLINK	44,101	12.96	571,548.96
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,973	59.60	1,905,590.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	46.94	234,277.54
CONTINENTAL AG	9,928	91.30	906,426.40
DAIMLER AG	78,738	43.00	3,385,734.00
FAURECIA	5,945	37.02	220,083.90
FERRARI NV	11,392	165.35	1,883,667.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	111,379	9.45	1,052,531.55
MICHELIN	16,459	96.44	1,587,305.96
PEUGEOT SA	52,883	14.64	774,471.53
PIRELLI & C SPA	39,097	3.71	145,049.87
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	52.44	735,628.32
RENAULT SA	17,362	24.27	421,375.74
VALEO SA	19,350	25.87	500,584.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,999	140.12	2,522,019.88
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	152.80	496,752.80
ADIDAS AG	17,675	255.60	4,517,730.00
ESSILORLUXOTTICA	27,287	113.05	3,084,795.35
HERMES INTERNATIONAL	3,057	719.80	2,200,428.60
KERING	7,275	521.10	3,791,002.50
LVMH	26,074	401.00	10,455,674.00
MONCLER SPA	20,700	32.62	675,234.00
PUMA SE	7,720	70.12	541,326.40
SEB SA	2,075	146.10	303,157.50
ACCOR	17,931	25.82	462,978.42
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,877	139.60	1,658,029.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,540	31.14	328,215.60
SODEXO	8,135	62.80	510,878.00
BOLLORE	61,805	3.20	198,146.83
JC DECAUX SA	9,522	16.54	157,493.88
PUBLICIS GROUPE	21,469	30.44	653,516.36
SCOUT24 AG	9,470	78.75	745,762.50
SES	31,369	6.15	193,107.56

TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	33.14	165,633.72
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	69.30	645,252.30
VIVENDI	77,307	24.02	1,856,914.14
DELIVERY HERO SE	11,471	90.82	1,041,796.22
INDITEX	101,980	24.01	2,448,539.80
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	96.00	1,091,712.00
PROSUS	45,138	88.02	3,973,046.76
ZALANDO SE	13,985	73.80	1,032,093.00
CARREFOUR	59,235	13.44	796,414.57
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,810	22.51	130,783.10
COLRUYT SA	5,424	54.14	293,655.36
JERONIMO MARTINS	24,901	14.04	349,734.54
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	25.98	2,682,798.72
METRO AG	13,712	8.45	115,921.24
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,855	50.20	3,657,321.00
DANONE (GROUPE)	59,282	56.24	3,334,019.68
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	8.60	422,307.58
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	69.65	745,324.65
HEINEKEN NV	24,387	79.04	1,927,548.48
KERRY GROUP PLC-A	14,641	110.90	1,623,686.90
PERNOD-RICARD	19,514	146.95	2,867,582.30
REMY COINTREAU	2,382	138.90	330,859.80
BEIERSDORF AG	9,190	97.34	894,554.60
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	76.80	782,592.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,238	87.64	1,510,738.32
LOREAL	23,414	280.60	6,569,968.40
UNILEVER NV	136,472	50.02	6,826,329.44
BIOMERIEUX	4,175	123.70	516,447.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	94.80	325,164.00
DIASORIN SPA	2,070	153.20	317,124.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	72.86	1,456,107.10
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,407	39.42	1,592,843.94
KONINKLIJKE PHILIPS	84,867	41.94	3,559,746.31
ORPEA	5,633	101.65	572,594.45
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	348.00	1,129,608.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,846	38.11	565,855.29
BAYER	91,418	56.54	5,168,773.72
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	668.00	773,544.00
GALAPAGOS NV	4,368	111.40	486,595.20
GRIFOLS SA	27,685	22.99	636,478.15
IPSEN	2,722	87.15	237,222.30
MERCK KGAA	12,078	113.80	1,374,476.40

ORION OYJ-CLASS B	9,854	39.47	388,937.38
QIAGEN N.V.	21,801	42.89	935,044.89
RECORDATI SPA	11,472	45.40	520,828.80
SANOFI	105,868	86.15	9,120,528.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	297.20	718,926.80
UCB (GROUPE)	12,416	98.96	1,228,687.36
ABN AMRO BANK NV-CVA	29,696	8.16	242,319.36
BANCO BILBAO VIZCAYA	647,435	2.53	1,640,600.29
BANCO SANTANDER SA	1,599,817	1.89	3,039,012.37
BANKINTER SA	58,881	4.52	266,201.00
BNP PARIBAS	104,161	36.49	3,800,834.89
CAIXABANK	328,697	1.85	609,075.54
COMMERZBANK AG	75,494	4.83	365,315.46
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	8.61	925,901.20
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	20.30	559,468.00
FINECOBANK SPA	53,120	12.86	683,123.20
ING GROEP NV-CVA	377,830	6.94	2,625,162.84
INTESA SANPAOLO	1,460,677	1.80	2,634,769.17
KBC GROEP NV	24,002	47.91	1,149,935.82
MEDIOBANCA	53,990	7.51	405,572.88
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	15.28	190,847.20
SOCIETE GENERALE	79,076	13.73	1,085,713.48
UNICREDIT SPA	190,988	8.16	1,559,417.02
AMUNDI SA	6,226	65.65	408,736.90
DEUTSCHE BANK NAMEN	190,535	8.28	1,577,820.33
DEUTSCHE BOERSE	18,261	158.90	2,901,672.90
EURAZEO SA	3,357	44.82	150,460.74
EXOR NV	10,345	50.74	524,905.30
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,222	78.94	649,044.68
NATIXIS	114,996	2.41	277,370.35
SOFINA	1,781	249.50	444,359.50
WENDEL	2,023	88.55	179,136.65
AEGON	166,267	2.36	393,055.18
AGEAS	16,065	36.21	581,713.65
ALLIANZ SE-REG	38,899	184.06	7,159,749.94
ASSICURAZIONI GENERALI	109,307	13.30	1,453,783.10
AXA SA	185,927	17.38	3,232,898.67
CNP ASSURANCES	21,830	11.27	246,024.10
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	143.80	832,458.20
MAPFRE SA	90,939	1.60	145,684.27
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,866	241.30	3,345,865.80
NN GROUP NV	27,631	31.84	879,771.04

POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.84	361,098.54
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	34.13	1,470,149.75
SCOR SE	13,354	22.72	303,402.88
AROUNDTOWN SA	111,346	4.62	515,420.63
DEUTSCHE WOHNEN SE	33,768	44.61	1,506,390.48
LEG IMMOBILIEN AG	5,781	122.60	708,750.60
VONOVIA SE	49,525	59.40	2,941,785.00
ADYEN NV	1,648	1,457.50	2,401,960.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	48.57	2,034,305.88
ATOS SE	9,750	73.80	719,550.00
CAPGEMINI SA	15,470	117.00	1,809,990.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	158.95	1,989,259.25
EDENRED	22,756	43.05	979,645.80
NEMETSCHKE SE	6,575	66.70	438,552.50
NEXI SPA	36,670	14.85	544,732.85
SAP SE	98,157	140.36	13,777,316.52
TEAMVIEWER AG	14,027	45.34	635,984.18
WORLDLINE SA	12,702	77.04	978,562.08
INGENICO GROUP	6,281	143.25	899,753.25
NOKIA OYJ	545,632	4.24	2,313,479.68
ALTICE NV -A	50,000	3.88	194,350.00
CELLNEX TELECOM SA	24,602	53.78	1,323,095.56
DEUTSCHE TELEKOM	309,728	15.14	4,689,281.92
ELISA A	11,943	50.42	602,166.06
ILIAD SA	1,253	176.95	221,718.35
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	8.38	254,542.50
KPN (KON.)	354,332	2.26	802,561.98
ORANGE	188,105	9.65	1,816,718.09
PROXIMUS	13,141	17.01	223,528.41
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.40	342,470.13
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.40	188,199.84
TELEFONICA	456,457	3.43	1,567,929.79
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	125,107	2.37	297,629.55
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	41.45	394,313.85
E.ON SE	216,142	10.00	2,161,420.00
ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	8.90	545,739.10
ELIA GROUP SA/NV	3,630	88.90	322,707.00
ENAGAS	25,299	20.70	523,689.30
ENDESA	31,750	23.32	740,410.00
ENEL	759,109	7.61	5,782,133.25
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	4.27	1,008,999.90
ENGIE	171,054	11.17	1,910,673.18

	FORTUM OYJ	41,901	17.06	714,831.06
	IBERDROLA SA	554,209	10.76	5,963,288.84
	NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	16.05	484,620.17
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.98	633,319.36
	RWE STAMM	56,470	32.97	1,861,815.90
	SNAM SPA	203,694	4.36	889,124.31
	SUEZ	28,043	12.28	344,368.04
	TERNA SPA	130,230	6.16	802,998.18
	UNIPER SE	20,192	27.10	547,203.20
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	19.05	1,003,569.68
	VERBUND AG	7,463	45.00	335,835.00
	ASML HOLDING NV	40,029	319.70	12,797,271.30
	INFINEON TECHNOLOGIES	115,347	23.35	2,693,352.45
	STMICROELECTRONICS	56,957	25.58	1,456,960.06
	ユーロ 小計	17,720,815		359,842,071.88 (45,361,691,581)
イギリスポンド	BP PLC	1,887,419	2.67	5,044,127.27
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	383,729	11.11	4,263,229.19
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	345,955	10.70	3,702,410.41
	ANGLO AMERICAN PLC	112,174	18.03	2,023,394.61
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	10.65	381,866.40
	BHP GROUP PLC	195,828	17.02	3,334,559.18
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,371	59.96	681,805.16
	EVRAZ PLC	43,000	3.18	136,869.00
	GLENCORE PLC	901,837	1.67	1,512,921.75
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	23.74	399,971.52
	MONDI PLC	47,780	14.84	709,294.10
	RIO TINTO PLC REG	104,428	46.09	4,813,608.66
	ASHTED GROUP PLC	42,021	26.35	1,107,253.35
	BAE SYSTEMS PLC	308,746	5.27	1,627,708.91
	BUNZL PLC	33,283	24.75	823,754.25
	DCC PLC	9,127	67.46	615,707.42
	FERGUSON PLC	20,559	74.34	1,528,356.06
	MELROSE INDUSTRIES PLC	508,486	1.05	536,452.73
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,244	2.50	513,110.00
	SMITHS GROUP PLC	37,146	14.30	531,373.53
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	104.05	754,882.75
	EXPERIAN PLC	87,481	28.05	2,453,842.05
	INTERTEK GROUP PLC	15,404	59.50	916,538.00
	RELX PLC	185,932	17.19	3,197,100.74
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	5.33	966,168.17
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.16	498,165.91

BURBERRY GROUP PLC	40,410	14.48	585,136.80
PERSIMMON PLC	31,506	26.12	822,936.72
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.20	427,476.73
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	45.43	481,512.57
COMPASS GROUP PLC	162,339	12.13	1,969,983.76
GVC HOLDINGS PLC	59,240	8.19	485,649.52
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	44.30	710,616.30
WHITBREAD PLC	17,434	24.57	428,353.38
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.66	551,615.42
INFORMA PLC	158,400	4.14	656,251.20
ITV PLC	295,435	0.61	181,928.87
PEARSON	66,305	5.71	378,601.55
WPP PLC	113,065	6.64	751,203.86
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	7.22	231,296.00
KINGFISHER PLC	170,994	2.76	472,627.41
NEXT PLC	13,238	61.28	811,224.64
OCADO GROUP PLC	44,612	25.20	1,124,222.40
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.94	407,951.59
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.85	275,383.92
TESCO	919,600	2.21	2,040,592.40
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	36,715	20.58	755,594.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO	213,713	25.50	5,450,750.06
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.09	360,816.40
DIAGEO	217,858	25.41	5,535,771.78
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	12.76	1,166,925.24
RECKITT BENCKISER PLC	66,097	76.12	5,031,303.64
UNILEVER PLC	108,846	45.65	4,968,819.90
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	15.20	1,262,375.20
ASTRAZENECA	123,279	84.17	10,376,393.43
GLAXOSMITHKLINE	470,077	14.94	7,022,950.38
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	23.56	387,656.24
BARCLAYS	1,669,454	1.10	1,845,414.45
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,902,680	3.28	6,241,741.74
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.28	1,871,664.45
NATWEST GROUP PLC	479,086	1.12	536,815.86
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	3.84	979,297.44
3I GROUP PLC	88,121	9.27	817,410.39
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	16.19	535,549.01
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	30,265	89.04	2,694,795.60
M&G PLC	229,107	1.74	400,020.82
SCHRODERS PLC	11,794	28.95	341,436.30
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.82	439,534.50

	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.36	552,518.33
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	26.44	429,782.20
	AVIVA PIC	381,270	2.83	1,082,044.26
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.95	335,572.96
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.19	1,204,889.82
	PRUDENTIAL	246,816	11.99	2,959,323.84
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	4.51	390,286.38
	AVEVA GROUP PLC	6,717	51.14	343,507.38
	SAGE GROUP PLC	111,321	7.47	831,790.51
	HALMA PLC	37,159	22.47	834,962.73
	BT GROUP PLC	817,227	1.05	865,034.77
	VODAFONE GROUP PLC	2,475,816	1.13	2,814,507.62
	NATIONAL GRID PLC	334,044	8.52	2,848,727.23
	SEVERN TRENT PLC	25,000	23.48	587,000.00
	SSE PLC	100,354	12.78	1,282,524.12
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.33	559,913.37
	イギリスポンド 小計	27,215,178		133,814,459.21 (18,838,399,567)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.90	328,909.19
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	815.50	663,001.50
	GIVAUDAN-REG	849	3,798.00	3,224,502.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,484	43.08	2,045,610.72
	SIKA AG-BR	12,290	214.20	2,632,518.00
	ABB LTD	176,891	23.37	4,133,942.67
	GEBERIT AG-REG	3,423	526.40	1,801,867.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	239.00	504,768.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	240.80	907,334.40
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	48.13	636,471.12
	SGS SA	586	2,389.00	1,399,954.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	174.75	885,458.25
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	47,970	59.82	2,869,565.40
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	194.00	481,702.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	36.86	145,154.68
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,022.00	566,160.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	81,300.00	813,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,785.00	809,640.00
	NESTLE SA - REGISTERED	278,934	110.18	30,732,948.12
	ALCON INC	44,953	52.74	2,370,821.22
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	213.70	1,097,990.60
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	885.60	897,998.40
	LONZA GROUP AG-REG	6,876	559.20	3,845,059.20
	NOVARTIS	202,202	78.95	15,963,847.90

	ROCHE HOLDING GENUSS	66,209	316.70	20,968,390.30
	VIFOR PHARMA AG	4,486	134.40	602,918.40
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,550	95.80	340,090.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	220,884	10.15	2,243,077.02
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	42.82	906,799.14
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,811	919.80	1,665,757.80
	UBS GROUP AG	338,963	11.19	3,794,690.78
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	145.10	697,205.50
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	370.80	1,056,409.20
	SWISS RE LTD	28,362	73.34	2,080,069.08
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,901	338.60	4,706,878.60
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	82.35	614,166.30
	TEMENOS AG - REG	6,511	142.25	926,189.75
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	66.68	979,262.48
	SWISSCOM	2,441	511.20	1,247,839.20
	スイスフラン 小計	1,615,900		122,587,968.12 (14,379,568,660)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	211.40	3,640,730.80
	BOLIDEN AB	23,903	254.30	6,078,532.90
	SCA SV CELLULOSA B	64,571	113.55	7,332,037.05
	ALFA LAVAL AB	27,268	221.00	6,026,228.00
	ASSA ABLOY AB-B	90,383	201.60	18,221,212.80
	ATLAS COPCO A	63,684	401.50	25,569,126.00
	ATLAS COPCO B	36,538	351.80	12,854,068.40
	EPIROC AB-A	58,039	131.95	7,658,246.05
	EPIROC AB-B	29,972	127.45	3,819,931.40
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	18,468	193.10	3,566,170.80
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	33,536	247.10	8,286,745.60
	SANDVIK AB	101,932	172.65	17,598,559.80
	SKANSKA B	28,530	177.95	5,076,913.50
	SKF AB-B	35,405	173.50	6,142,767.50
	VOLVO B	134,889	165.65	22,344,362.85
	SECURITAS B	35,993	126.95	4,569,311.35
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	188.40	3,423,228.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	94.96	3,676,091.52
	EVOLUTION GAMING GROUP	11,183	648.00	7,246,584.00
	HENNES & MAURITZ B	77,319	142.20	10,994,761.80
	ICA GRUPPEN AB	7,959	430.00	3,422,370.00
	SWEDISH MATCH AB	16,014	677.40	10,847,883.60
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	305.50	17,439,467.50
	NORDEA BANK ABP	309,938	70.00	21,695,660.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	86.54	13,475,143.40

	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	88.44	13,300,137.84	
	SWEDBANK AB-A	86,716	147.84	12,820,093.44	
	EQT AB	20,102	160.70	3,230,391.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	232.70	3,907,498.40	
	INVESTOR AB-B SHS	43,938	561.00	24,649,218.00	
	KINNEVIK AB - B	23,604	333.55	7,873,114.20	
	KINNEVIK AB -B - REDEMPTION	23,604	6.99	165,086.37	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	435.00	3,166,800.00	
	ERICSSON (LM) B	263,755	104.40	27,536,022.00	
	HEXAGON AB-B SHS	26,504	625.00	16,565,000.00	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	127.15	6,359,025.80	
	TELIA CO AB	257,822	33.94	8,750,478.68	
	スウェーデンクローナ 小計	2,462,938		379,329,000.75 (4,635,400,389)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	92,158	143.90	13,261,536.20	
	NORSK HYDRO	106,150	27.57	2,926,555.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	372.20	6,874,534.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	353.60	2,464,945.60	
	MOWI ASA	40,968	171.00	7,005,528.00	
	ORKLA	69,804	90.80	6,338,203.20	
	DNB ASA	85,517	142.25	12,164,793.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	192.70	3,579,209.80	
	TELENOR ASA	71,821	147.60	10,600,779.60	
	ノルウェークローネ 小計	510,433		65,216,085.15 (779,332,217)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	714.00	7,387,758.00	
	NOVOZYMES A/S	19,125	368.40	7,045,650.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,951	943.60	16,938,563.60	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,755.00	2,617,745.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	9,446.00	6,130,454.00	
	DSV PANALPINA A S	20,416	973.80	19,881,100.80	
	PANDORA A/S	8,431	453.10	3,820,086.10	
	CARLSBERG AS-B	10,388	888.20	9,226,621.60	
	AMBU A/S-B	18,085	187.20	3,385,512.00	
	COLOPLAST-B	11,223	1,043.00	11,705,589.00	
	DEMANT A/S	11,604	187.00	2,169,948.00	
	GN STORE NORD A/S	11,117	448.50	4,985,974.50	
	GENMAB A/S	6,320	2,333.00	14,744,560.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	210.30	1,024,371.30	
	NOVO NORDISK A/S-B	166,015	418.15	69,419,172.25	
DANSKE BANK A/S	57,713	98.20	5,667,416.60		
TRYG A/S	9,828	195.50	1,921,374.00		

	ORSTED A/S	17,372	894.40	15,537,516.80
	デンマーククローネ 小計	401,754		203,609,413.55 (3,449,143,465)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	26.97	556,364.13
	OIL SEARCH LTD	222,327	3.16	702,553.32
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.46	904,148.70
	SANTOS	156,437	5.62	879,175.94
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.73	265,613.49
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	19.27	1,750,274.83
	BHP GROUP LTD	274,547	38.44	10,553,586.68
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.80	631,398.40
	EVOLUTION MINING LTD	174,295	5.60	976,052.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	19.30	2,987,176.80
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	32.15	1,389,780.20
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	32.16	2,382,991.68
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	64,628	13.71	886,049.88
	ORICA LTD	44,211	17.57	776,787.27
	RIO TINTO LTD	35,522	100.12	3,556,462.64
	SOUTH32 LTD	481,840	2.12	1,021,500.80
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	21.83	201,272.60
	BRAMBLES LTD	137,883	11.23	1,548,426.09
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.37	836,815.67
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	3.83	325,550.00
	TRANSURBAN GROUP	262,342	13.46	3,531,123.32
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	29.24	1,542,468.48
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.25	280,534.00
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	3.66	610,656.36
	TABCORP HOLDINGS LTD-RIGHTS	15,167	0.41	6,218.47
	REA GROUP LTD	5,276	119.63	631,167.88
	SEEK LTD	26,358	20.96	552,463.68
	WESFARMERS LTD	109,322	49.34	5,393,947.48
	COLES GROUP LTD	128,408	18.60	2,388,388.80
	WOOLWORTHS GROUP LTD	120,802	40.38	4,877,984.76
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.24	426,241.20
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	9.35	659,530.30
COCHLEAR LIMITED	6,220	198.90	1,237,158.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	65.27	1,060,506.96	
SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	32.93	1,319,702.68	
CSL LIMITED	42,501	293.55	12,476,168.55	
AUST AND NZ BANKING GROUP	271,505	18.33	4,976,686.65	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	165,125	69.07	11,405,183.75	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	295,326	17.80	5,256,802.80	

	WESTPAC BANKING	334,568	17.40	5,821,483.20	
	AMP LTD	343,649	1.49	513,755.25	
	ASX LTD	16,798	89.94	1,510,812.12	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	30,997	128.91	3,995,823.27	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	61.41	670,105.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	4.94	1,034,213.70	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.85	769,101.00	
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	10.49	1,333,908.40	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	9.38	1,119,540.52	
	AFTERPAY LTD	18,973	91.26	1,731,475.98	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	13.63	604,844.88	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	28.43	511,740.00	
	TELSTRA CORP	403,126	2.95	1,189,221.70	
	TPG TELECOM LTD	31,475	8.26	259,983.50	
	AGL ENERGY LTD	64,235	14.84	953,247.40	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.83	343,411.07	
	オーストラリアドル 小計	6,589,950		114,127,583.15	(8,838,040,039)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	136,010	6.51	885,425.10	
	A2 MILK CO LTD	66,854	20.11	1,344,433.94	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	36.99	2,016,694.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.50	490,279.50	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.93	980,734.76	
	MERCURY NZ LTD	85,000	5.31	451,350.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.17	572,065.20	
	ニュージーランドドル 小計	688,177		6,740,983.30	(477,531,256)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	50.55	12,965,872.80	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	6.50	1,059,500.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	97.85	13,160,825.00	
	MTR CORP	151,000	40.55	6,123,050.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	211,000	60.00	12,660,000.00	
	SANDS CHINA LTD	242,800	33.30	8,085,240.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	10.60	1,399,200.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	14.54	2,047,232.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	26.80	3,910,120.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.66	6,237,090.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	17.40	1,899,384.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	22.15	7,985,075.00	
	HANG SENG BANK	74,200	120.00	8,904,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,400	379.40	42,265,160.00	
AIA GROUP LTD	1,134,400	77.50	87,916,000.00		

	CK ASSET HOLDINGS LTD	257,996	41.90	10,810,032.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	21.70	3,754,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	30.55	3,825,715.40	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	19.66	1,268,070.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	155,375	40.05	6,222,768.75	
	SINO LAND CO	315,400	9.09	2,866,986.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	101.50	12,027,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	41.70	1,688,850.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.90	2,010,580.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	143,000	32.30	4,618,900.00	
	PCCW LTD	357,000	4.87	1,738,590.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	40.80	2,754,000.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	75.25	11,814,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	11.04	11,377,592.16	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	44.15	6,070,625.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	82.30	1,950,510.00	
	香港ドル 小計	7,566,634		301,417,068.51 (4,147,498,862)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	116,500	4.57	532,405.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,500	3.46	378,870.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.91	182,908.50	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	3.63	393,245.16	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.70	433,575.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	19.13	189,387.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.43	791,198.00	
	DBS GROUP	174,800	20.46	3,576,408.00	
	OCBC BANK	315,600	8.61	2,717,316.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	105,200	19.48	2,049,296.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	8.63	675,729.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	2.75	614,625.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.89	337,692.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.57	312,075.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	20.00	514,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.29	1,722,636.47	
	シンガポールドル 小計	3,103,375		15,421,366.13 (1,204,100,267)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	12.66	857,790.96	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	457.30	981,365.80	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	20.60	2,025,186.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	17.48	2,458,649.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	10.98	1,092,510.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	68.90	861,456.70	

	AZRIELI GROUP	4,323	182.20	787,650.60	
	NICE LTD	6,172	791.20	4,883,286.40	
	イスラエルシェケル 小計	431,365		13,947,895.86 (440,892,988)	
	合 計	99,623,667		419,304,734,133 (419,304,734,133)	

(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	1,192,183.46	
		LENDLEASE GROUP	55,692	622,079.64	
		SYDNEY AIRPORT	107,308	603,070.96	
		オーストラリアドル 小計	277,413	2,417,334.06 (187,198,349)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,744,155.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,192,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	5,936,655.00 (81,688,372)	
投資信託受益証券合計			872,913	268,886,721 (268,886,721)	
投資証券	アメリカド ル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	651,803.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,175	1,905,561.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	41,635	10,324,230.95	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	927,419.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,114,515.25	
		BOSTON PROPERTIES	14,788	1,308,442.24	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	788,019.96	
		CROWN CASTLE INTL CORP	38,704	6,325,007.68	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,856,486.70	
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,364,457.60	
		EQUINIX INC	8,137	6,425,382.05	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,091,401.96	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,009,062.51	
		ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,369,164.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,313,195.31	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	590,792.37	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,101	1,321,183.05	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	767,142.97	
		INVITATION HOMES INC	51,458	1,483,019.56	
		IRON MOUNTAIN INC	27,546	838,775.70	

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	934,672.48
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,270,287.70
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	595,995.55
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	656,683.23
	PROLOGIS INC	68,838	7,014,592.20
	PUBLIC STORAGE	15,009	3,170,951.43
	REALTY INCOME CORP	30,398	1,899,875.00
	REGENCY CENTERS CORP	17,800	723,570.00
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,751	3,289,053.43
	SIMON PROPERTY GROUP	27,990	1,891,284.30
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,345,699.25
	UDR INC	28,059	980,100.87
	VENTAS INC	33,353	1,390,820.10
	VEREIT INC	105,798	726,832.26
	VICI PROPERTIES INC	44,224	1,023,343.36
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	567,583.20
	WELLTOWER INC	38,031	2,202,755.52
	WP CAREY INC	16,500	1,175,460.00
	アメリカドル 小計	1,199,698	77,634,624.74 (8,280,509,074)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	416,444.82
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	176,753.70
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	241,644.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	117,237.42
	カナダドル 小計	42,473	952,079.94 (77,318,411)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	316,823.70
	GECINA SA	4,459	517,689.90
	ICADE	2,845	159,462.25
	KLEPIERRE	17,225	241,322.25
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	556,838.70
	ユーロ 小計	43,186	1,792,136.80 (225,916,765)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	288,669.89
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	340,878.10
	SEGRO PLC	106,999	1,019,700.47
	イギリスポンド 小計	244,963	1,649,248.46 (232,181,198)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	812,937.60
	GOODMAN GROUP	162,271	2,987,409.11
	GPT GROUP	167,884	621,170.80
	MIRVAC GROUP	392,919	817,271.52
	SCENTRE GROUP	486,663	1,002,525.78

	STOCKLAND	207,412	800,610.32	
	VICINITY CENTERS	291,115	385,727.37	
	オーストラリアドル 小計	1,802,354	7,427,652.50	(575,197,409)
香港ドル	LINK REIT	199,000	12,099,200.00	
	香港ドル 小計	199,000	12,099,200.00	(166,484,992)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	904,200.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	388,800.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	372,558.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	422,400.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	215,000	438,600.00	
	SUNTEC REIT	173,000	242,200.00	
	シンガポールドル 小計	1,325,300	2,768,758.00	(216,184,624)
	投資証券合計	4,856,974	9,773,792,473	(9,773,792,473)
	合計		10,042,679,194	(10,042,679,194)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 590銘柄	97.3%			70.4%
	投資証券 38銘柄			2.7%	1.9%
カナダドル	株式 80銘柄	99.5%			3.4%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.5%			10.6%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 84銘柄	98.8%			4.4%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデンクローナ	株式 37銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%

オーストラリアドル	株式	55銘柄	92.1%			2.1%
	投資信託受 益証券	3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券	7銘柄			6.0%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	31銘柄	94.4%			1.0%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	84.8%			0.3%
	投資証券	6銘柄			15.2%	0.1%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,233,149,693
コール・ローン	263,744,053
株式	72,540,693,889
新株予約権証券	548,184
投資信託受益証券	168,572,837
投資証券	50,178,226
派生商品評価勘定	433,943,656
未収入金	4,632,678
未収配当金	100,440,272
差入委託証拠金	1,155,223,437
流動資産合計	77,951,126,925
資産合計	77,951,126,925
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,041,883
前受金	430,463,227
未払金	2,257,877
未払解約金	31,937,720
未払利息	512

	2020年 8月28日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	466,701,219
負債合計	466,701,219
純資産の部	
元本等	
元本	25,806,472,250
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	51,677,953,456
元本等合計	77,484,425,706
純資産合計	77,484,425,706
負債純資産合計	77,951,126,925

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 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、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

2020年 8月28日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,806,472,250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 3.0025円 (1万口当たり純資産額) (30,025円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 8月28日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8月28日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2020年 8月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	20,683,262,362円
期中追加設定元本額	6,572,012,726円
期中一部解約元本額	1,448,802,838円
期末元本額	25,806,472,250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	7,671,440,036円
世界経済インデックスファンド	3,912,516,190円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,564,669,188円
DC 世界経済インデックスファンド	5,002,920,774円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	147,248,881円
分散投資コア戦略ファンドA	362,298,375円
分散投資コア戦略ファンドS	1,279,448,650円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	552,704,001円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	620,348,174円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	342,064,593円

区分	2020年 8月28日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,986,991円
S M T インデックスバランス・オープン	111,549,576円
S M T 世界経済インデックス・オープン	94,489,104円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	302,911,894円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	61,805,364円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,359,903円
グローバル経済コア	433,638,684円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	21,969,600円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	450,611円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	581,384円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	319,077円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	207,955円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	254,749,685円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	46,793,560円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,467,301,096
新株予約権証券	318,293
投資信託受益証券	5,722,139
投資証券	34,419,792
合計	6,426,840,872

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,291,307,243	-	4,721,770,470	430,463,227
	合計	4,291,307,243	-	4,721,770,470	430,463,227

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2020年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	243,674,798	-	245,126,020	1,451,222
	アメリカドル	243,674,798	-	245,126,020	1,451,222
	売建	886,298	-	898,974	12,676
	ブラジルリアル	886,298	-	898,974	12,676
合計		244,561,096	-	246,024,994	1,438,546

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	617,282	4.86	3,001,842.36	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.71	74,568.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	43,246	68.84	2,977,054.64	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,190	147.00	1,497,930.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	146,513	5.16	756,007.08	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.96	612,087.40	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	26,967	44.76	1,207,042.92	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	5.38	83,449.18	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	13.29	224,999.70	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	70,402	26.04	1,833,268.08	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	21.06	412,733.88	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	12.02	322,352.36	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	120.20	856,304.80	

SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	12.57	487,376.61
SOUTHERN COPPER CORP	11,367	46.32	526,519.44
51JOB INC-ADR	2,701	66.80	180,426.80
BEST INC - ADR	14,126	4.32	61,024.32
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	35,934	32.26	1,159,230.84
NIO INC - ADR	77,076	19.88	1,532,270.88
GSX TECHEDU INC- ADR	7,846	81.93	642,822.78
HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	43.58	606,677.18
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,167	146.12	2,216,202.04
TAL EDUCATION GROUP- ADR	40,978	76.43	3,131,948.54
YUM CHINA HOLDINGS INC	38,070	55.20	2,101,464.00
58.COM INC-ADR	9,450	55.66	525,987.00
AUTOHOME INC-ADR	6,571	84.37	554,395.27
BAIDU INC - SPON ADR	29,357	127.25	3,735,678.25
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	9,184	45.14	414,565.76
HUYA INC-ADR	8,211	28.19	231,468.09
IQIYI INC-ADR	21,239	19.61	416,496.79
JOYY INC	6,185	88.53	547,558.05
MOMO INC-SPON ADR	15,529	20.61	320,052.69
NETEASE INC-ADR	8,567	511.88	4,385,275.96
SINA CORP	5,725	40.51	231,919.75
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	34,090	16.07	547,826.30
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	36.27	190,381.23
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	196,529	284.17	55,847,645.93
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	41.68	146,213.44
JD.COM INC-ADR	89,155	79.30	7,069,991.50
PINDUODUO INC-ADR	26,536	88.82	2,356,927.52
TRIP.COM GROUP LTD	52,406	29.03	1,521,346.18
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	17.25	819,168.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47,223	15.20	717,789.60
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	7,243	33.58	243,219.94
ZAI LAB LTD-ADR	5,149	80.45	414,237.05
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	173,806	4.28	743,889.68
CREDICORP LTD	7,332	130.39	956,019.48
SBERBANK-SPONSORED ADR	289,100	12.02	3,476,427.50
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	0.91	344,013.67
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	27.08	54,728.68
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.84	45,940.60
GDS HOLDINGS LTD - ADR	7,645	81.01	619,321.45
GLOBANT SA	3,122	177.00	552,594.00
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	9.74	388,177.96
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	7.08	104,189.28

	アメリカドル 小計	3,128,405		115,029,050.43 (12,268,998,518)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	7.56	11,681,417.16
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	350,392	57.52	20,154,547.84
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	357.16	5,178,820.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	36.88	3,571,901.76
	ALFA S.A.B. -A	359,900	14.41	5,186,159.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	45.05	1,689,375.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	250.31	5,833,474.55
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	166.46	5,173,576.80
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	162.89	2,765,872.20
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	27.34	6,107,482.60
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	67.46	2,118,244.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	579,880	54.84	31,800,619.20
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	104.83	5,291,294.25
	BECLE SAB DE CV	48,100	40.98	1,971,138.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	198,940	128.59	25,581,694.60
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	271.16	7,039,313.60
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	43.03	7,822,854.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	35.99	6,542,982.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	262,800	78.37	20,595,636.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	16.93	4,274,825.00
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,625,440	13.56	49,160,966.40	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	65.62	3,773,150.00	
	メキシコペソ 小計	8,195,655		233,315,343.96 (1,124,579,957)
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	82.92	1,525,728.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	423,000	22.65	9,580,950.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	446,840	22.15	9,897,506.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	19.45	1,470,420.00
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	22.23	329,004.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	14.95	941,850.00
	GERDAU SA-PREF	105,000	19.25	2,021,250.00
	SUZANO SA	62,679	51.42	3,222,954.18
	VALE SA	372,878	60.79	22,667,253.62
	WEG SA	84,872	66.29	5,626,164.88
	CCR SA	125,600	12.98	1,630,288.00
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	49.11	3,042,462.72
	RUMO SA	114,200	22.54	2,574,068.00
	COGNA EDUCACAO	181,284	6.07	1,100,393.88
	B2W CIA DIGITAL	20,960	111.23	2,331,380.80
	B2W CIA DIGITAL - RCT	1,389	109.81	152,526.09

	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	77,416	32.36	2,505,181.76	
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	42.69	3,539,299.83	
	MAGAZINE LUIZA SA	83,400	91.98	7,671,132.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	21.02	1,597,520.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	19.40	805,100.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	19,700	64.35	1,267,695.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,500	107.75	2,639,875.00	
	AMBEV SA	517,700	12.68	6,564,436.00	
	BRF SA	52,500	19.70	1,034,250.00	
	JBS SA	106,400	23.10	2,457,840.00	
	NATURA & CO HOLDING SA	66,208	49.23	3,259,419.84	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	20,100	62.76	1,261,476.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	73.63	4,005,472.00	
	HYPERA SA	35,300	32.47	1,146,191.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	146,698	19.56	2,869,412.88	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	483,948	21.04	10,182,265.92	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	32.75	2,891,825.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	529,381	24.18	12,800,432.58	
	ITAUSA SA	505,867	9.69	4,901,851.23	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	222,703	60.28	13,424,536.84	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	26.50	1,828,500.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	69,100	7.62	526,542.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA-RCT	24,833	7.50	186,247.50	
	PORTO SEGURO SA	7,300	55.35	404,055.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,963	9.42	809,771.46	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	21.50	976,100.00	
	CIELO SA	99,269	4.65	461,600.85	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	49.03	2,564,269.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	96,100	14.53	1,396,333.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	36.53	646,581.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	36.06	1,211,616.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	102,126	10.78	1,100,918.28	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	7,900	64.11	506,469.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	50.55	1,754,085.00	
	CPFL ENERGIA SA	15,400	28.86	444,444.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	42.99	1,257,457.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	110,400	23.70	2,616,480.00	
	ブラジルリアル 小計	6,307,723		173,630,882.64 (3,325,031,402)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,058.00	270,974,340.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,680.00	228,421,200.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,556	24,948.00	263,351,088.00	

	FALABELLA SA	70,837	2,611.50	184,990,825.50	
	CENCOSUD SA	137,988	1,260.00	173,864,880.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,564	5,350.00	120,717,400.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,708.00	25,982,096.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	67.50	328,228,200.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	24,800.00	135,308,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	30.50	191,534,540.50	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,245.00	51,792,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	4,948.90	91,811,992.80	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	245.00	70,127,085.00	
	COLBUN SA	1,215,680	126.99	154,379,203.20	
	ENEL AMERICAS SA	3,990,008	117.00	466,830,936.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	59.50	152,396,041.00	
	チリペソ 小計	19,699,120		2,910,710,628.00 (395,274,503)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,160.00	1,056,194,640.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	26,720.00	784,926,720.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	27,000.00	1,033,506,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	21,900.00	455,958,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	21,960.00	1,109,221,560.00	
	コロンビアペソ 小計	627,964		4,439,806,920.00 (123,870,613)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,794	11.56	66,978.64	
	OPAP SA	17,668	7.80	137,810.40	
	JUMBO SA	14,899	14.69	218,866.31	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.69	358,773.83	
	ユーロ 小計	64,568		782,429.18 (98,633,022)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	19.40	517,980.00	
	イギリスポンド 小計	26,700		517,980.00 (72,921,224)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	83.65	970,590.95	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	8.85	1,033,281.75	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	16.93	1,685,652.38	
	KOC HOLDING AS	89,884	15.82	1,421,964.88	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	28,973	15.91	460,960.43	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	11.12	691,563.92	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	85.80	557,785.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	71.10	3,044,786.40	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	21,501	19.67	422,924.67	
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.03	1,389,894.63	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	6.99	1,677,544.08	

	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.10	882,361.20	
	YAPI VE KREDI BANKASI	246,063	2.09	514,271.67	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.05	920,742.90	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	14.62	2,091,990.42	
	トルコリラ 小計	1,672,655		17,766,316.08	(257,433,919)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	537.00	4,007,631.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	54.80	3,767,390.40	
	CEZ AS	18,145	456.00	8,274,120.00	
	チェココルナ 小計	94,356		16,049,141.40	(76,875,387)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	1,690.00	71,579,950.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,360.00	111,710,080.00	
	OTP BANK NYRT	24,834	10,410.00	258,521,940.00	
	ハンガリーフォリント 小計	82,367		441,811,970.00	(156,313,074)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	42.59	470,917.63	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	53.90	1,655,430.70	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	259,894	5.33	1,386,274.59	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	135.70	1,782,012.40	
	LPP SA	124	7,060.00	875,440.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	460.80	3,089,203.20	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.08	659,936.16	
	DINO POLSKA SA	4,430	231.00	1,023,330.00	
	BANK PEKAO SA	22,583	53.98	1,219,030.34	
	M BANK SA	1,663	190.00	315,970.00	
	PKO BANK POLSKI SA	104,297	22.04	2,298,705.88	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	155.50	562,132.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	28.00	1,737,232.00	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	7.33	408,251.43	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	6.34	402,945.61	
	ポーランドズロチ 小計	662,912		17,886,812.44	(511,026,231)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.25	1,200,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,739,400	3.49	9,560,506.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	392,500	12.60	4,945,500.00	
	CNOOC LTD-R	1,883,000	8.83	16,626,890.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	3.71	319,060.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,382,000	2.65	6,312,300.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.03	856,260.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	1.97	669,800.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	124,000	57.70	7,154,800.00	

CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	5.23	530,845.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	642,000	3.14	2,015,880.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	11.32	4,663,840.00
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	11.82	3,404,160.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.25	767,750.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	4.67	775,220.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	8.60	1,109,400.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	557,000	1.67	930,190.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	8.98	812,690.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	5.25	3,827,250.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.86	602,640.00
BOC AVIATION LTD	32,500	55.90	1,816,750.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	519,000	4.50	2,335,500.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	5.08	995,680.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	34.00	5,423,000.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	79,000	14.38	1,136,020.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	6.19	1,185,385.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.04	1,914,960.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	6.15	1,045,500.00
CITIC LTD	677,000	7.30	4,942,100.00
CRRG CORP LTD-H	511,050	3.53	1,804,006.50
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	8.71	2,508,480.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	19.26	1,502,280.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.32	389,760.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	11.94	453,720.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.55	253,825.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	97,500	22.10	2,154,750.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	16.30	3,452,340.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	7.07	222,111.12
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	24.50	1,526,350.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	8.05	935,410.00
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	41,500	40.90	1,697,350.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	4.78	1,840,653.72
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	54.60	7,425,600.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	10.24	1,843,200.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.40	1,155,600.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	5.30	572,400.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	308,000	3.15	970,200.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.00	1,489,923.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.01	705,760.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	474,000	3.84	1,820,160.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	241,878	4.24	1,025,562.72

JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.03	1,252,680.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	64,000	7.13	456,320.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	12.70	1,624,609.40
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	5.42	476,960.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	3.81	445,770.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.12	2,620,160.00
BYD CO LTD-H	82,500	78.10	6,443,250.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.34	1,420,440.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	25.40	690,880.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	518,000	15.84	8,205,120.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	7.91	2,790,252.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.21	1,819,400.24
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	81.85	9,085,350.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	2.26	438,440.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	27.95	3,242,200.00
LI NING CO LTD	217,000	33.90	7,356,300.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	76,900	125.60	9,658,640.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	17.06	767,700.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	15.78	1,104,600.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	7.91	759,360.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	68,000	49.70	3,379,600.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	22,500	36.55	822,375.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.12	1,624,000.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	48.25	1,553,650.00
TENCENT HOLDINGS LTD	603,900	558.00	336,976,200.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	1.15	683,051.70
MEITUAN DIANPING-CLASS B	369,800	271.00	100,215,800.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	15.50	1,060,200.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	9.92	1,130,880.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	49.25	3,349,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	10.60	2,745,400.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	200	94.87	18,974.00
CHINA FEIHE LTD	64,000	15.54	994,560.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	35.50	9,975,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	51.85	7,362,700.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.77	1,173,420.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	15.36	3,502,080.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	70.80	3,256,800.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.26	580,800.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.34	2,990,400.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	121.20	5,817,600.00

HENGAN INTL GROUP CO LTD	78,500	61.90	4,859,150.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	28.20	705,000.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	30,000	19.70	591,000.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	358,000	18.76	6,716,080.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	33,500	111.70	3,741,950.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	18.34	4,474,960.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.68	1,756,512.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	18.96	2,373,792.00
3SBIO INC	119,000	9.19	1,093,610.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	5,800	180.10	1,044,580.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	9.00	900,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	597,600	17.00	10,159,200.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.45	700,875.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.36	557,760.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	14.96	1,226,720.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	64,000	34.60	2,214,400.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	94,000	54.55	5,127,700.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	4.88	397,720.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	33.15	1,839,825.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	9.10	10,128,300.00
SSY GROUP LTD	114,000	4.75	541,500.00
WUXI APPTec CO LTD-H	26,740	114.30	3,056,382.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	91,500	196.00	17,934,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,152,000	2.69	8,478,880.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,635,200	2.57	22,192,464.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.20	4,613,595.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.35	3,186,520.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,118,620	5.68	57,473,761.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	2.92	2,000,200.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	436,923	37.50	16,384,612.50
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	4.82	3,250,608.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.32	501,320.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,464,515	4.53	29,284,252.95
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	882,000	4.06	3,580,920.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.56	1,297,920.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	12.18	1,632,120.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.74	1,557,090.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	0.91	843,570.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	18.40	2,428,800.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	18.58	4,617,130.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.68	1,603,200.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	9.16	811,576.00

GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	109,400	12.48	1,365,312.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	7.06	2,521,832.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	209,200	13.74	2,874,408.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	831,000	18.78	15,606,180.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	22.80	6,762,480.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	0.85	203,150.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	12.62	2,322,382.88
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	31.65	3,051,060.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.59	2,432,010.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	6.06	4,177,085.28
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	605,500	83.40	50,498,700.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	53.75	2,456,375.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	10.80	1,533,600.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	9.10	1,146,600.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	18.66	3,470,760.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.95	2,861,100.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	409,040	22.85	9,346,564.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	6.87	549,600.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	347,111	36.40	12,634,840.40
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	24.65	4,397,560.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.56	1,810,560.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	897,964	9.76	8,764,128.64
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	9.80	1,324,960.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.83	597,480.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	15.00	2,287,500.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	14.64	2,196,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	40.00	7,880,000.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	66.75	534,000.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	7.17	1,462,680.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.59	870,240.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	36.25	4,803,125.00
SHUI ON LAND LTD	651,000	1.09	709,590.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	1.91	1,009,608.81
SOHO CHINA LTD	291,500	2.45	714,175.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	33.35	8,370,850.00
WHARF HOLDINGS	100,000	15.08	1,508,000.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.53	884,340.00
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	356,619	3.58	1,276,696.02
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	4.64	607,840.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	18.94	4,583,480.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	44.75	4,117,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	15.14	1,196,060.00

	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	49.80	3,560,700.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	26.95	2,290,750.00	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	3.30	778,800.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.85	1,530,950.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	8.13	560,970.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	10.36	218,596.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	5.00	3,660,000.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	75,500	119.00	8,984,500.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,109,600	21.35	23,689,960.00	
	ZTE CORP-H	82,908	22.80	1,890,302.40	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	654,500	55.95	36,619,275.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	2.60	3,525,600.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.49	6,803,340.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	618,000	5.80	3,584,400.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	25.35	1,508,325.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.21	1,958,100.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.73	2,321,660.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	253,600	21.60	5,477,760.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	431,000	4.88	2,103,280.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.49	992,340.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	36.50	3,139,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	9.44	1,655,776.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	84,700	85.70	7,258,790.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	12.60	4,032,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.38	1,250,600.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	5.54	1,994,400.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	27.70	1,246,500.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	310,500	25.70	7,979,850.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	382,445	9.80	3,747,961.00	
	香港ドル 小計	95,886,402		1,253,464,695.38 (17,247,674,208)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.69	1,526,434.92	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	20.58	516,558.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	5.81	1,568,119.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	5.21	751,803.00	
	GAMUDA BHD	141,520	3.36	475,507.20	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.88	301,016.00	
	IJM CORP BHD	198,100	1.23	243,663.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.19	736,597.74	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.25	559,618.50	
	MISC BHD	125,040	7.76	970,310.40	

	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.98	278,600.00	
	GENTING BHD	307,200	3.54	1,087,488.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.23	824,431.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	13,200	21.82	288,024.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	21,300	32.80	698,640.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.99	139,860.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.49	806,583.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	55,646	22.72	1,264,277.12	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	140.00	966,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	19.26	1,014,616.80	
	QL RESOURCES BHD	83,200	9.65	802,880.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	5.16	1,274,757.36	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	16.86	2,673,996.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.41	1,240,513.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	168,300	26.40	4,443,120.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	265,600	3.02	802,112.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	517,519	3.37	1,744,039.03	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	14.64	897,314.88	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	46,033	12.60	580,015.80	
	MALAYAN BANKING BHD	404,004	7.46	3,013,869.84	
	PUBLIC BANK BERHAD	324,420	16.62	5,391,860.40	
	RHB BANK BHD	206,419	4.68	966,040.92	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.13	892,954.57	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.14	1,290,438.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.06	1,355,574.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	4.13	291,379.76	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.88	1,274,440.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	275,175	11.12	3,059,946.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.70	177,917.32	
	マレーシアリングット 小計	7,139,248		47,191,317.16 (1,206,681,979)	
タイパーツ	IRPC PCL - NVDR	829,500	2.44	2,023,980.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	91.25	12,264,000.00	
	PTT PCL-NVDR	1,253,200	37.25	46,681,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	43.00	5,164,300.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	24.30	5,015,520.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	47.50	10,684,365.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	348.00	28,188,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	56.75	24,294,675.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	9.30	7,598,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	10.50	8,499,750.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	22.20	8,052,783.60	

	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	743,535	15.20	11,301,732.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	38.25	6,793,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	657,100	63.75	41,890,125.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	458,200	33.75	15,464,250.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	40.00	2,640,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	449,700	14.80	6,655,560.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,083,700	20.20	21,890,740.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	111.50	3,657,200.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	108.00	5,605,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	85.25	10,775,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	85.50	6,694,650.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	9.65	4,232,972.50	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127,400	72.75	9,268,350.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,147,300	0.93	2,926,989.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	24.40	4,028,440.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	51.50	4,624,700.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	47.75	3,643,325.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	47.75	10,805,825.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.50	6,540,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	184.50	22,084,650.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	55.25	13,464,425.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	35.75	2,359,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.36	3,230,334.24	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	48.00	2,563,200.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	36,000	222.00	7,992,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	43.50	8,069,250.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	65.75	4,484,150.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	262,000	33.50	8,777,000.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	55.75	3,027,225.00	
	タイパーツ 小計	16,385,166		413,957,766.34 (1,411,595,983)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	47.00	11,183,180.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	735.00	20,785,800.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	405.00	2,777,490.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	289,060	63.60	18,384,216.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	873.00	19,908,765.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	105.00	15,172,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	138.70	8,462,087.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	87,300	51.20	4,469,760.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	138.80	13,263,728.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	65.70	3,931,816.50	
	BDO UNIBANK INC	219,911	87.05	19,143,252.55	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	34.40	5,548,272.80	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.41	8,032,937.00	
	AYALA LAND INC	742,900	29.70	22,064,130.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	3.01	1,920,380.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	14.84	1,380,120.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,156,150	29.50	34,106,425.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,134.00	10,008,460.00	
	PLDT INC	10,460	1,446.00	15,125,160.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	26.30	2,353,850.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	267.00	7,772,370.00	
	フィリピンペソ 小計	6,533,866		245,794,699.85 (538,290,392)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,125.00	1,619,212,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,525.00	4,726,172,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	895.00	2,579,837,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	9,375.00	2,289,375,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	12,200.00	2,318,000,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	10,675.00	3,689,280,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	5,300.00	11,409,310,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,610.00	1,458,177,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	6,250.00	4,951,875,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	51,900.00	3,093,240,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	1,685.00	1,546,661,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	10,350.00	1,666,350,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,675.00	3,293,342,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	8,250.00	6,157,800,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,615.00	4,450,778,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,051,000	33,000.00	34,683,000,000.00	
	BANK MANDIRI	1,813,696	6,300.00	11,426,284,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	5,300.00	4,294,060,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,498,800	3,700.00	20,345,560,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	5,349,700	2,990.00	15,995,603,000.00	
XL AXIATA TBK PT	387,000	2,540.00	982,980,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	1,315.00	1,040,822,500.00		
	インドネシアルピア 小計	29,924,996		144,017,722,300.00 (1,051,329,372)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	32,850.00	216,580,050.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	57,400.00	255,257,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	155,500.00	868,623,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	35,850.00	383,810,100.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	25,300.00	183,222,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	400,000.00	313,200,000.00	

KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,512	100,500.00	252,456,000.00	
LG CHEM LTD	4,819	762,000.00	3,672,078,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,129	397,000.00	448,213,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	180,000.00	347,400,000.00	
POSCO	7,998	188,500.00	1,507,623,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	90,200.00	306,589,800.00	
CJ CORP	1,230	82,300.00	101,229,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,217	78,600.00	252,856,200.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	33,865	3,020.00	102,272,300.00	
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	26,350.00	113,515,800.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	24,500.00	165,620,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,825	26,000.00	73,450,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	31,950.00	295,186,050.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,348	232,500.00	313,410,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10,619	22,300.00	236,803,700.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	87,100.00	379,233,400.00	
LG CORP	9,902	85,300.00	844,640,600.00	
LOTTE CORP	2,370	29,950.00	70,981,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	13,850.00	82,933,800.00	
SAMSUNG C&T CORP	8,727	111,000.00	968,697,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	11,450.00	212,008,200.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	5,220.00	193,928,220.00	
SK HOLDINGS CO LTD	3,449	215,000.00	741,535,000.00	
S-1 CORPORATION	2,394	89,800.00	214,981,200.00	
CJ LOGISTICS	862	149,500.00	128,869,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,307	130,000.00	299,910,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	9,145	17,750.00	162,323,750.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	3,405.00	101,251,080.00	
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	29,150.00	205,973,900.00	
HANON SYSTEMS	19,000	12,900.00	245,100,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,916	217,000.00	1,500,772,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	15,682	163,500.00	2,564,007,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,286	86,400.00	370,310,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	84,200.00	252,852,600.00	
KIA MOTORS CORPORATION	26,639	42,200.00	1,124,165,800.00	
COWAY CO LTD	5,058	83,100.00	420,319,800.00	
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	35,750.00	145,860,000.00	
HLB INC	3,701	87,900.00	325,317,900.00	
LG ELECTRONICS INC	11,019	86,200.00	949,837,800.00	
KANGWON LAND INC	13,208	20,500.00	270,764,000.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	17,800.00	90,246,000.00	
KAKAO CORP	5,728	410,500.00	2,351,344,000.00	

NAVER CORP	13,049	337,000.00	4,397,513,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,650	863,000.00	1,423,950,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	150,500.00	370,982,500.00	
PEARL ABYSS CORP	921	185,500.00	170,845,500.00	
CJ ENM CO LTD	830	118,000.00	97,940,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	69,900.00	213,264,900.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	54,600.00	66,721,200.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	75,900.00	78,480,600.00	
SHINSEGAE CO LTD	881	200,500.00	176,640,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	123,000.00	67,527,000.00	
EMART	1,864	114,500.00	213,428,000.00	
GS RETAIL CO LTD	4,060	31,700.00	128,702,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	418,000.00	323,950,000.00	
KT&G CORP	11,869	85,200.00	1,011,238,800.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,968	143,500.00	425,908,000.00	
OTTOGI CORPORATION	68	580,000.00	39,440,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,873	171,500.00	492,719,500.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	2,100	59,600.00	125,160,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,499,000.00	1,433,044,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	278	723,000.00	200,994,000.00	
PACIFIC CORP	3,393	52,700.00	178,811,100.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,381	101,700.00	648,947,700.00	
CELLTRION INC	10,296	304,500.00	3,135,132,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,242	112,600.00	139,849,200.00	
HANMI PHARM CO LTD	490	304,000.00	148,960,000.00	
HELIXMITH CO LTD	2,051	51,600.00	105,831,600.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,803	801,000.00	1,444,203,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,802	67,300.00	255,874,600.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,153	5,200.00	250,395,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	32,598	28,700.00	935,562,600.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	8,220.00	232,872,600.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	40,986	36,950.00	1,514,432,700.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	48,174	30,000.00	1,445,220,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	8,610.00	511,485,660.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	60,100.00	276,580,200.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,250.00	155,688,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,015	9,360.00	290,300,400.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,040.00	109,447,280.00	
SAMSUNG CARD CO	1,899	28,900.00	54,881,100.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	30,400.00	175,590,400.00	
DB INSURANCE CO LTD	4,209	44,500.00	187,300,500.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	22,500.00	204,772,500.00	

	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	180,000.00	559,440,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	59,300.00	439,828,100.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	103,000.00	149,453,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	159,000.00	592,275,000.00	
	KMW CO LTD	1,901	74,800.00	142,194,800.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	14,950.00	359,861,450.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	146,500.00	207,297,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	128,500.00	719,985,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	501,244	55,600.00	27,869,166,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	85,728	48,400.00	4,149,235,200.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,738	469,000.00	2,691,122,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	12,100.00	267,712,500.00	
	SK TELECOM	2,172	245,500.00	533,226,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	30,309	20,400.00	618,303,600.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	23,700.00	107,550,600.00	
	SK HYNIX INC	57,001	79,100.00	4,508,779,100.00	
	韓国ウォン 小計	1,610,639		93,403,579,340.00 (8,415,662,498)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	83.00	9,315,920.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	42.65	9,987,606.40	
	CHINA STEEL	1,266,261	20.05	25,388,533.05	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	396,061	69.50	27,526,239.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	413,824	78.90	32,650,713.60	
	NAN YA PLASTICS CORP	548,752	61.60	33,803,123.20	
	TAIWAN CEMENT	567,511	43.85	24,885,357.35	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	683.00	8,196,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	26.20	9,118,333.60	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,874	321.50	7,032,491.00	
	CHINA AIRLINES LTD	437,203	8.36	3,655,017.08	
	EVA AIRWAYS CORP	164,159	11.30	1,854,996.70	
	EVERGREEN MARINE	359,039	16.25	5,834,383.75	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	32.60	5,770,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	37.30	6,604,375.30	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	380.00	7,576,060.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	175.00	7,603,400.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	121,000	30.85	3,732,850.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	320.00	8,148,480.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	356.00	5,696,000.00	
	POU CHEN	273,780	27.75	7,597,395.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	613.00	18,390,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	274.00	16,315,056.00	
	STANDARD FOODS CORP	35,756	63.70	2,277,657.20	

UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	526,395	67.40	35,479,023.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	18.25	10,618,689.50
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,899,237	19.00	36,085,503.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,156,970	27.20	31,469,584.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,034,216	21.25	21,977,090.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	964,097	18.40	17,739,384.80
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,173,339	29.40	34,496,166.60
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	10.85	12,552,245.65
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,229,570	13.20	16,230,324.00
TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	10.05	5,029,532.55
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,087,289	20.05	21,800,144.45
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	42.00	13,896,162.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,302	134.00	18,398,468.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,170,159	18.30	21,413,909.70
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	823,123	40.00	32,924,920.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	8.57	10,770,604.60
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	307,791	20.55	6,325,105.05
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	710,082	43.10	30,604,534.20
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	8.43	10,078,376.91
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	103,120	45.50	4,691,960.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	40.05	5,913,783.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	236.00	11,328,000.00
ACER INC	255,803	23.15	5,921,839.45
ADVANTECH CO LTD	43,336	309.00	13,390,824.00
ASUSTEK COMPUTER INC	76,092	249.00	18,946,908.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	10.70	10,112,463.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	204.00	14,218,800.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	90.30	5,579,817.60
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	9.18	7,114,500.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	18.90	8,160,264.00
DELTA ELECTRONICS INC	209,903	193.50	40,616,230.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	53.10	4,930,335.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,287,248	77.50	99,761,720.00
INVENTEC CO LTD	280,511	22.85	6,409,676.35
LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	3,460.00	38,198,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	46.90	10,573,698.80
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	140.50	8,430,000.00
PEGATRON CORP	200,474	63.90	12,810,288.60
QUANTA COMPUTER INC	286,270	78.50	22,472,195.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	45.00	5,764,500.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	163.00	4,401,000.00
WISTRON CORP	355,695	33.15	11,791,289.25

	WIWYNN CORP	8,000	805.00	6,440,000.00
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	41.50	5,963,218.00
	YAGEO CORPORATION	22,764	336.50	7,660,086.00
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	125.50	7,520,211.00
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	371,315	109.50	40,658,992.50
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	61.50	9,655,500.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	178,200	102.50	18,265,500.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	349,315	61.60	21,517,804.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	399.00	9,576,000.00
	MEDIATEK INC	160,804	558.00	89,728,632.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	154,000	54.00	8,316,000.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	248.00	14,395,160.00
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	276.00	3,201,324.00
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	99,770	88.70	8,849,599.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	390.00	19,868,160.00
	SILERGY CORP	7,000	1,875.00	13,125,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,582,389	444.00	1,146,580,716.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	21.95	26,559,500.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	93.30	8,303,700.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	296.00	9,472,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	12.60	4,397,400.00
	新台湾ドル 小計	35,342,707		2,528,442,951.79 (9,178,247,914)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	412.95	27,304,254.00
	COAL INDIA LTD	147,331	140.55	20,707,372.05
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	208.40	12,384,170.00
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	87.20	16,896,308.00
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	80.15	20,254,626.35
	PETRONET LNG LTD	83,779	243.35	20,387,619.65
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	306,633	2,110.60	647,179,609.80
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	221.35	16,276,529.55
	ASIAN PAINTS LTD	28,520	1,982.50	56,540,900.00
	BERGER PAINTS INDIA LTD	16,698	562.65	9,395,129.70
	GRASIM INDUSTRIES LTD	41,773	685.05	28,616,593.65
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	194.90	23,652,479.30
	JSW STEEL LTD	80,284	289.30	23,226,161.20
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,470.95	18,045,614.60
	SHREE CEMENT LTD	901	21,528.00	19,396,728.00
	TATA STEEL LTD	39,709	426.85	16,949,786.65
	ULTRATECH CEMENT LTD	10,743	4,047.15	43,478,532.45
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	496.75	26,925,837.00
	VEDANTA LTD	198,772	127.85	25,413,000.20

HAVELLS INDIA LTD	23,476	653.10	15,332,175.60
LARSEN & TOUBRO LTD	49,730	975.60	48,516,588.00
SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,215.00	7,200,090.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	350.55	21,918,489.30
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	395.50	10,462,952.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,185.70	9,912,452.00
BAJAJ AUTO LTD	8,362	3,043.00	25,445,566.00
BHARAT FORGE LTD	30,322	510.90	15,491,509.80
BOSCH LTD	965	14,145.75	13,650,648.75
EICHER MOTORS LTD	12,540	2,236.35	28,043,829.00
HERO MOTOCORP LTD	10,359	3,141.75	32,545,388.25
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	636.75	48,182,235.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,151	7,098.00	86,247,798.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	116.90	8,982,245.30
TATA MOTORS LTD	190,082	144.25	27,419,328.50
PAGE INDUSTRIES LTD	601	20,087.50	12,072,587.50
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	1,137.65	37,417,308.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,132	2,167.95	11,125,919.40
INFO EDGE INDIA LTD	6,428	3,277.35	21,066,805.80
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	209.55	16,653,567.15
AVENUE SUPERMARTS LTD	14,325	2,380.85	34,105,676.25
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	3,816.60	19,495,192.80
ITC LTD	388,437	194.25	75,453,887.25
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	16,113.70	38,592,311.50
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	28,688	544.65	15,624,919.20
UNITED SPIRITS LTD	32,483	570.10	18,518,558.30
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	5,255	1,404.30	7,379,596.50
DABUR INDIA LTD	58,111	493.15	28,657,439.65
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	678.75	26,107,440.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	87,189	2,171.25	189,309,116.25
MARICO LTD	42,465	374.65	15,909,512.25
AUROBINDO PHARMA LTD	28,844	876.60	25,284,650.40
BIOCON LTD	17,686	391.35	6,921,416.10
CIPLA LTD	37,891	756.20	28,653,174.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	3,268.45	29,605,620.10
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,437.00	56,101,428.00
LUPIN LTD	26,552	983.20	26,105,926.40
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,521.60	17,836,195.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	532.25	44,150,137.50
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,552	2,747.05	9,757,521.60
AXIS BANK LTD	228,324	473.05	108,008,668.20
BANDHAN BANK LTD	36,073	311.10	11,222,310.30

	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	177,443	1,864.10	330,771,496.30	
	ICICI BANK LTD	515,616	392.20	202,224,595.20	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	303.85	8,498,988.35	
	STATE BANK OF INDIA	187,504	215.65	40,435,237.60	
	BAJAJ FINANCE LTD	18,080	3,632.50	65,675,600.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,499.45	10,235,247.75	
	REC LTD	48,168	110.75	5,334,606.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	720.40	15,284,006.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	6,530.75	25,391,556.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	62,014	596.05	36,963,444.70	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	17,954	1,276.65	22,920,974.10	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	449.00	14,247,668.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	32,481	841.25	27,324,641.25	
	DLF LTD	56,420	175.90	9,924,278.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	122,073	710.15	86,690,140.95	
	INFOSYS LTD	365,523	947.05	346,168,557.15	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	96,664	2,248.40	217,339,337.60	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	735.60	35,349,258.00	
	WIPRO LTD	118,712	272.35	32,331,213.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	263,301	511.15	134,586,306.15	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	199.90	7,157,219.60	
	GAIL INDIA LTD	174,768	99.20	17,336,985.60	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	13,220	406.90	5,379,218.00	
	NTPC LTD	260,019	102.60	26,677,949.40	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	185.20	37,292,798.00	
	インドルピー 小計	6,609,110		4,165,060,758.50 (6,039,338,099)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	115.66	8,443,180.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	135.69	9,023,385.00	
	MCB BANK LTD	53,300	173.70	9,258,210.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		26,724,775.00 (17,103,856)	
カタールリアル ピー	QATAR FUEL QSC	57,358	18.34	1,051,945.72	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.13	947,335.95	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	9.85	1,938,361.80	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.10	836,359.00	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.18	1,701,369.90	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	8.55	843,172.24	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	16.19	1,849,383.70	
	QATAR NATIONAL BANK	470,710	18.36	8,642,235.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.36	698,203.85	
	OOREDOO QSC	72,800	6.69	487,468.80	

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	17.47	1,090,494.87	
	カタールリアル 小計	2,334,811		20,086,331.43 (585,114,834)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,900	138.13	4,820,737.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	7,385	1,241.99	9,172,096.15	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,716	476.72	21,317,011.52	
	GOLD FIELDS LTD	89,344	210.60	18,815,846.40	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	77,953	156.85	12,226,928.05	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	539.00	2,895,508.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	154.12	5,232,374.00	
	SASOL LTD	57,207	143.76	8,224,078.32	
	SIBANYE STILLWATER LTD	218,901	50.48	11,050,122.48	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	142.34	3,943,102.68	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	103.70	4,202,857.30	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	123.75	3,528,112.50	
	NASPERS LTD-N SHS	46,871	3,235.96	151,672,681.16	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	83,044	10.30	855,353.20	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	34.05	3,762,354.75	
	BID CORP LTD	33,071	298.17	9,860,780.07	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	244.68	6,587,030.28	
	PICK N PAY STORES LTD	45,989	44.06	2,026,275.34	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	58,453	116.72	6,822,634.16	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	170.83	3,975,897.42	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	186.00	2,422,278.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	16.93	2,650,272.99	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	140.84	5,245,444.96	
	ABSA GROUP LTD	73,296	82.00	6,010,272.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,974	900.00	6,276,600.00	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	105.94	4,029,639.78	
	STANDARD BANK GROUP LTD	142,629	111.40	15,888,870.60	
	FIRSTRAND LTD	525,813	40.64	21,369,040.32	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	330.00	5,671,710.00	
	REMGRO LTD	55,441	93.42	5,179,298.22	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	130.68	4,573,277.28	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	15.96	1,086,524.88	
OLD MUTUAL LTD	489,612	11.90	5,826,382.80		
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	32.76	3,317,539.68		
SANLAM LTD	221,098	58.36	12,903,279.28		
NEPI ROCKCASTLE PLC	32,121	82.36	2,645,485.56		
MTN GROUP LTD	173,000	63.83	11,042,590.00		
VODACOM GROUP	62,331	132.55	8,261,974.05		
		3,343,278		415,392,261.18	

南アフリカランド 小計				(2,596,201,632)
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	5.65	1,522,618.50
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	4.14	532,354.32
	EMIRATES NBD PJSC	112,010	11.10	1,243,311.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	11.42	3,234,852.04
	ALDAR PROPERTIES PJSC	509,421	2.04	1,039,218.84
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.41	253,296.63
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	2.93	1,128,167.20
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	200,413	16.90	3,386,979.70
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		2,067,867		12,340,798.23 (358,006,556)
香港・オフショア 人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	6.77	615,393.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	7.98	305,634.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	6.26	549,628.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	9.11	557,532.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	3.18	522,474.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	60.63	1,784,947.20
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	4.90	189,630.00
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	22,500	55.90	1,257,750.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	12.30	656,820.00
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	19.90	738,290.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.16	534,760.00
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	11.93	460,140.10
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.20	253,580.00
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.16	475,416.00
	SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	69,000	6.90	476,100.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	28.68	207,987.36
	SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	23,600	40.26	950,136.00
	TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	17.83	73,103.00
	TIANQI LITHIUM CORP-A	31,500	22.28	701,820.00
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	43,200	15.78	681,696.00
	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.02	555,044.00
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	70.34	1,230,950.00
	WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	77.22	711,968.40
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	79.37	825,448.00
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15,600	40.25	627,900.00
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	14.23	335,828.00
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	10.77	366,180.00
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	41.79	476,406.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	24.19	411,230.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	25,000	32.95	823,750.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	6.36	614,376.00	

CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	63,200	8.73	551,736.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	110,200	4.82	531,164.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	16,100	38.53	620,333.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.10	1,075,590.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	204.95	2,746,330.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	2.10	786,660.00
CRRC CORP LTD-A	79,000	5.77	455,830.00
EVE ENERGY CO LTD-A	24,521	50.12	1,228,992.52
GUOCHENG MINING CO LTD-A	31,100	22.06	686,066.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	55.23	751,128.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	18,056	65.00	1,173,640.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	22.51	1,093,986.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.09	667,488.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	22.68	950,292.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	58.70	1,197,480.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,400	23.26	869,924.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	10.56	238,656.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	15.47	668,304.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.08	222,829.88
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	34.13	1,078,508.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	104.50	863,170.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	22.35	1,054,696.50
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	14.54	644,122.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	9.82	791,492.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	37,300	27.18	1,013,814.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	71.27	783,970.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.11	184,149.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.92	196,800.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.58	804,734.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	14.90	461,900.00
S F HOLDING CO LTD-A	13,700	79.62	1,090,794.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	79.14	420,945.66
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.41	195,804.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	42.00	348,600.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	21.11	461,042.40
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	104,734	6.62	693,339.08
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	28.22	1,052,606.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	24.75	848,925.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	22.50	659,250.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	19.20	817,920.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	52.94	979,390.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	17.06	566,392.00

OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	100.13	771,001.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	22.57	586,820.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	30,100	23.05	693,805.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.12	564,616.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	17.92	599,961.60
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	15.87	850,632.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	14.79	251,430.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.47	1,041,318.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	1,800	629.53	1,133,154.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	66.30	1,080,690.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	18.77	309,705.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	10.77	887,017.20
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	36.92	841,776.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	45.79	1,121,855.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	22,800	20.78	473,784.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	14,800	203.99	3,019,052.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	25.22	428,740.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	9.75	446,550.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,800	95.60	745,680.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	8.65	350,325.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	18,700	68.81	1,286,747.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	4,800	256.95	1,233,360.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	58.40	128,480.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	11.37	676,515.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	71.21	733,463.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	70.00	700,000.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	21,100	49.28	1,039,808.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	14,160	183.02	2,591,563.20
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	26.30	720,620.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	69.71	1,185,070.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	32,400	59.42	1,925,208.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	36.90	1,265,743.80
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	50.39	871,747.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	132.04	1,201,564.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	80.10	921,150.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,731.00	13,155,600.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	142.48	1,396,304.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	23,970	88.60	2,123,742.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	37.38	1,001,784.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	190.47	1,276,149.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	23.20	733,120.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	23.50	896,760.00

WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	238.08	5,047,296.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	20.39	108,067.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	23.55	699,435.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,914	50.51	904,836.14
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	159.30	796,500.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	106.29	301,651.02
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	26.24	255,052.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	73.13	903,155.50
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	17.39	180,856.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	37.14	549,672.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	18.32	455,068.80
OVCTEK CHINA INC-A	13,950	63.36	883,872.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	327.30	1,734,690.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	4,700	216.51	1,017,597.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	20.74	784,594.20
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	3,800	261.33	993,054.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	23,400	43.20	1,010,880.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	7,400	128.95	954,230.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	145.72	801,460.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	453.91	998,602.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	46.55	712,215.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	27.94	284,988.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	136.35	1,349,865.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	45.38	1,007,118.34
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	32.19	515,040.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	110.50	884,000.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	57.12	1,076,712.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	26,926	23.40	630,068.40
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	31,752	94.11	2,988,180.72
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	16,380	51.31	840,457.80
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	9.14	585,874.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	198.33	1,348,644.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	36.55	255,850.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	24.37	273,723.84
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	103,300	5.86	605,338.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	14.20	276,900.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	61.05	1,037,850.00
WUXI APPTec CO LTD-A	8,820	108.30	955,206.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	28.10	733,410.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	106.88	758,848.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	226.50	883,350.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	40.75	367,565.00

ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	32.40	784,080.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	61.15	593,155.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.22	1,138,592.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.86	281,880.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.75	469,775.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	6.30	364,140.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	8.60	434,300.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	34.56	829,440.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.22	374,010.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.15	768,135.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.83	493,687.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	36.90	3,870,810.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.53	1,513,008.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.37	760,578.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.97	1,298,164.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	15.71	1,495,592.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	14.46	1,726,524.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.35	1,431,405.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	4.96	607,600.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	8.39	166,961.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	73,060	21.15	1,545,219.00
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	30.97	1,337,904.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	51.60	1,243,560.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	102,600	25.52	2,618,352.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	22.18	2,257,924.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	8.64	715,392.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	15.56	942,936.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	155.70	840,780.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	8.18	355,012.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	8.00	703,200.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	11.73	371,841.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	45,800	14.49	663,642.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.58	1,156,176.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	30.85	561,470.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	76.54	5,112,872.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	16.67	303,394.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	16.41	897,627.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	26.95	1,447,215.00
GEMDALE CORP-A	45,500	14.59	663,845.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	7.82	919,632.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	9.86	693,749.60
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.20	1,325,160.00

SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	35.71	457,088.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	21.30	181,050.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	18.56	499,264.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	33.72	455,220.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	26.54	764,352.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	100.46	673,082.00
GLODON CO LTD-A	15,400	71.20	1,096,480.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	108.55	987,805.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	37.25	402,300.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	219.20	657,600.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	4,700	70.93	333,371.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	38,870	43.07	1,674,130.90
ADDSINO CO LTD -A	34,700	18.54	643,338.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	48.08	644,272.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	5.12	586,752.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	26.08	730,240.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	17.75	617,700.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	5,640	44.62	251,656.80
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	26.15	543,920.00
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	15,400	29.36	452,144.00
GOERTEK INC -A	26,900	42.25	1,136,525.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	11.72	586,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	99.40	695,800.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	58,500	36.99	2,163,915.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	35.43	698,396.16
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	38,500	34.16	1,315,160.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	59,450	55.20	3,281,640.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	189.00	585,900.00
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	18.96	593,448.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	24.71	600,453.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	137.27	653,405.20
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	25.28	594,080.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	63.00	844,200.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	27.77	791,445.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	16.09	756,230.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	31.49	577,526.60
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	23.63	66,164.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	136.90	574,980.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	21,080	38.33	807,996.40
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	56.65	637,312.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	22.82	691,446.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	59.68	519,216.00

	ZTE CORP-A	12,600	38.88	489,888.00	
	CHINA UNITED NETWORK-A	166,400	5.20	865,280.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.60	799,480.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	18.67	2,501,780.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.95	1,178,285.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	9.24	624,624.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.68	852,000.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	4.32	356,400.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,480	192.89	864,147.20	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	35,600	16.83	599,148.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	60.60	987,780.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	27.21	1,104,726.00	
	SG MICRO CORP-A	1,400	289.60	405,440.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	184.47	479,622.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	23.80	534,690.80	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	11,700	126.37	1,478,529.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	43,600	15.32	667,952.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,900	171.93	498,597.00	
	香港・オフショア人民元 小計	11,904,528		235,705,005.62 (3,653,427,587)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	13.24	311,921.16	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	129,846	35.00	4,544,610.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	56.20	550,984.80	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	11.98	382,497.44	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	16.20	522,984.60	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	19,671	86.00	1,691,706.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	40.15	1,806,107.60	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	91,783	88.30	8,104,438.90	
	SAUDI CEMENT	7,489	54.80	410,397.20	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	22.22	467,930.98	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	9.08	600,315.12	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	54.10	1,436,679.60	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	80.10	355,003.20	
	JARIR MARKETING CO	7,199	166.40	1,197,913.60	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	123.00	458,175.00	
	ALMARAI CO	30,130	54.70	1,648,111.00	
	SAVOLA	25,336	48.05	1,217,394.80	
	AL RAJHI BANK	135,049	65.80	8,886,224.20	
	ALINMA BANK	109,956	15.50	1,704,318.00	
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	21.00	1,210,398.00	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	12.96	464,136.48	
	BANK ALBILAD	45,859	24.32	1,115,290.88	

BANQUE SAUDI FRANSI	57,797	33.00	1,907,301.00	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	148,866	37.55	5,589,918.30	
RIYAD BANK	138,943	18.80	2,612,128.40	
SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	27.65	2,811,534.95	
SAUDI BRITISH BANK	71,793	27.50	1,974,307.50	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	123.40	748,174.20	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	81.10	536,314.30	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	8.05	379,090.60	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	8.07	372,729.09	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	27.35	941,222.90	
SAUDI TELECOM CO	60,811	96.40	5,862,180.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	15.70	1,447,869.70	
サウジアラビアリアル 小計	1,772,696		64,270,309.90 (1,831,061,129)	
合 計	261,610,539		72,540,693,889 (72,540,693,889)	

(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	
新株予約権証券	タイバーツ	MINOR INTL PCL -CW23	16,488.00	160,758.00		
	タイバーツ 小計		16,488.00	160,758.00 (548,184)		
新株予約権証券合計				548,184 (548,184)		
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	5,581,288.00		
	メキシコペソ 小計		58,400	5,581,288.00 (26,901,808)		
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		25,400	2,102,612.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		58,600	1,688,852.00	
		ENERGISA SA-UNITS		16,500	735,405.00	
		KLABIN SA-UNIT		64,600	1,684,768.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS		26,962	1,186,328.00	
ブラジルリアル 小計		192,062	7,397,965.00 (141,671,029)			
投資信託受益証券合計			250,462	168,572,837 (168,572,837)		
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	5,406,252.00		
	メキシコペソ 小計		308,400	5,406,252.00 (26,058,134)		

	南アフリカ ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	3,859,214.76	
	南アフリカランド 小計		295,047	3,859,214.76 (24,120,092)	
	投資証券合計		603,447	50,178,226 (50,178,226)	
	合計			219,299,247 (219,299,247)	

有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 55銘柄	100.0%				16.9%
メキシコペソ	株式 22銘柄	95.5%				1.5%
	投資信託受益証券 1銘柄			2.3%		0.0%
	投資証券 1銘柄				2.2%	0.0%
ブラジルレアル	株式 53銘柄	95.9%				4.6%
	投資信託受益証券 5銘柄			4.1%		0.2%
チリペソ	株式 16銘柄	100.0%				0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%				0.2%
ユーロ	株式 4銘柄	100.0%				0.1%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%				0.1%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%				0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%				0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%				0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%				0.7%
香港ドル	株式 207銘柄	100.0%				23.7%
マレーシアリングット	株式 39銘柄	100.0%				1.7%
タイバーツ	株式 40銘柄	100.0%				1.9%
	新株予約権証券 1銘柄		0.0%			0.0%

フィリピン ペソ	株式	21銘柄	100.0%				0.7%
インドネシ アルピア	株式	22銘柄	100.0%				1.4%
韓国ウォン	株式	106銘柄	100.0%				11.6%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%				12.6%
インドル ピー	株式	86銘柄	100.0%				8.3%
パキスタン ルピー	株式	3銘柄	100.0%				0.0%
カタールリ アル	株式	11銘柄	100.0%				0.8%
南アフリカ ランド	株式	38銘柄	99.1%				3.6%
	投資証券	1銘柄				0.9%	0.0%
アラブ首長 国連邦ディ ルハム	株式	8銘柄	100.0%				0.5%
香港・オフ ショア人民 元	株式	259銘柄	100.0%				5.0%
サウジアラ ビアリアル	株式	34銘柄	100.0%				2.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,710,697,600
国債証券	459,579,788,350
地方債証券	30,314,105,568
特殊債券	38,739,325,603
社債券	22,805,988,970
未収利息	1,278,474,951
前払費用	22,883,616
流動資産合計	555,451,264,658
資産合計	555,451,264,658
負債の部	

	2020年 8月28日現在
項目	金額（円）
流動負債	
未払金	2,289,842,640
未払解約金	93,275,404
未払利息	5,265
流動負債合計	2,383,123,309
負債合計	2,383,123,309
純資産の部	
元本等	
元本	393,683,774,509
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	159,384,366,840
元本等合計	553,068,141,349
純資産合計	553,068,141,349
負債純資産合計	555,451,264,658

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	393,683,774,509口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 100,983,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4049円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,049円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2020年 8月28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 8月28日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2020年 8月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	343,350,525,726円
期中追加設定元本額	89,723,446,284円
期中一部解約元本額	39,390,197,501円
期末元本額	393,683,774,509円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,677,342,780円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,341,834円
S M T 国内債券インデックス・オープン	19,206,419,307円
世界経済インデックスファンド	2,070,710,057円
D C マイセレクション 2 5	22,109,649,490円
D C マイセレクション 5 0	23,760,852,646円
D C マイセレクション 7 5	6,225,872,282円
D C 日本債券インデックス・オープン	452,797,124円
D C 日本債券インデックス・オープン S	91,312,743,942円
D C 日本債券インデックス・オープン P	69,068,282,987円
D C マイセレクション S 2 5	9,541,366,300円
D C マイセレクション S 5 0	10,101,986,177円

区分	2020年 8月28日現在
DCマイセレクションS75	1,991,461,837円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,013,231,621円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,569,142,541円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	548,915,336円
DC世界経済インデックスファンド	2,667,295,036円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	23,642,142円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	5,731,334円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	41,067,263円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	10,729,027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）	144,669,410円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	204,629,917円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,856,778円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	73,542,702円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,783,756,274円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	837,054,302円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,424,817,873円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	774,217,171円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	90,243,030円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,130,305,571円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	26,598,750円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,295,663,308円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,632,577,399円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	148,013,151円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,900,878,639円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,802,757,607円
分散投資コア戦略ファンドA	11,984,605,676円
分散投資コア戦略ファンドS	10,388,137,228円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	94,600,954円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,017,855,760円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,697,512円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,501,769円
SMT インデックスバランス・オープン	55,521,523円
SMT 世界経済インデックス・オープン	16,124,858円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	28,689,850円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	43,056,776円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,997,843円
グローバル経済コア	215,698,537円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,922,935円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,851,106円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	415,240円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	385,530円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	144,745円

区分	2020年 8月28日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	42,129円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	72,985,283,930円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	14,955,484円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,106,880,750
地方債証券	101,453,962
特殊債証券	147,375,308
社債券	44,117,120
合計	4,399,827,140

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第404回利付国債（2年）	460,000,000	461,058,000	
	第405回利付国債（2年）	470,000,000	471,222,000	
	第406回利付国債（2年）	780,000,000	782,191,800	
	第407回利付国債（2年）	360,000,000	361,083,600	
	第408回利付国債（2年）	690,000,000	692,214,900	
	第409回利付国債（2年）	2,610,000,000	2,618,900,100	
	第410回利付国債（2年）	390,000,000	391,404,000	
	第412回利付国債（2年）	780,000,000	783,385,200	
	第413回利付国債（2年）	1,640,000,000	1,646,904,400	

第414回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,410,128,000	
第415回利付国債(2年)	100,000,000	100,432,000	
第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,348,082,800	
第130回利付国債(5年)	3,160,000,000	3,169,701,200	
第131回利付国債(5年)	4,990,000,000	5,008,213,500	
第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	4,789,366,200	
第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,399,841,400	
第134回利付国債(5年)	5,850,000,000	5,879,016,000	
第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,102,440,000	
第136回利付国債(5年)	4,140,000,000	4,165,005,600	
第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	6,944,367,000	
第138回利付国債(5年)	9,420,000,000	9,483,961,800	
第139回利付国債(5年)	4,760,000,000	4,794,748,000	
第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	7,357,086,000	
第141回利付国債(5年)	6,020,000,000	6,069,002,800	
第142回利付国債(5年)	6,050,000,000	6,100,941,000	
第143回利付国債(5年)	3,950,000,000	3,982,469,000	
第144回利付国債(5年)	1,910,000,000	1,925,642,900	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	585,448,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,605,922,100	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	785,669,500	
第4回利付国債(40年)	1,000,000,000	1,439,090,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,491,130,600	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,731,996,000	
第7回利付国債(40年)	830,000,000	1,098,795,500	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	991,664,000	
第9回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,048,414,000	
第10回利付国債(40年)	1,990,000,000	2,165,697,100	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,891,009,700	
第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,633,443,300	
第13回利付国債(40年)	280,000,000	267,204,000	
第317回利付国債(10年)	890,000,000	901,561,100	
第318回利付国債(10年)	2,260,000,000	2,286,961,800	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,737,582,300	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,637,727,400	
第321回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,645,838,000	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	762,060,000	
第323回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,965,917,300	
第324回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,786,032,000	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,975,334,000	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,178,718,400	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,257,404,700	

第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,462,186,000	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,307,555,000	
第330回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,737,134,100	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	919,584,000	
第332回利付国債(10年)	3,110,000,000	3,182,680,700	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,388,529,600	
第334回利付国債(10年)	1,790,000,000	1,838,168,900	
第335回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,509,829,000	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	523,112,100	
第337回利付国債(10年)	2,950,000,000	3,000,356,500	
第338回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,127,075,200	
第339回利付国債(10年)	5,050,000,000	5,164,332,000	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,470,668,800	
第341回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,202,530,400	
第342回利付国債(10年)	6,380,000,000	6,438,632,200	
第343回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,281,232,500	
第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	7,007,456,800	
第345回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,312,442,000	
第346回利付国債(10年)	5,200,000,000	5,251,220,000	
第347回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,019,780,000	
第348回利付国債(10年)	4,840,000,000	4,887,916,000	
第349回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,160,924,400	
第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	5,846,915,700	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,590,000,000	3,623,638,300	
第352回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,227,123,400	
第353回利付国債(10年)	4,470,000,000	4,507,101,000	
第354回利付国債(10年)	4,580,000,000	4,615,174,400	
第355回利付国債(10年)	4,870,000,000	4,904,187,400	
第356回利付国債(10年)	2,210,000,000	2,223,967,200	
第357回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,684,845,200	
第358回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,689,194,100	
第359回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,757,665,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	137,391,100	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	195,638,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	146,110,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	141,522,700	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	61,166,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	238,098,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	224,821,800	
第8回利付国債(30年)	140,000,000	167,535,200	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	275,575,200	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	177,956,800	

第11回利付国債(30年)	260,000,000	309,069,800
第12回利付国債(30年)	190,000,000	236,078,800
第13回利付国債(30年)	290,000,000	357,413,400
第14回利付国債(30年)	300,000,000	386,310,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	443,547,000
第16回利付国債(30年)	200,000,000	261,632,000
第17回利付国債(30年)	570,000,000	739,751,700
第18回利付国債(30年)	345,000,000	443,983,950
第19回利付国債(30年)	380,000,000	490,146,800
第20回利付国債(30年)	480,000,000	634,848,000
第21回利付国債(30年)	500,000,000	648,220,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	531,928,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	573,155,600
第24回利付国債(30年)	380,000,000	508,048,600
第25回利付国債(30年)	350,000,000	458,094,000
第26回利付国債(30年)	530,000,000	703,829,400
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,364,974,600
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,228,546,800
第29回利付国債(30年)	1,520,000,000	2,049,142,400
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,365,056,300
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,458,303,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,106,998,400
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,362,815,000
第34回利付国債(30年)	1,735,000,000	2,328,040,350
第35回利付国債(30年)	2,010,000,000	2,626,869,000
第36回利付国債(30年)	1,950,000,000	2,556,333,000
第37回利付国債(30年)	2,000,000,000	2,589,620,000
第38回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,571,558,700
第39回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,561,452,000
第40回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,499,916,600
第41回利付国債(30年)	730,000,000	921,493,600
第42回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,705,698,000
第43回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,593,471,600
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,545,971,800
第45回利付国債(30年)	990,000,000	1,211,096,700
第46回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,031,856,600
第47回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,685,110,500
第48回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,189,569,200
第49回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,492,352,400
第50回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,178,764,500
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,732,139,200
第52回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,579,968,000
第53回利付国債(30年)	690,000,000	697,921,200

第54回利付国債（30年）	2,200,000,000	2,330,108,000	
第55回利付国債（30年）	1,040,000,000	1,102,015,200	
第56回利付国債（30年）	1,940,000,000	2,054,207,800	
第57回利付国債（30年）	1,550,000,000	1,640,039,500	
第58回利付国債（30年）	1,710,000,000	1,807,948,800	
第59回利付国債（30年）	120,000,000	123,742,800	
第60回利付国債（30年）	2,530,000,000	2,738,547,900	
第61回利付国債（30年）	1,410,000,000	1,451,129,700	
第62回利付国債（30年）	20,000,000	19,512,400	
第63回利付国債（30年）	900,000,000	852,651,000	
第64回利付国債（30年）	1,700,000,000	1,607,911,000	
第65回利付国債（30年）	860,000,000	812,072,200	
第66回利付国債（30年）	1,030,000,000	970,981,000	
第67回利付国債（30年）	530,000,000	527,328,800	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	112,597,100	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	82,330,400	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	206,086,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	144,652,200	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	155,758,500	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	248,779,200	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	312,480,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	208,386,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	362,250,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	246,844,800	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	328,185,600	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	210,738,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	339,660,800	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	234,586,000	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	350,783,400	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	139,263,800	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	205,570,500	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	420,572,100	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	438,172,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	217,558,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	686,284,200	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	392,594,400	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	218,972,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	142,942,800	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	294,416,100	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	317,550,000	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	186,092,200	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	296,859,600	

第80回利付国債(20年)	220,000,000	242,946,000
第81回利付国債(20年)	390,000,000	430,840,800
第82回利付国債(20年)	600,000,000	665,874,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	323,329,700
第84回利付国債(20年)	470,000,000	521,516,700
第85回利付国債(20年)	290,000,000	324,884,100
第86回利付国債(20年)	210,000,000	237,600,300
第87回利付国債(20年)	550,000,000	619,223,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	477,716,400
第89回利付国債(20年)	350,000,000	396,060,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	716,303,700
第91回利付国債(20年)	450,000,000	514,377,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	999,644,800
第93回利付国債(20年)	410,000,000	465,083,500
第94回利付国債(20年)	610,000,000	695,961,200
第95回利付国債(20年)	610,000,000	707,362,100
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,822,092,300
第97回利付国債(20年)	400,000,000	463,224,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	506,435,600
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,329,296,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	560,793,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	846,166,750
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,497,699,000
第103回利付国債(20年)	400,000,000	472,336,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	419,479,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,380,706,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	447,697,000
第107回利付国債(20年)	260,000,000	305,338,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	764,128,200
第109回利付国債(20年)	520,000,000	603,959,200
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,119,622,500
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,155,813,200
第112回利付国債(20年)	790,000,000	934,388,300
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,721,034,000
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,774,913,500
第115回利付国債(20年)	700,000,000	840,154,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,795,345,700
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,291,053,600
第118回利付国債(20年)	660,000,000	785,162,400
第119回利付国債(20年)	530,000,000	620,174,200
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,806,504,800
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,774,950,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,102,911,400

第123回利付国債(20年)	1,430,000,000	1,725,209,200	
第124回利付国債(20年)	610,000,000	729,694,200	
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,000,826,400	
第126回利付国債(20年)	730,000,000	875,722,600	
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,212,953,400	
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,156,598,900	
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,051,695,200	
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,522,185,300	
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,173,650,000	
第132回利付国債(20年)	950,000,000	1,117,399,500	
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,460,452,800	
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,343,976,800	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,339,700	
第136回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,714,916,700	
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,322,092,800	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	717,482,600	
第139回利付国債(20年)	580,000,000	677,927,200	
第140回利付国債(20年)	2,010,000,000	2,377,488,300	
第141回利付国債(20年)	1,780,000,000	2,109,495,800	
第142回利付国債(20年)	640,000,000	766,182,400	
第143回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,326,936,400	
第144回利付国債(20年)	1,740,000,000	2,021,880,000	
第145回利付国債(20年)	2,515,000,000	2,989,655,950	
第146回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,691,275,800	
第147回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,477,790,000	
第148回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,662,242,000	
第149回利付国債(20年)	3,010,000,000	3,519,021,100	
第150回利付国債(20年)	3,370,000,000	3,898,820,400	
第151回利付国債(20年)	1,255,000,000	1,417,685,650	
第152回利付国債(20年)	2,470,000,000	2,791,594,000	
第153回利付国債(20年)	2,570,000,000	2,942,572,900	
第154回利付国債(20年)	2,920,000,000	3,303,279,200	
第155回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,259,961,000	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,983,226,000	
第157回利付国債(20年)	2,820,000,000	2,762,838,600	
第158回利付国債(20年)	2,320,000,000	2,378,301,600	
第159回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,870,841,600	
第160回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,554,503,600	
第161回利付国債(20年)	1,970,000,000	2,046,514,800	
第162回利付国債(20年)	580,000,000	601,883,400	
第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,707,614,000	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,815,137,200	

	第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,670,028,400
	第166回利付国債(20年)	900,000,000	947,052,000
	第167回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,784,333,200
	第168回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,386,399,900
	第169回利付国債(20年)	760,000,000	744,100,800
	第170回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,356,883,600
	第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,260,097,800
	第172回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,352,628,800
	第173回利付国債(20年)	840,000,000	834,632,400
	国債証券合計	427,330,000,000	459,579,788,350
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,941,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,941,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	133,169,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	131,916,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,822,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,694,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,084,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,231,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,304,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,880,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	101,054,000
	第702回東京都公募公債	100,000,000	101,338,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	101,733,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	101,560,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	102,373,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,068,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,533,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,716,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,506,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	300,786,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	198,344,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,901,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,628,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,887,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,773,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	136,228,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,761,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,117,000
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,622,000
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,608,000
	第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,618,000
	第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,506,000

第243回神奈川県公募公債	200,000,000	198,254,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	234,914,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,621,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,443,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,384,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,016,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	153,705,920	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,370,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,106,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,954,760	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,834,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	500,000,000	501,570,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	118,254,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	117,066,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	102,370,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,487,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	98,458,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	102,994,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	104,049,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	115,833,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,358,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	437,876,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	107,985,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	202,810,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,316,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,845,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	101,595,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	299,220,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	119,361,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,653,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	117,014,000	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,164,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,686,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,574,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,709,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,805,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	118,588,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,239,000	
	100,000,000	101,595,000	

平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）			
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,347,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,591,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,912,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,508,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	307,467,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,490,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	102,381,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,470,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	117,694,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,778,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,819,756	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,468,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	115,693,000	
第5回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	116,788,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	234,110,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	106,664,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	235,278,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	196,860,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,709,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,999,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,250,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,063,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,966,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,961,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,575,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,771,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,755,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	108,289,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,875,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	108,686,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	130,875,000	
	100,000,000	112,169,000	

平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）			
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,037,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	102,381,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	102,881,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	299,703,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	234,110,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	118,119,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,014,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	102,436,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,774,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,430,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,967,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,610,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	297,435,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,711,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,626,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,389,000	
第107回共同発行市場公募地方債	800,000,000	811,840,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,556,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,707,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,513,000	
第112回共同発行市場公募地方債	220,000,000	223,436,400	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,986,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,242,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,886,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,377,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,067,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,056,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,010,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,798,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,278,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,137,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,010,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,450,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,896,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,570,112	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,173,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,083,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,971,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,824,000	

第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,528,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,280,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,728,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,509,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,936,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,084,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,912,045	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,781,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,356,000	
平成23年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,143,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	203,370,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	99,980,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	101,274,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,274,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,826,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	237,282,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	296,346,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	103,330,000	
平成29年度第1回大阪市公募公債（5年）	100,000,000	99,982,000	
第1回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	130,315,000	
第5回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	135,348,000	
第9回名古屋市長市公募公債（20年）	100,000,000	115,920,000	
第11回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	124,658,000	
第481回名古屋市長市公募公債（10年）	100,000,000	101,673,000	
第499回名古屋市長市公募公債（10年）	100,000,000	100,816,000	
第512回名古屋市長市公募公債（10年）	300,000,000	299,562,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,379,000	
平成24年度第2回京都市公募公債	122,500,000	124,532,275	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,677,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,023,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,020,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	137,035,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	234,690,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	119,280,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	117,298,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	99,481,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	110,257,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,600,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,406,000	

平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,477,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,888,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,564,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	202,468,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	299,706,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	108,947,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,803,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,720,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	116,528,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,408,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,727,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,027,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,859,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	117,797,000	
平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	101,143,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	115,380,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	204,230,000	
平成28年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,000,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,240,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,373,500	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,837,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,462,000	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	171,451,800	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	547,096,000	
平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	202,586,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	198,290,000	
平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	100,000,000	101,999,000	
平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,628,000	
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,108,000	
地方債証券合計	28,959,430,000	30,314,105,568	
特殊債券			
第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,589,780	
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,228,000	
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	417,179,100	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,223,000	
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,316,000	

第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,775,000	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	97,799,000	
第14回道路債券	100,000,000	104,344,000	
第17回道路債券	100,000,000	103,489,000	
第21回道路債券	100,000,000	129,993,000	
第28回道路債券	200,000,000	263,276,000	
第33回道路債券	200,000,000	266,946,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,607,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,906,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,395,000	
第42回道路債券	100,000,000	109,854,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,096,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,339,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,647,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	145,115,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,722,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,203,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	508,755,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,577,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,536,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	511,440,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,119,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,774,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,044,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,831,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,633,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,596,000	
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	305,015,340	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,812,000	

第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,086,000	
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	203,288,000	
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	101,710,000	
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	101,649,000	
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	305,280,000	
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	117,080,000	
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	102,073,000	
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	306,273,000	
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	203,510,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	613,122,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	306,499,800	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	638,751,360	
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	205,092,000	
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	151,614,160	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,961,000	
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	102,275,000	
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	230,978,000	
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	104,466,360	
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	102,427,000	
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	102,307,000	
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	102,183,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,949,000	
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	304,014,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,569,000	
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	224,828,000	
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	203,142,000	
	100,000,000	100,631,000	

第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,449,000	
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	106,806,330	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	316,998,560	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,049,600	
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	100,723,000	
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	201,398,000	
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	100,663,000	
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	121,074,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,912,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,282,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	216,054,400	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	110,000,000	110,721,600	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,710,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	379,065,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,740,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	215,434,800	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,414,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	395,361,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,746,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,120,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	43,169,600	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	129,940,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	235,792,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	196,666,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	234,772,000	
第21回地方公共団体金融機構債券（5年）	400,000,000	400,000,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,620,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,179,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,957,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,895,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,758,000	

第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,724,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,066,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,510,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,480,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,688,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,518,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,512,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,554,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,168,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,660,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,844,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,944,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,845,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,316,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,510,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,744,450	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,824,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,798,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,980,100	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,393,080	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,954,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,891,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,121,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,742,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,096,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,461,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	109,522,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,870,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,117,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	204,164,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,929,440	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,825,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,443,100	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	188,686,740	
第81回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,989,000	
第85回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,946,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	211,768,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	172,688,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	94,532,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,239,000	

第344回東京交通債券	100,000,000	103,938,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,580,200	
第59回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	507,355,000	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,932,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,609,000	13,027,870	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,054,000	13,499,663	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,393,000	13,904,880	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	205,761,000	205,462,646	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	145,352,000	145,240,078	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,327,000	13,804,239	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,224,000	14,786,132	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	262,245,000	261,321,897	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,554,000	11,738,864	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,958,000	24,577,314	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,966,000	14,506,623	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	279,051,000	277,692,021	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	98,650,000	98,470,457	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,613,000	13,006,021	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,761,000	15,407,384	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,598,000	12,992,569	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,734,000	15,397,914	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,449,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,345,000	11,431,675	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,649,000	11,738,813	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,448,000	20,677,113	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,926,000	21,302,488	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,373,000	24,070,663	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,881,000	25,498,937	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,519,000	28,455,152	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,508,000	29,442,637	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,698,000	62,821,534	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,877,000	13,253,265	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,329,000	28,929,112	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,900,000	13,280,034	

第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,711,000	13,183,849
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,400,000	32,323,408
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,879,000	12,193,555
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,895,000	32,932,216
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,892,000	30,744,843
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,889,000	14,558,033
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,046,000	62,452,954
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,039,000	33,910,397
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,479,000	13,986,214
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,194,000	44,599,901
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,989,000	42,201,191
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,151,000	42,400,259
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,756,000	90,310,501
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,241,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,766,000	96,813,380
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,382,000	49,397,156
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,309,000	49,726,962
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,036,000	50,552,125
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,788,000	43,810,539
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,806,000	43,510,848
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,148,000	49,658,159
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	178,908,000
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,791,000	132,983,148
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,720,000	178,666,074
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,373,000	50,266,802
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,057,000	52,049,769
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,694,000	52,567,143
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,546,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,715,000	167,638,620
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,272,000	57,091,554
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,010,000	118,027,862
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,378,000
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,505,000	66,406,607
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,872,000	69,662,463
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,378,000	69,497,711
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	208,485,000	215,890,387
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,488,000	144,284,992
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,467,000	70,701,762
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,523,000	75,973,521
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,999,000	79,166,477
	83,494,000	83,818,791

第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,724,000	83,866,330	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,844,000	84,347,902	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,365,000	85,303,982	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,763,000	85,578,420	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,921,000	87,637,229	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,530,000	88,355,407	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,307,000	87,887,591	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,587,000	88,165,950	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,142,000	88,773,096	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,660,000	178,546,523	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,398,000	88,968,167	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,094,000	180,705,846	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,620,000	90,208,803	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,866,000	180,754,538	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,400,000	90,971,328	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,134,000	183,851,885	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,294,000	183,996,016	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,041,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,576,000	93,487,873	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,057,000	94,173,684	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,102,000	93,426,925	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,938,000	188,707,495	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,442,000	94,232,338	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,722,000	94,650,011	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,678,000	190,193,677	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,154,000	95,161,690	

第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,782,000	285,272,992	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,848,000	190,789,078	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,346,000	98,296,827	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,702,000	98,326,932	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,796,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,041,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,640,000	
第57回日本学生支援債券	100,000,000	99,988,000	
第58回日本学生支援債券	100,000,000	99,986,000	
第59回日本学生支援債券	200,000,000	199,966,000	
第60回日本学生支援債券	200,000,000	200,532,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	109,527,000	
い第800号商工債	200,000,000	200,070,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,007,000	
い第804号商工債	300,000,000	300,024,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,186,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,584,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,748,000	
い第796号農林債	200,000,000	200,032,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,186,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,193,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,398,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,181,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,102,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,484,000	
第236号商工債（3年）	300,000,000	299,718,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,200,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,433,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,010,000	
第39回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,026,000	
第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,828,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,092,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,578,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	497,565,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,122,000	
第42回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,431,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,379,000	
第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,021,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,247,000	
	100,000,000	101,957,000	

	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券			
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,732,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	197,144,000	
	特殊債券合計	37,271,697,000	38,739,325,603	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	100,000,000	99,469,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	100,000,000	98,530,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	300,000,000	294,561,000	
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,297,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,235,000	
	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	99,453,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,092,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,476,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,487,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,698,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,464,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,078,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	200,000,000	203,900,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	400,712,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,586,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,263,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,342,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,612,000	
	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	99,727,000	
	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	99,691,000	
	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	101,391,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,522,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,418,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,266,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,447,000	
	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	102,063,000	

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	99,945,000	
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	99,645,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,210,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,808,000	
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	99,841,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,454,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,540,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,347,000	
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	99,789,000	
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	198,200,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,846,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,530,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,496,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,896,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,791,000	
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	99,465,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,743,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,432,000	
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	199,236,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,443,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,891,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,467,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,839,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,617,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,250,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,616,000	
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	100,384,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,547,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,709,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,847,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,338,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,144,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,276,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,526,000	

第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,841,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,155,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,316,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,947,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,642,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,151,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,380,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,186,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,124,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,044,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	94,635,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,764,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,095,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,051,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,082,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,778,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,197,000	
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	97,079,000	
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	118,779,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	113,705,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,703,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,229,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,483,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	303,894,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,775,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,894,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,113,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,891,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,629,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,268,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,047,000	
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	199,740,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,828,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,760,000	

第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,368,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,308,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,668,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,348,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,144,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,974,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,266,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,143,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,914,000	
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	102,180,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,895,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,000,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,933,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,540,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,569,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,010,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,535,000	
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	103,484,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,499,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	234,180,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,209,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,069,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,975,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,670,510	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,145,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,807,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,936,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,731,600	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,410,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,005,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,161,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	108,709,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	94,898,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	94,995,000	

第53回阪急阪神ホールディングス株式会社 無担保社債	200,000,000	192,932,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,129,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,518,000	
第63回日本電信電話株式会社 電信電話債券	100,000,000	101,118,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,017,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,881,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	101,430,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,032,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,832,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,057,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,766,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,809,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	96,495,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,223,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,452,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,272,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,066,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,432,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,707,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,067,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,264,000	
第416回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,912,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,902,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,473,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,298,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,701,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,223,520	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,746,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,076,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,101,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,466,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,458,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,120,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,168,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,989,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,377,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,370,000	
第317回北海道電力株式会社社債	200,000,000	206,180,000	
第320回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,274,340	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,590,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,745,000	
第344回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,226,000	

第351回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,086,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,607,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,694,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,108,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,486,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,774,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	300,618,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,650,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,956,000	
第6回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	99,743,000	
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	199,184,000	
社債券合計	22,566,000,000	22,805,988,970	
合計		551,439,208,491	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 8月28日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	477,905,655
コール・ローン	3,516,305,949
国債証券	284,491,484,129
派生商品評価勘定	15,525,119
未収入金	6,714,847
未収利息	1,722,299,247
前払金	14,814,146
前払費用	89,303,501
差入委託証拠金	507,285,774
流動資産合計	290,841,638,367
資産合計	290,841,638,367

	2020年 8月28日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,861,663
未払金	443,488
未払解約金	90,883,810
未払利息	6,830
流動負債合計	107,195,791
負債合計	107,195,791
純資産の部	
元本等	
元本	97,121,104,574
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	193,613,338,002
元本等合計	290,734,442,576
純資産合計	290,734,442,576
負債純資産合計	290,841,638,367

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 8月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2020年 8月28日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,121,104,574口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9935円 (29,935円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2020年 8月28日現在
期首	2019年 8月29日
期首元本額	138,356,719,879円
期中追加設定元本額	19,617,426,830円
期中一部解約元本額	60,853,042,135円
期末元本額	97,121,104,574円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,596,793,510円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	624,178,946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）	2,048,926,351円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,985,257円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,615,091,386円
世界経済インデックスファンド	7,105,392,292円
DCマイセレクション25	1,777,248,435円
DCマイセレクション50	1,430,666,084円
DCマイセレクション75	872,693,259円
DC外国債券インデックス・オープン	2,036,532,133円
DCマイセレクションS25	760,051,476円
DCマイセレクションS50	609,243,384円
DCマイセレクションS75	278,680,324円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	39,615,859円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	70,416,734円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	34,484,050円
DC世界経済インデックスファンド	9,099,491,269円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	562,887,630円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	8,981,665円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,486,344円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,500,041円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	38,833,574円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	78,107,726円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	118,169,571円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	125,596,859円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	199,533,349円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,761,269,756円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	507,660,221円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,938,580,351円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	766,455,099円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	68,226,844円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	533,427,316円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	31,118,124円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	205,905,833円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	259,581,617円

区分	2020年 8月28日現在
F O F s用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	860,039,342円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	764,374,058円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	763,704,356円
外国債券ファンド・シリーズ1	591,822,134円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンドA	1,698,682,884円
分散投資コア戦略ファンドS	6,316,052,062円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	327,875,635円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,067,377,131円
コア投資戦略ファンド(切替型)	848,320,875円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	198,346,653円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	96,343,723円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,090,497,715円
S M T インデックスバランス・オープン	187,241,534円
外国債券S M T Bセレクション(S M A専用)	20,744,591,679円
S M T 世界経済インデックス・オープン	116,521,980円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	113,589,809円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	199,970,154円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,092,503円
グローバル経済コア	798,707,710円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	9,510,999円
D Cターゲット・イヤーフンド2055	298,528円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	222,038,578円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	19,837,078円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	270,130円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	409,758円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	242,822円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	177,975円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	626,912,574円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,324,658,801円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	343,757,738円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	361,328,863円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	66,666,948円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	375,897,055
合計	375,897,055

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2020年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,797,067,732	-	3,782,253,586	14,814,146
	合計	3,797,067,732	-	3,782,253,586	14,814,146

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2020年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,657,343,998	-	3,671,821,600	14,477,602
	アメリカドル	1,632,807,525	-	1,636,770,500	3,962,975
	カナダドル	174,345,442	-	176,182,300	1,836,858
	ユーロ	1,581,070,373	-	1,587,221,300	6,150,927
	イギリスポンド	269,120,658	-	271,647,500	2,526,842
	合計	3,657,343,998	-	3,671,821,600	14,477,602

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,169,031.25	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,014,375.04	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	997,500.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	8,030,625.04	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,289,379.72	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,939,770.32	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,497,539.08	
		T 0.625% 05/15/30	3,100,000.00	3,068,757.82	
		T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,871,723.47	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	5,045,703.15	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,829,914.05	
		T 1.25% 05/15/50	4,550,000.00	4,269,535.17	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,690,410.17	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,129,296.90	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,168,164.05	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,588,671.87	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,145,625.00	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,129,101.55	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,585,781.25	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,939,580.50	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,058,984.41	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,136,875.00	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,263,671.90	
		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,930,578.10	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,929,316.38	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,648,648.47	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,634,941.41	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,842,116.03	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,039,687.50	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,572,070.32	
		T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	15,860,914.06	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,146,972.65	
		T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,225,390.65	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,823,832.01			

T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,542,027.40	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,413,806.25	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,838,138.65	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,559,960.95	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,791,361.35	
T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,646,093.75	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,903,460.92	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,846,825.00	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,816,542.02	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,204,121.12	
T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,037,890.64	
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,568,137.51	
T 1.75% 07/31/21	6,700,000.00	6,799,583.97	
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,320,996.11	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,285,000.00	
T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,171,236.31	
T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,170,761.71	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,564,648.45	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,649,960.96	
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,577,589.86	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,296,718.75	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,632,569.15	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,137,734.36	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,389,062.50	
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,755,074.22	
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,726,755.87	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,516,859.40	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,439,070.33	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,902,679.70	
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,917,542.36	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,605,312.51	
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,444,210.91	
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,216,445.32	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,151,750.00	
T 2.125% 08/15/21	5,370,000.00	5,472,785.18	
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,522,093.75	
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,608,125.04	
T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,033,668.77	
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,592,285.16	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,562,932.79	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,277,656.24	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,959,671.87	

T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,136,171.88
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,516,523.42
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,058,476.57
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,562,640.62
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	8,496,836.75
T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	12,009,703.17
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,819,750.00
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,995,304.68
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,834,156.27
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,573,976.56
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,805,507.83
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,115,968.79
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,266,210.95
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,192,900.00
T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,446,390.64
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,081,992.18
T 2.375% 05/15/29	15,010,000.00	17,191,140.62
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,549,804.75
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	9,069,726.60
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,709,980.48
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,790,710.96
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,488,476.55
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,067,363.25
T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,355,393.75
T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,356,718.75
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,293,316.42
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,563,167.94
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	6,158,238.30
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,860,679.68
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,260,494.55
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,619,618.75
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,485,914.06
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,022,578.12
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,238,406.25
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,780,957.04
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,519,309.37
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,262,500.00
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,639,375.00
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,846,656.26
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,153,873.44
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,145,820.34
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,074,648.44
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,276,503.92

T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,797,343.75
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,351,468.75
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,733,660.13
T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,327,890.64
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,619,162.50
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,310,046.89
T 2.75% 11/15/47	6,050,000.00	7,774,722.68
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,479,375.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,514,618.75
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,637,867.18
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,383,731.25
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,284,965.62
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,143,992.98
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,493,543.75
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,575,218.75
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,141,875.00
T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,473,730.50
T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	5,965,136.70
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,626,430.67
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,367,510.14
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,567,431.65
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,224,218.75
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,105,405.44
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,600,781.25
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,633,976.56
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,527,187.52
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,870,390.62
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,105,937.50
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,461,116.44
T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,810,051.95
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,772,710.93
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,398,828.10
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,454,000.00
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,188,903.93
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,082,734.38
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,254,398.43
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,146,062.50
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,683,437.50
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,465,437.50
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,346,326.56
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,080,000.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,338,437.50

T	3.375%	05/15/44	4,510,000.00	6,287,574.24	
T	3.375%	11/15/48	7,300,000.00	10,516,562.50	
T	3.5%	02/15/39	770,000.00	1,072,164.84	
T	3.625%	02/15/44	2,400,000.00	3,464,625.00	
T	3.625%	08/15/43	2,000,000.00	2,880,312.50	
T	3.75%	08/15/41	2,000,000.00	2,905,781.26	
T	3.75%	11/15/43	5,500,000.00	8,070,390.62	
T	3.875%	08/15/40	1,450,000.00	2,126,742.18	
T	3%	02/15/47	2,800,000.00	3,743,250.00	
T	3%	02/15/48	4,450,000.00	5,981,078.12	
T	3%	02/15/49	7,000,000.00	9,475,156.25	
T	3%	05/15/42	1,620,000.00	2,128,401.57	
T	3%	05/15/45	3,500,000.00	4,625,742.20	
T	3%	05/15/47	5,710,000.00	7,641,585.93	
T	3%	08/15/48	5,450,000.00	7,350,687.50	
T	3%	09/30/25	4,200,000.00	4,767,164.05	
T	3%	10/31/25	5,000,000.00	5,683,789.05	
T	3%	11/15/44	6,050,000.00	7,979,382.81	
T	4.25%	05/15/39	900,000.00	1,369,195.31	
T	4.25%	11/15/40	2,350,000.00	3,615,695.31	
T	4.375%	02/15/38	1,000,000.00	1,529,687.50	
T	4.375%	05/15/40	1,900,000.00	2,954,796.87	
T	4.375%	05/15/41	1,950,000.00	3,054,796.87	
T	4.375%	11/15/39	1,260,000.00	1,950,539.06	
T	4.5%	02/15/36	1,590,000.00	2,393,943.75	
T	4.5%	05/15/38	1,600,000.00	2,483,250.00	
T	4.5%	08/15/39	1,700,000.00	2,664,750.00	
T	4.625%	02/15/40	2,380,000.00	3,798,703.12	
T	4.75%	02/15/41	750,000.00	1,225,781.25	
T	5.0%	05/15/37	1,100,000.00	1,772,976.56	
T	5.25%	02/15/29	1,250,000.00	1,728,320.31	
T	5.25%	11/15/28	1,300,000.00	1,786,382.81	
T	5.375%	02/15/31	1,950,000.00	2,865,433.60	
T	5.5%	08/15/28	1,200,000.00	1,660,125.00	
T	6.0%	02/15/26	1,700,000.00	2,217,171.87	
T	6.125%	11/15/27	1,450,000.00	2,028,300.78	
T	6.25%	05/15/30	1,050,000.00	1,599,363.28	
T	6.25%	08/15/23	1,650,000.00	1,946,613.28	
T	8.0%	11/15/21	1,700,000.00	1,862,296.87	
アメリカドル 小計			1,061,750,000.00	1,178,406,095.96 (125,688,794,195)	
カナダドル	CAN	0.5%	03/01/22	4,030,000.00	4,045,193.10
	CAN	0.5%	09/01/25	3,990,000.00	4,003,625.85

CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,714,485.50	
CAN 1.25% 06/01/30	3,040,000.00	3,208,628.80	
CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,902,306.20	
CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,231,513.80	
CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,106,636.80	
CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,443,334.00	
CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	627,075.00	
CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,753,559.90	
CAN 1% 06/01/27	500,000.00	517,390.00	
CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,536,437.50	
CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,453,778.00	
CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,959,984.00	
CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,498,472.45	
CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,930,750.80	
CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,831,681.85	
CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,732,380.20	
CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	865,953.20	
CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,454,597.80	
CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,216,839.85	
CAN 2% 12/01/51	1,940,000.00	2,350,271.20	
CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,249,418.80	
CAN 4.0% 06/01/41	1,550,000.00	2,396,493.75	
CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,681,102.80	
CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,561,856.00	
CAN 5% 06/01/37	1,330,000.00	2,163,876.75	
CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,771,170.50	
カナダドル 小計	58,560,000.00	67,208,814.40 (5,458,027,817)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,456,316.00
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	35,278,345.50
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,183,736.15
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,072,376.45
	MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,002,077.50
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,195,406.10
	MBONO 7.5% 06/03/27	41,630,000.00	46,113,342.85
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	18,943,697.10
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,402,538.35
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	17,547,130.80
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,461,712.65
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,247,060.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,276,005.05
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	23,971,787.40

	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,535,483.30
	メキシコペソ 小計	396,370,000.00	439,687,015.20 (2,119,291,413)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,403,544.45
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,548,973.10
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	694,250.40
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,691,425.80
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,322,103.30
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,826,695.65
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,696,429.80
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,705,302.25
	BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,367,068.55
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	984,640.00
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	636,113.95
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,878,319.80
	BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,312,310.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,642,118.40
	BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,583,299.60
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,664,330.00
	BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,497,264.90
	BGB 2.25% 06/22/23	1,470,000.00	1,589,437.50
	BGB 2.25% 06/22/57	680,000.00	1,044,935.60
	BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,739,314.80
	BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,295,774.00
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,443,854.00
	BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	4,078,201.05
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,472,634.75
	BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,314,630.50
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,460,208.90
	BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,309,700.50
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,586,946.60
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,021,909.40
	BGB 5% 03/28/35	2,920,000.00	4,985,345.20
	BKO 0% 03/11/22	6,040,000.00	6,101,819.40
	BKO 0% 09/10/21	1,470,000.00	1,479,849.00
	BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,033,329.20
	BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	579,715.80
	BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,596,950.60
	BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,208,615.15
	BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,275,942.50
	BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,241,517.10
	BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,047,330.00
	BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,642,074.80

BTPS 0.95% 08/01/30	1,510,000.00	1,500,713.50	
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,052,390.90	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,025,162.75	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	1,033,995.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,969,426.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,250,000.00	1,254,125.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,410,354.00	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,051,819.35	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,515,260.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,532,428.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,365,012.40	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,172,223.95	
BTPS 1.65% 12/01/30	1,820,000.00	1,921,182.90	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,600,000.00	1,691,448.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,120,510.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,879,914.50	
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,205,338.40	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,740,000.00	1,893,990.00	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,474,688.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,576,400.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,504,785.20	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,547,799.75	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,776,774.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,847,712.50	
BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	960,901.95	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,174,496.40	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,253,127.25	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,218,302.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,921,263.50	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,553,283.60	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,182,704.30	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,750,000.00	3,326,702.50	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,794,003.75	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,253,594.75	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,747,622.40	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,484,816.75	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,310,000.00	2,897,744.85	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,804,622.20	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,863,157.20	
BTPS 3.75% 08/01/21	1,660,000.00	1,720,747.70	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,444,227.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,664,461.50	

BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,841,243.20
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,163,517.50
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,523,757.60
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,008,042.70
BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,581,666.70
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,147,618.50
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,725,933.30
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,429,118.00
BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,700,676.80
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,096,008.50
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,902,903.20
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,389,812.50
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,862,775.25
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,661,533.80
BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,503,500.00
BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,306,576.00
BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	4,986,052.20
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,957,610.90
BTPS 6.5% 11/01/27	5,240,000.00	7,311,398.20
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,866,246.30
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,960,567.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,024,912.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,375,441.80
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,145,359.05
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,320,119.50
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,160,290.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,191,580.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,583,494.40
DBR 0.5% 08/15/27	3,160,000.00	3,404,236.40
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,722,171.25
DBR 0% 05/15/35	810,000.00	833,372.55
DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,641,558.60
DBR 0% 08/15/29	4,640,000.00	4,841,747.20
DBR 0% 08/15/50	1,980,000.00	1,946,676.60
DBR 1.25% 08/15/48	3,050,000.00	4,080,778.00
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,121,083.20
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,310,549.30
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,478,535.70
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,923,970.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,791,611.25
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,184,447.10
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,135,500.00
DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,464,988.20

DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,008,100.25
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,707,134.90
DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,629,522.70
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,421,539.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,090,287.20
DBR 3.25% 07/04/42	2,940,000.00	5,117,202.30
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,985,849.15
DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,553,660.70
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,636,223.50
DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,383,873.40
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,621,568.60
DBR 5.5% 01/04/31	3,580,000.00	5,834,773.50
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,393,809.20
DBR 6.25% 01/04/24	5,440,000.00	6,722,534.40
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,057,225.00
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,466,589.60
FRTR 0.25% 11/25/26	4,530,000.00	4,721,505.75
FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,273,259.20
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,375,828.95
FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,259,380.00
FRTR 0.5% 05/25/40	1,210,000.00	1,250,565.25
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,439,488.65
FRTR 0.75% 05/25/52	1,820,000.00	1,901,754.40
FRTR 0.75% 11/25/28	7,590,000.00	8,237,768.55
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,017,980.00
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,080,370.75
FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,188,294.25
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,370,751.85
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,071,469.25
FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,212,618.10
FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,092,849.00
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,351,865.90
FRTR 0% 11/25/30	2,160,000.00	2,185,855.20
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,935,469.40
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,178,094.10
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,356,006.90
FRTR 1.5% 05/25/50	3,330,000.00	4,200,295.50
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,889,336.85
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,544,892.70
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,412,555.30
FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,384,115.15
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,088,797.25

FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,915,550.40
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,536,998.50
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,094,904.20
FRTR 2.5% 05/25/30	5,160,000.00	6,512,745.60
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,768,145.50
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,804,521.40
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,562,021.75
FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,901,679.25
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,801,292.50
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	8,997,871.80
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,793,004.70
FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	8,876,525.70
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,196,144.80
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	4,958,100.00
FRTR 4% 04/25/60	1,960,000.00	4,274,632.60
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,647,496.55
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,780,333.00
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,416,040.10
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,548,603.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,244,830.00
IRISH 0.2% 05/15/27	1,270,000.00	1,313,656.25
IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	852,497.15
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	495,993.60
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	837,343.00
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,166,728.00
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,365.30
IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	1,022,382.20
IRISH 1.3% 05/15/33	630,000.00	729,489.60
IRISH 1.35% 03/18/31	630,000.00	723,085.65
IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	789,673.50
IRISH 1.7% 05/15/37	890,000.00	1,102,701.10
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,534,991.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,743,273.00
IRISH 2% 02/18/45	1,170,000.00	1,598,424.75
IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,323,548.40
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,126,619.65
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,916,507.10
NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,499,372.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,688,440.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,250,000.00	1,373,718.75
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,464,327.20
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,289,191.75
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,773,268.20

NETHER 0% 01/15/22	1,490,000.00	1,502,121.15
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,888,295.00
NETHER 0% 01/15/27	800,000.00	825,424.00
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,657,736.50
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,270,987.00
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	695,659.80
NETHER 2.5% 01/15/33	1,930,000.00	2,586,962.35
NETHER 2.75% 01/15/47	2,220,000.00	3,782,757.90
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,195,427.70
NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,248,508.90
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,716,126.70
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,536,581.55
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,501,035.05
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	239,108.00
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,972,920.50
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,678,262.25
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,866,212.50
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,260,370.70
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,219,404.80
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,618,967.00
OBL 0% 10/10/25	2,240,000.00	2,314,995.20
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,542,910.45
OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,415,964.50
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,251,209.70
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	946,706.35
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,758,453.30
RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	627,499.60
RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,305,646.70
RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,155,662.30
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,525,875.00
RAGB 0% 07/15/24	1,430,000.00	1,462,082.05
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,110.40
RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,812,139.00
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,220,815.65
RAGB 1.5% 11/02/86	450,000.00	681,763.50
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,083,525.30
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,430,062.55
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,485,712.60
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,375,127.25
RAGB 3.15% 06/20/44	890,000.00	1,501,025.05
RAGB 3.4% 11/22/22	2,990,000.00	3,260,699.65
RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,804,390.00

RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,241,774.20
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,076,946.25
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,051,266.40
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,708,947.40
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,729,124.80
RFGB 0.125% 04/15/36	510,000.00	519,200.40
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	409,344.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	655,535.30
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,395,674.00
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	716,752.60
RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	696,761.00
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	550,997.50
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	740,439.00
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	393,890.25
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	550,089.90
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	430,174.50
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	744,521.60
RFGB 1.375% 04/15/47	540,000.00	705,472.20
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	686,393.50
RFGB 1.625% 09/15/22	1,250,000.00	1,307,693.75
RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	877,973.85
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	524,313.30
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	800,105.55
RFGB 4% 07/04/25	1,050,000.00	1,287,415.50
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,941,937.05
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,339,406.75
SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,461,444.25
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,424,834.25
SPGB 0.45% 10/31/22	2,360,000.00	2,406,185.20
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,951,098.00
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,864,442.50
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,103,260.00
SPGB 0% 01/31/25	870,000.00	878,534.70
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,403,371.60
SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,775,633.00
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,312,666.00
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,742,146.00
SPGB 1.4% 04/30/28	3,970,000.00	4,360,310.55
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,627,475.50
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,159,313.30
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,855,385.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,357,882.25
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,309,555.00

	SPGB 1.85% 07/30/35	1,820,000.00	2,116,314.20
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,140,020.45
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,905,086.55
	SPGB 1% 10/31/50	1,600,000.00	1,517,288.00
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,644,167.60
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,980,960.20
	SPGB 2.7% 10/31/48	2,070,000.00	2,832,474.15
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,056,606.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	3,049,761.40
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,800,000.00	3,009,447.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,902,800.60
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	4,177,430.40
	SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,020,270.60
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,520,208.40
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,527,058.80
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,824,224.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,590,000.00	4,488,625.40
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,499,570.85
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,469,786.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,309,654.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,192,652.50
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,666,248.60
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,716,722.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,558,226.25
	ユーロ 小計	777,390,000.00	932,137,079.90 (117,505,200,292)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/31/23	1,090,000.00	1,093,237.30
	UKT 0.125% 01/31/28	1,250,000.00	1,241,287.50
	UKT 0.375% 10/22/30	1,410,000.00	1,409,407.80
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,575,046.00
	UKT 0.5% 10/22/61	340,000.00	294,973.80
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,497,614.00
	UKT 0.625% 10/22/50	800,000.00	733,452.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,977,264.65
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,906,224.80
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,219,557.25
	UKT 1.25% 10/22/41	950,000.00	1,014,072.75
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,170,830.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,383,492.00
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,452,934.00
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,324,680.50
	UKT 1.625% 10/22/71	1,400,000.00	1,888,558.00

	UKT 1.75% 01/22/49	1,840,000.00	2,216,960.80	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,030,000.00	2,564,996.35	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,233,162.40	
	UKT 1.75% 09/07/37	3,530,000.00	4,077,926.60	
	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,216,870.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,673,062.50	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,130,000.00	3,403,186.20	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,801,091.70	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,958,738.70	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,335,623.55	
	UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	4,735,299.15	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,346,136.70	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	3,724,150.10	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,930,205.60	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,490,000.00	3,795,892.95	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	4,728,652.50	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,023,980.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	868,825.85	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,707,284.55	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,869,674.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,500,960.40	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	4,627,911.75	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,696,887.05	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,258,838.10	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,192,457.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,193,615.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	3,898,473.60	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,069,544.75	
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,427,668.10	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,837,187.50	
	イギリスボンド 小計	98,880,000.00	131,097,896.70 (18,455,961,897)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,555,900.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,172,417.00	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,235,500.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,920,000.00	10,651,401.60	
	SGB 2.5% 05/12/25	8,370,000.00	9,467,181.45	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,148,451.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,722,450.75	
	スウェーデンクローナ 小計	62,390,000.00	69,953,302.30 (854,829,354)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,130,000.00	4,382,177.80	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,173,912.50	

	NGB 1.75% 02/17/27	4,120,000.00	4,427,496.20
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,498,130.30
	NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,185,050.00
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,403,720.00
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,793,048.40
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	8,048,344.00
ノルウェークローネ 小計		49,370,000.00	52,911,879.20 (632,296,956)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,198,121.40
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,433,780.70
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,417,177.20
	DGB 1.5% 11/15/23	8,130,000.00	8,678,693.70
	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	10,015,173.60
	DGB 3% 11/15/21	10,860,000.00	11,329,966.50
	DGB 4.5% 11/15/39	16,940,000.00	31,599,876.00
デンマーククローネ 小計		71,190,000.00	89,672,789.10 (1,519,057,047)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	2,100,000.00	2,106,657.00
	POLGB 1.25% 10/25/30	210,000.00	207,782.40
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,666,892.65
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,202,722.35
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,188,599.50
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,040,872.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,596,067.60
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,493,200.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,696,073.80
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,060,000.00	4,562,952.80
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,480,000.00	3,898,400.40
	POLGB 4% 10/25/23	3,730,000.00	4,162,791.90
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	829,236.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,515,258.25
POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,625,624.00	
ポーランドズロチ 小計		55,040,000.00	59,793,130.65 (1,708,289,742)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,348,783.65
	ACGB 0.25% 11/21/25	3,590,000.00	3,547,548.25
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,976,627.20
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,060,000.00	2,159,827.60
	ACGB 1% 12/21/30	3,720,000.00	3,720,093.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	4,160,000.00	4,615,041.60
	ACGB 2.25% 11/21/22	4,050,000.00	4,227,815.25
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,333,239.65
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,572,036.00

	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	955,960.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,475,114.40	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,804,341.85	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,559,563.80	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,399,603.25	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,975,625.20	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,934,766.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,905,916.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,691,520.60	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,187,048.60	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,123,108.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,468,545.50	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,672,997.25	
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,256,307.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,720,000.00	4,231,779.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,694,162.25	
	オーストラリアドル 小計	76,810,000.00	86,837,372.20 (6,724,686,103)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,455,400.80	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	827,360.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	296,845.45	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	803,159.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	840,627.85	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	532,603.05	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	307,668.40	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,191,429.75	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,638,554.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	778,585.70	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,141,363.65	
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	982,984.80	
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	414,608.25	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	432,029.30	
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	676,054.40	
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,404,089.50	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,035,535.60	
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,343,671.40	
		シンガポールドル 小計	14,160,000.00	16,102,571.50 (1,257,288,782)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,548,772.50	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	736,610.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,840,000.00	2,958,839.80	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,625,877.40	

	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,269,016.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,096,433.55	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,143,093.90	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,562,947.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,752,013.80	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,533,417.50	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	774,071.25	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,108,692.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	808,190.30	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,235,581.55	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,168,162.30	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,573,149.60	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	654,987.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,775,689.40	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,101,660.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,049,330.50	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	818,254.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	479,901.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,381,529.60	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,260,970.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	898,739.55	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,713,938.80	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,751,613.20	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,980,000.00	2,310,877.80	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,712,907.60	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,673,756.00	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	952,112.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,252,566.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	2,550,000.00	3,030,088.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,763,013.00	
	マレーシアリングット 小計	51,270,000.00	56,476,803.40 (1,444,111,862)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 04/30/25	250,000.00	251,876.55	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,837,579.22	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	930,000.00	998,581.73	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,770,000.00	1,823,348.50	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,160,000.00	2,447,195.54	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,590,567.12	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,420,000.00	3,564,996.38	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,274,593.08	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,600,284.99	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,158,229.95	

	イスラエルシェケル 小計	29,070,000.00	35,547,253.06 (1,123,648,669)	
	合計		284,491,484,129 (284,491,484,129)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 200銘柄	100.0%	44.2%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 319銘柄	100.0%	41.3%
イギリスポンド	国債証券 46銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 25銘柄	100.0%	2.4%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 34銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 10銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2020年 8月28日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	825,376,320
コール・ローン	1,374,494,241
国債証券	56,921,235,957
未収利息	721,255,033
前払費用	84,633,012
流動資産合計	59,926,994,563
資産合計	59,926,994,563
負債の部	
流動負債	
未払解約金	28,944,409
未払利息	2,669
流動負債合計	28,947,078
負債合計	28,947,078
純資産の部	
元本等	
元本	36,297,390,834
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	23,600,656,651
元本等合計	59,898,047,485
純資産合計	59,898,047,485
負債純資産合計	59,926,994,563

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		36,297,390,834口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6502円 (16,502円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 8月28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

	2020年 8月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	29,737,144,056円
期中追加設定元本額	9,111,242,174円
期中一部解約元本額	2,550,995,396円
期末元本額	36,297,390,834円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国債券インデックス・オープン	4,227,893,419円
世界経済インデックスファンド	6,240,847,473円
D C 新興国債券インデックス・オープン	4,641,428,197円
D C 世界経済インデックスファンド	8,016,261,000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)	1,814,122,098円
コア投資戦略ファンド(安定型)	138,847,350円
コア投資戦略ファンド(成長型)	407,214,225円

区分	2020年 8月28日現在
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	87,053,740円
分散投資コア戦略ファンドA	248,881,880円
分散投資コア戦略ファンドS	1,192,669,310円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	294,799,693円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,751,779,663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）	188,874,936円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	87,381,100円
SMT インデックスバランス・オープン	159,344,864円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,306,785,380円
SMT 世界経済インデックス・オープン	152,103,006円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	155,654,964円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	261,500,561円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,723,874円
グローバル経済コア	696,179,249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	408,579円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	495,754円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	250,972円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	161,465円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	90,279,507円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	90,899,620円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	302,662,308円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	318,298,450円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	303,324,436円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	681,629,197
合計	681,629,197

(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	41,269,536.00	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	97,830,206.25	
		MBONO 5.75% 03/05/26	61,800,000.00	63,135,189.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	111,674,843.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	47,450,000.00	49,712,653.25	
		MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000.00	85,172,348.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	120,351,061.75	
		MBONO 7.75% 05/29/31	56,200,000.00	63,446,709.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	67,125,097.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	29,200,000.00	32,886,792.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	98,800,000.00	116,613,146.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	57,450,000.00	67,923,135.00	
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	82,059,668.50	
		MBONO 8% 11/07/47	68,850,000.00	76,836,944.25	
		MBONO 8% 12/07/23	111,400,000.00	122,006,951.00	
	メキシコペソ 小計		1,078,850,000.00	1,198,044,280.50 (5,774,573,432)	
ブラジルレアル	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	27,461,862.43	
		BLTN 0% 01/01/24	34,850,000.00	29,276,537.08	
		BLTN 0% 07/01/22	27,550,000.00	25,840,974.32	
		BLTN 0% 07/01/23	53,750,000.00	47,341,306.87	
		BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000.00	42,465,601.53	
		BNTNF 10% 01/01/25	35,250,000.00	40,642,936.16	
		BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000.00	27,870,617.32	
		BNTNF 10% 01/01/29	13,200,000.00	15,650,528.48	
		BNTNF 10% 01/01/31	3,200,000.00	3,817,886.71	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,712,375.00	
		BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	507,937.50	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,130,375.00	
			ブラジルレアル 小計		261,800,000.00
チリペソ	BTPCL 2.5% 03/01/25		1,890,000,000.00	1,993,007,330.37	

	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,855,000,000.00	2,153,317,796.24	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,370,000,000.00	1,653,948,827.66	
	BTPCL 4% 03/01/23	945,000,000.00	1,031,565,754.48	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,110,000,000.00	2,665,040,703.26	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,650,000,000.00	2,441,860,992.45	
	チリペソ 小計	9,820,000,000.00	11,938,741,404.46 (1,621,281,082)	
コロンビア ペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	4,600,000,000.00	4,650,554,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	91,200,000,000.00	117,424,104,000.00	
	コロンビアペソ 小計	95,800,000,000.00	122,074,658,000.00 (3,405,882,958)	
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,978,084.50	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,400,000.00	5,786,532.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,650,000.00	4,272,142.50	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,471,427.25	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	8,191,120.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,200,000.00	9,949,470.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	9,023,700.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,200,000.00	7,744,885.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,470,853.75	
	ペルーヌエボソル 小計	54,700,000.00	64,888,215.00 (1,941,455,392)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	15,750,306.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,874,056.75	
	ウルグアイペソ 小計	32,950,000.00	33,624,362.75 (84,060,906)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,363,892.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	25,382,250.00	
	ドミニカペソ 小計	45,400,000.00	45,746,142.00 (83,715,439)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,604,296.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	7,476,022.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	8,737,560.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	8,150,000.00	7,755,703.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,150,000.00	8,138,833.50	
	TURKGB 11% 03/02/22	6,550,000.00	6,352,943.25	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,652,104.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	4,901,884.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,346,380.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,359,466.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	5,938,822.50	
	TURKGB 8% 03/12/25	7,100,000.00	5,793,529.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,600,000.00	10,227,834.00	

	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,863,980.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,290,680.00	
トルコリラ 小計		107,950,000.00	99,440,037.25	(1,440,886,139)
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	46,725,702.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	50,000,000.00	50,097,250.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	41,600,000.00	41,388,256.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	30,900,000.00	31,415,103.00	
	CZGB 1% 06/26/26	75,100,000.00	76,077,802.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	55,953,977.50	
	CZGB 2.5% 08/25/28	55,000,000.00	61,466,900.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	56,111,166.00	
	CZGB 2% 10/13/33	52,350,000.00	57,939,671.25	
	CZGB 3.85% 09/29/21	48,000,000.00	49,956,720.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	44,400,000.00	48,535,194.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	45,221,338.50	
	チェココルナ 小計		583,950,000.00	620,889,080.25
ハンガリーフォロント	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	566,452,425.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	574,547,860.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	265,000,000.00	271,214,250.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	570,500,000.00	605,833,917.50	
	HGB 3.25% 10/22/31	232,000,000.00	254,282,440.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	428,662,500.00	
	HGB 3% 08/21/30	502,000,000.00	535,837,310.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	637,450,800.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	785,667,300.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	612,065,115.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	450,035,960.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	312,698,400.00	
	ハンガリーフォロント 小計		5,470,000,000.00	6,034,748,277.50
ポーランドズロチ	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,431,940.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	8,850,000.00	9,464,145.75	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	21,015,892.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000.00	16,066,765.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000.00	17,905,167.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,950,000.00	16,319,793.75	
	POLGB 2.75% 04/25/28	12,950,000.00	14,380,457.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000.00	16,914,394.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,843,047.50	
	POLGB 4% 10/25/23	14,050,000.00	15,680,221.50	

	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,108,111.75
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,100,000.00	7,571,156.00
ポーランドズロチ 小計		160,350,000.00	174,701,091.75 (4,991,210,191)
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	171,786,706.00
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	168,211,540.00
	RFLB 6% 10/06/27	173,000,000.00	175,929,755.00
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	190,799,805.00
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	176,635,599.00
	RFLB 7.15% 11/12/25	172,400,000.00	186,946,250.00
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	174,437,017.50
	RFLB 7.4% 07/17/24	168,200,000.00	182,592,033.00
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	175,110,838.50
	RFLB 7.6% 07/20/22	198,700,000.00	210,019,939.00
	RFLB 7.65% 04/10/30	196,500,000.00	219,207,540.00
	RFLB 7.7% 03/16/39	126,500,000.00	145,014,540.00
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	177,978,310.00
	RFLB 7.75% 09/16/26	180,500,000.00	201,799,000.00
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	204,273,885.00
	RFLB 7% 01/25/23	53,200,000.00	56,074,662.00
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	113,949,312.00
	RFLB 7% 12/15/21	132,500,000.00	136,944,050.00
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	177,988,980.00
	RFLB 8.5% 09/17/31	132,150,000.00	157,294,841.25
ロシアルーブル 小計		3,123,650,000.00	3,402,994,603.25 (4,832,252,336)
マレーシア リンギット	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,419,345.00
	MGS 3.48% 03/15/23	10,750,000.00	11,199,833.75
	MGS 3.502% 05/31/27	8,200,000.00	8,829,268.00
	MGS 3.62% 11/30/21	10,700,000.00	10,950,380.00
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,549,333.25
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,086,243.50
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	9,129,469.50
	MGS 3.828% 07/05/34	11,500,000.00	12,536,552.50
	MGS 3.885% 08/15/29	15,650,000.00	17,326,271.50
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,857,965.00
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,794,343.25
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	9,169,818.00
	MGS 3.955% 09/15/25	9,400,000.00	10,240,172.00
	MGS 4.059% 09/30/24	16,500,000.00	17,796,817.50
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	10,199,574.00
	MGS 4.762% 04/07/37	6,700,000.00	7,857,090.00
		154,400,000.00	166,942,476.75

マレーシアリングット 小計			(4,268,719,130)
タイバーツ	THA1GB 1.45% 12/17/24	75,500,000.00	77,536,235.00
	THA1GB 1.6% 06/17/35	37,400,000.00	37,361,852.00
	THA1GB 1.6% 12/17/29	52,700,000.00	53,753,736.50
	THA1GB 1.875% 06/17/22	75,300,000.00	77,135,061.00
	THA1GB 2.125% 12/17/26	88,100,000.00	94,046,309.50
	THA1GB 2.4% 12/17/23	101,000,000.00	106,832,750.00
	THA1GB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	73,810,767.00
	THA1GB 2% 12/17/22	84,500,000.00	87,315,962.50
	THA1GB 3.3% 06/17/38	136,400,000.00	164,885,094.00
	THA1GB 3.4% 06/17/36	133,500,000.00	164,328,487.50
	THA1GB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	91,098,000.00
	THA1GB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	138,124,692.00
	THA1GB 3.65% 12/17/21	63,100,000.00	65,666,908.00
	THA1GB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	99,445,152.00
	THA1GB 3.85% 12/12/25	82,400,000.00	94,833,336.00
	THA1GB 4.875% 06/22/29	101,400,000.00	131,292,213.00
タイバーツ 小計		1,375,400,000.00	1,557,466,556.00 (5,310,960,955)
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,333,450.00
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	38,980,800.00
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	54,314,250.00 (118,948,207)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,230,631,000.00
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,901,295,000.00
	INDOGB 5.625% 05/15/23	35,900,000,000.00	36,871,813,000.00
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	34,971,480,000.00
	INDOGB 6.5% 06/15/25	44,100,000,000.00	45,992,992,500.00
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	23,033,640,000.00
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	19,501,974,500.00
	INDOGB 7.5% 06/15/35	20,200,000,000.00	20,532,795,000.00
	INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	25,649,250,000.00
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,468,112,000.00
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	38,277,520,000.00
	INDOGB 7% 09/15/30	32,200,000,000.00	32,759,958,000.00
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	39,113,542,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/29	38,000,000,000.00	41,940,220,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	35,931,530,000.00
	INDOGB 8.25% 06/15/32	30,400,000,000.00	32,750,832,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/24	72,600,000,000.00	79,997,577,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	56,853,160,000.00
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,998,608,000.00
INDOGB 8.375% 09/15/26	36,300,000,000.00	40,732,230,000.00	

	INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	36,953,452,500.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,358,862,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	33,700,000,000.00	38,535,107,500.00	
	インドネシアルピア 小計	730,000,000,000.00	783,356,582,000.00 (5,718,503,048)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	115,000,000.00	132,632,950.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	22,949,365.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,900,000.00	29,709,743.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	52,000,000.00	55,887,260.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	34,365,243.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	43,755,690.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	55,115,605.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	53,316,373.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	69,376,723.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	52,810,264.00	
	SAGB 8% 01/31/30	89,900,000.00	82,675,636.00	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	28,643,300.00	
		南アフリカランド 小計	753,450,000.00	661,238,153.50 (4,132,738,459)
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	14,000,000.00	13,418,440.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	7,300,000.00	7,197,471.50	
	CGB 2.68% 05/21/30	10,000,000.00	9,687,450.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000.00	43,021,285.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	11,000,000.00	11,026,950.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	10,000,000.00	10,001,400.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	6,000,000.00	6,060,210.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,162,900.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000.00	35,379,925.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	20,200,000.00	20,396,243.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,326,950.00	
	香港・オフショア人民元 小計	194,500,000.00	194,679,224.50 (3,017,527,979)	
	合計		56,921,235,957 (56,921,235,957)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	8.9%
チリペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	2.8%
コロンビアペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	6.0%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	3.4%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	2.5%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	5.2%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	3.8%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	8.8%
ロシアルーブル	国債証券 20銘柄	100.0%	8.5%
マレーシアリングgit	国債証券 16銘柄	100.0%	7.5%
タイバーツ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.3%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券 23銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	7.3%
香港・オフショア人民元	国債証券 11銘柄	100.0%	5.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

(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3期中間計算期間(2020年8月29日から2021年2月28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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	762,713	208,533
投資信託受益証券	1,767,030	4,494,740
親投資信託受益証券	6,588,066	14,310,006
未収入金	-	5,571
流動資産合計	9,117,809	19,018,850
資産合計	9,117,809	19,018,850
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	7,605
未払受託者報酬	945	2,990
未払委託者報酬	8,502	26,881
未払利息	1	-
その他未払費用	56	310
流動負債合計	9,504	37,786
負債合計	9,504	37,786
純資産の部		
元本等		
元本	8,374,607	16,268,708
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	733,698	2,712,356
(分配準備積立金)	395,931	375,922
元本等合計	9,108,305	18,981,064
純資産合計	9,108,305	18,981,064
負債純資産合計	9,117,809	19,018,850

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
営業収益		
受取配当金	1,305	29,670
有価証券売買等損益	145,607	987,105
営業収益合計	144,302	1,016,775
営業費用		
支払利息	-	4
受託者報酬	160	2,990
委託者報酬	1,044	26,881
その他費用	-	310
営業費用合計	1,204	30,185
営業利益又は営業損失（ ）	145,506	986,590
経常利益又は経常損失（ ）	145,506	986,590
中間純利益又は中間純損失（ ）	145,506	986,590
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（ ）	-	4,207
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,679	733,698
剰余金増加額又は欠損金減少額	250,894	1,043,948
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	250,894	1,043,948
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	47,673
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	47,673
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	93,709	2,712,356

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,374,607口	16,268,708口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0876円 (10,876円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1667円 (11,667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3期中間計算期間 (2021年 2月28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。

	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	8,374,607円
期中追加設定元本額	10,722,971円	8,419,740円
期中一部解約元本額	2,848,364円	525,639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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

(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3期中間計算期間(2020年8月29日から2021年2月28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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	266,568	518,052
投資信託受益証券	1,580,231	2,659,140
親投資信託受益証券	8,426,855	14,529,498
流動資産合計	10,273,654	17,706,690
資産合計		
	10,273,654	17,706,690
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	336,671
未払受託者報酬	1,063	2,770
未払委託者報酬	9,530	24,863
未払利息	-	1
その他未払費用	73	281
流動負債合計	10,666	364,586
負債合計		
	10,666	364,586
純資産の部		
元本等		
元本	9,496,592	14,767,772
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	766,396	2,574,332
(分配準備積立金)	722,152	672,637
元本等合計	10,262,988	17,342,104
純資産合計		
	10,262,988	17,342,104
負債純資産合計		
	10,273,654	17,706,690

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
営業収益		
受取配当金	855	15,822
有価証券売買等損益	2,226	1,062,611
営業収益合計	3,081	1,078,433
営業費用		
支払利息	-	3
受託者報酬	150	2,770
委託者報酬	953	24,863
その他費用	-	281
営業費用合計	1,103	27,917
営業利益又は営業損失（ ）	1,978	1,050,516
経常利益又は経常損失（ ）	1,978	1,050,516
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,978	1,050,516
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（ ）	-	43,539
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,174	766,396
剰余金増加額又は欠損金減少額	38,336	870,672
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	38,336	870,672
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	69,713
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	69,713
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	23,140	2,574,332

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,496,592口	14,767,772口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0807円 (10,807円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1743円 (11,743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3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。

	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	9,496,592円
期中追加設定元本額	9,066,056円	6,065,590円
期中一部解約元本額	69,464円	794,410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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

(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3期中間計算期間(2020年8月29日から2021年2月28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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,420	65,754
投資信託受益証券	373,393	458,735
親投資信託受益証券	4,509,499	6,153,097
未収入金	-	7,136
流動資産合計	4,946,312	6,684,722
資産合計	4,946,312	6,684,722
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	7,814
未払受託者報酬	369	1,270
未払委託者報酬	3,301	11,236
その他未払費用	7	76
流動負債合計	3,677	20,396
負債合計	3,677	20,396
純資産の部		
元本等		
元本	4,576,106	5,605,935
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	366,529	1,058,391
(分配準備積立金)	295,442	275,658
元本等合計	4,942,635	6,664,326
純資産合計	4,942,635	6,664,326
負債純資産合計	4,946,312	6,684,722

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
営業収益		
受取配当金	405	3,662
有価証券売買等損益	30,665	572,244
営業収益合計	31,070	575,906
営業費用		
受託者報酬	151	1,270
委託者報酬	935	11,236
その他費用	-	76
営業費用合計	1,086	12,582
営業利益又は営業損失（ ）	29,984	563,324
経常利益又は経常損失（ ）	29,984	563,324
中間純利益又は中間純損失（ ）	29,984	563,324
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（ ）	-	5,981
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	22,715	366,529
剰余金増加額又は欠損金減少額	87	148,110
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	87	148,110
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	25,553
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	25,553
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,356	1,058,391

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,576,106口	5,605,935口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0801円 (10,801円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1888円 (11,888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3期中間計算期間 (2021年 2月28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。

	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	4,576,106円
期中追加設定元本額	4,213,212円	1,348,426円
期中一部解約元本額	137,106円	318,597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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

(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3期中間計算期間(2020年8月29日から2021年2月28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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,630	76,326
親投資信託受益証券	2,946,608	10,412,587
未収入金	-	281,561
流動資産合計	2,981,238	10,770,474
資産合計	2,981,238	10,770,474
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,007	7,911
未払受託者報酬	309	1,561
未払委託者報酬	2,729	13,889
その他未払費用	9	144
流動負債合計	5,054	23,505
負債合計	5,054	23,505
純資産の部		
元本等		
元本	2,746,642	8,908,450
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	229,542	1,838,519
(分配準備積立金)	256,038	209,321
元本等合計	2,976,184	10,746,969
純資産合計	2,976,184	10,746,969
負債純資産合計	2,981,238	10,770,474

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	34,143	959,464
営業収益合計	34,143	959,464
営業費用		
支払利息	-	1
受託者報酬	151	1,561
委託者報酬	933	13,889
その他費用	-	144
営業費用合計	1,084	15,595
営業利益又は営業損失（ ）	33,059	943,869
経常利益又は経常損失（ ）	33,059	943,869
中間純利益又は中間純損失（ ）	33,059	943,869
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（ ）	-	27,221
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	27,667	229,542
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	775,261
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	775,261
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	82,932
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	82,932
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,392	1,838,519

(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2期 (2020年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2021年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,746,642口	8,908,450口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0836円 (10,836円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2064円 (12,064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3期中間計算期間 (2021年 2月28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3期中間計算期間 (2021年 2月28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2期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	第3期中間計算期間 自 2020年 8月29日 至 2021年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	2,746,642円
期中追加設定元本額	2,820,411円	7,305,169円
期中一部解約元本額	573,769円	1,143,361円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,471,405,304
株式	447,390,619,720

	2021年 2月28日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	19,146,000
未収入金	42,806,320
未収配当金	639,907,714
前払金	25,520,700
差入委託証拠金	55,900,000
流動資産合計	451,645,305,758
資産合計	451,645,305,758
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,696,400
未払金	1,063,767,524
未払解約金	525,619,734
未払利息	3,373
流動負債合計	1,634,087,031
負債合計	1,634,087,031
純資産の部	
元本等	
元本	252,606,378,179
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	197,404,840,548
元本等合計	450,011,218,727
純資産合計	450,011,218,727
負債純資産合計	451,645,305,758

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2021年 2月28日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	252,606,378,179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 1.7815円 (1万口当たり純資産額) (17,815円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 2月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	217,774,818,206円
期中追加設定元本額	71,044,068,756円
期中一部解約元本額	36,212,508,783円
期末元本額	252,606,378,179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）	463,449,529円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,846,253,268円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,728,838円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,756,435,362円
世界経済インデックスファンド	2,456,485,397円
日本株式インデックス・オープン	3,680,818,443円
D C マイセレクション 2 5	5,991,669,950円
D C マイセレクション 5 0	18,519,058,613円
D C マイセレクション 7 5	17,687,776,572円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,761,182,848円
D C マイセレクション S 2 5	2,703,780,206円
D C マイセレクション S 5 0	8,101,703,445円
D C マイセレクション S 7 5	5,452,399,542円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,255,764,305円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	244,316,809円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	626,979,051円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	444,600,707円
D C 世界経済インデックスファンド	3,077,954,618円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,492,256,986円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,224,442円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,856,807円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	26,689,743円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	211,180,910円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,374,438円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	54,172,064円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	184,556,224円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	38,895,653円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	122,148,642円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,250,828,095円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	509,687,250円

区分	2021年 2月28日現在
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,331,659,885円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	422,872,715円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	29,440,616円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	586,600,199円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	329,713,689円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	419,688,397円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	43,585,582円
F O F s用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	724,278,088円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,740,289,815円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,746,720,296円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,785,879,261円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,402,139,372円
分散投資コア戦略ファンドA	2,126,539,021円
分散投資コア戦略ファンドS	7,599,494,108円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	361,675,385円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	369,268,720円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,068,851,194円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	199,400,111円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,460,401円
S M T インデックスバランス・オープン	60,226,001円
国内株式S M T Bセレクション（S M A専用）	25,977,628,306円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	664,537,692円
S M T 世界経済インデックス・オープン	30,156,425円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	95,312,861円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	16,692,903円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,223,575円
グローバル経済コア	236,006,007円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	21,514,013円
i - S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）	46,097,035円
D Cターゲット・イヤーフンド2055	5,914,037円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,165,179,546円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	109,263,877円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	560,317円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	578,410円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	245,002円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	418,748円
F O F s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）	43,039,050,242円
F O F s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）	1,321,465,188円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	133,435,257円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,320,496円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	424,839,755円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,919,926,874円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,519,935,700	-	2,494,415,000	25,520,700
合計		2,519,935,700	-	2,494,415,000	25,520,700

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 2月28日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,340,102,906
コール・ローン	599,522,807
株式	456,306,430,600
投資信託受益証券	302,983,606
投資証券	9,999,160,988
派生商品評価勘定	100,219,752
未収入金	1,639,430
未収配当金	636,062,396
差入委託証拠金	2,119,049,498
流動資産合計	476,405,171,983
資産合計	476,405,171,983
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	96,883,329
前受金	2,883,133
未払解約金	681,254,518
未払利息	582
流動負債合計	781,021,562
負債合計	781,021,562
純資産の部	
元本等	
元本	143,456,227,057
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	332,167,923,364
元本等合計	475,624,150,421
純資産合計	475,624,150,421
負債純資産合計	476,405,171,983

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2021年 2月28日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	143,456,227,057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 3.3155円 (1万口当たり純資産額) (33,155円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 2月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

	2021年 2月28日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	147,798,871,638円
期中追加設定元本額	11,647,550,388円
期中一部解約元本額	15,990,194,969円
期末元本額	143,456,227,057円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,122,309,840円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,578,185円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,762,885,488円
世界経済インデックスファンド	7,967,466,647円
外国株式インデックス・オープン	814,190,982円
D C マイセレクション 2 5	832,680,518円
D C マイセレクション 5 0	4,465,537,185円
D C マイセレクション 7 5	4,958,687,506円
D C 外国株式インデックス・オープン	10,418,274,891円
D C マイセレクション S 2 5	375,266,915円
D C マイセレクション S 5 0	1,909,785,293円
D C マイセレクション S 7 5	1,522,408,881円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	66,727,788円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	171,242,241円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	121,431,363円
D C 世界経済インデックスファンド	10,031,579,602円

区分	2021年 2月28日現在
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,799,203,003円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	6,393,585円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,289,144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）	31,790,289円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	29,989,440円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	101,867,440円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	21,529,692円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	67,751,450円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	471,596,272円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	247,036,999円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,838,397,517円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,165,852,393円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	48,665,884円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	240,522,594円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	78,455,288円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,376,480,314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）	1,626,726,331円
外国株式ファンド・シリーズ1	963,112,214円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,507,910,861円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,040,519,229円
分散投資コア戦略ファンドA	2,223,777,748円
分散投資コア戦略ファンドS	10,496,741,053円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,215,967,612円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,145,720,082円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,164,182,529円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	666,116,108円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,181,317円
SMT インデックスバランス・オープン	183,024,421円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	851,075,397円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	29,623,231,242円
SMT 世界経済インデックス・オープン	150,095,826円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	480,145,625円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	82,511,701円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,020,089円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	88,515,019円
グローバル経済コア	761,886,800円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,945,834円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,615,290円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	718,403,150円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	68,083,059円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	1,799,931円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	1,841,346円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	787,170円

区分	2021年 2月28日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,355,635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）	729,436,983円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,486,767,595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）	1,694,762,820円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	671,196,165円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	108,295,725円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	321,937,393円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	311,188,833円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	321,854,368円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	310,546,084円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	306,073,843円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	8,812,029,656	-	8,814,912,789	2,883,133
合計		8,812,029,656	-	8,814,912,789	2,883,133

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	167,565,990	-	167,112,700	453,290
	アメリカドル	106,050,000	-	106,240,000	190,000
	イギリスポンド	61,515,990	-	60,872,700	643,290
合計		167,565,990	-	167,112,700	453,290

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,534,911,096
コール・ローン	86,555,135
株式	87,438,846,258
投資信託受益証券	179,790,745
投資証券	65,433,841
派生商品評価勘定	38,797,544
未収配当金	176,756,193
前払金	1,551,251
差入委託証拠金	735,101,851
流動資産合計	92,257,743,914
資産合計	92,257,743,914
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,260,163
未払金	93,396,495
未払株式払込金	336,330
未払解約金	23,713,591
未払利息	84
流動負債合計	157,706,663
負債合計	157,706,663
純資産の部	
元本等	
元本	24,833,151,994
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	67,266,885,257
元本等合計	92,100,037,251
純資産合計	92,100,037,251
負債純資産合計	92,257,743,914

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2021年 2月28日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2021年 2月28日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	24,833,151,994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 3.7088円 (1万口当たり純資産額) (37,088円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 2月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	25,806,472,250円
期中追加設定元本額	1,636,972,404円
期中一部解約元本額	2,610,292,660円
期末元本額	24,833,151,994円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,244,355,397円
世界経済インデックスファンド	3,606,609,240円
D C 新興国株式インデックス・オープン	4,769,129,075円
D C 世界経済インデックスファンド	4,528,922,832円
新興国株式インデックス・オープン（S M A専用）	195,013,027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
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	555,677,058円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	523,499,242円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	303,383,007円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	15,619,261円
S M T インデックスバランス・オープン	84,066,848円
S M T 世界経済インデックス・オープン	100,598,095円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	324,533,510円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	55,159,939円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,613,621円
グローバル経済コア	349,839,270円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	31,434,475円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	861,648円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	881,553円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	386,383円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	642,996円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	457,621,811円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	72,456,854円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,507,215,313	-	4,505,664,062	1,551,251
合計		4,507,215,313	-	4,505,664,062	1,551,251

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	163,856,722	-	163,945,929	89,207
	アメリカドル	163,518,400	-	163,609,600	91,200
	ブラジルリアル	338,322	-	336,329	1,993
	売建	338,322	-	338,897	575
	アメリカドル	338,322	-	338,897	575
合計		164,195,044	-	164,284,826	88,632

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	637,233,537
国債証券	503,787,131,650
地方債証券	32,688,822,883
特殊債券	41,048,085,465
社債券	26,337,507,180
未収入金	10,633,839,960
未収利息	1,340,280,952
前払費用	32,208,273
流動資産合計	616,505,109,900
資産合計	616,505,109,900
負債の部	
流動負債	
未払金	10,578,939,380
未払解約金	250,162,798
未払利息	619
流動負債合計	10,829,102,797
負債合計	10,829,102,797
純資産の部	
元本等	
元本	434,122,212,603
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	171,553,794,500
元本等合計	605,676,007,103
純資産合計	605,676,007,103
負債純資産合計	616,505,109,900

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	434,122,212,603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 100,457,000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 1.3952円 (1万口当たり純資産額) (13,952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

	2021年 2月28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	2021年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	393,683,774,509円
期中追加設定元本額	48,917,285,194円
期中一部解約元本額	8,478,847,100円
期末元本額	434,122,212,603円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,639,172,085円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,057,034円
S M T 国内債券インデックス・オープン	19,621,629,967円
世界経済インデックスファンド	2,182,848,808円
D C マイセレクション 2 5	24,028,952,135円
D C マイセレクション 5 0	25,812,828,634円
D C マイセレクション 7 5	7,091,633,894円
D C 日本債券インデックス・オープン	439,418,111円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,065,102,559円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,781,821,897円
D C マイセレクション S 2 5	10,300,444,759円
D C マイセレクション S 5 0	11,219,038,359円
D C マイセレクション S 7 5	2,197,552,048円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	952,271,414円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,770,710,360円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	640,528,748円
D C 世界経済インデックスファンド	2,790,570,462円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,078,884円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,643,195円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	41,040,880円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,452,405円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,015,770円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	137,488,246円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	207,325,695円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	46,563,304円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	42,580,705円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,585,976,789円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	866,013,312円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,305,119,605円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	631,776,607円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	80,795,728円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,165,723,951円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,279,715,358円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,546,147,444円

区分	2021年 2月28日現在
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	153,008,680円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,037,126,780円
日本債券ファンド・シリーズ1	12,934,023,328円
分散投資コア戦略ファンドA	25,237,317,543円
分散投資コア戦略ファンドS	24,980,389,432円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	107,592,628円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,076,426,805円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	51,306,034円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,764,522円
S M T インデックスバランス・オープン	52,877,101円
S M T 世界経済インデックス・オープン	20,070,848円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	33,996,285円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	50,533,266円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,656,705円
グローバル経済コア	195,155,267円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	20,064,255円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	4,015,305円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	829,464円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	612,593円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	179,226円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	135,485円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	76,580,679,939円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	32,184,720円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	435,424,769
コール・ローン	3,892,057,733
国債証券	278,544,931,055
派生商品評価勘定	44,586,201
未収入金	7,946,555
未収利息	1,736,040,637
前払金	46,386,979

	2021年 2月28日現在
項目	金額（円）
前払費用	45,416,168
差入委託証拠金	409,810,212
流動資産合計	285,162,600,309
資産合計	285,162,600,309
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,392,742
未払解約金	381,795,744
未払利息	3,782
流動負債合計	428,192,268
負債合計	428,192,268
純資産の部	
元本等	
元本	96,070,399,531
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	188,664,008,510
元本等合計	284,734,408,041
純資産合計	284,734,408,041
負債純資産合計	285,162,600,309

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2021年 2月28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)

2021年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,070,399,531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 2.9638円 (1万口当たり純資産額) (29,638円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 2月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	97,121,104,574円
期中追加設定元本額	7,671,956,032円
期中一部解約元本額	8,722,661,075円
期末元本額	96,070,399,531円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,480,406,570円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	606,911,047円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,027,564,263円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,384,955円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,927,731,059円
世界経済インデックスファンド	8,361,432,660円
D C マイセレクション 2 5	1,877,021,245円
D C マイセレクション 5 0	1,508,294,066円
D C マイセレクション 7 5	889,138,056円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,095,938,855円
D C マイセレクション S 2 5	811,088,250円
D C マイセレクション S 5 0	652,089,813円
D C マイセレクション S 7 5	290,245,610円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	37,377,604円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	78,277,605円

区分	2021年 2月28日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	39,412,608円
DC世界経済インデックスファンド	10,594,560,724円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	670,644,384円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	8,282,141円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,401,682円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,604,824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)	33,332,691円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	73,979,478円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	115,578,634円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	109,848,815円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	114,782,770円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,656,526,757円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	508,169,981円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,870,670,915円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	621,026,124円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	60,646,595円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	531,014,954円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	197,802,700円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	235,711,300円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	824,540,673円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	1,091,722,312円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	767,291,156円
外国債券ファンド・シリーズ1	590,994,834円
コア投資戦略ファンド(安定型)	985,330,333円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,483,631,061円
分散投資コア戦略ファンドA	1,090,641,754円
分散投資コア戦略ファンドS	2,217,866,231円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	401,614,592円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,420,167,877円
コア投資戦略ファンド(切替型)	881,453,066円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,039,753円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	100,474,298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)	1,170,637,366円
SMT インデックスバランス・オープン	187,018,248円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	20,367,100,096円
SMT 世界経済インデックス・オープン	154,690,283円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	152,817,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	247,632,762円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,757,008円
グローバル経済コア	768,769,744円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,259,893円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	406,426円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	250,667,096円

区分	2021年 2月28日現在
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	541,730円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	652,517円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	301,221円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	576,195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)	540,852,610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)	10,458,732,669円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	340,286,470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)	358,123,780円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	136,574,929円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	304,653,038円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2021年 2月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,664,912,194	-	3,618,525,215	46,386,979
	合計	3,664,912,194	-	3,618,525,215	46,386,979

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年 2月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,556,337,562	-	3,600,918,000	44,580,438
	アメリカドル	1,561,803,383	-	1,577,367,000	15,563,617
	カナダドル	186,953,985	-	189,998,200	3,044,215
	ユーロ	1,548,794,670	-	1,569,294,000	20,499,330
	イギリスポンド	258,785,524	-	264,258,800	5,473,276
	合計	3,556,337,562	-	3,600,918,000	44,580,438

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	775,592,313
コール・ローン	835,223,204
国債証券	62,072,227,479
未収利息	926,018,316
前払費用	50,645,441
流動資産合計	64,659,706,753
資産合計	64,659,706,753
負債の部	
流動負債	
未払解約金	37,907,901
未払利息	811
流動負債合計	37,908,712
負債合計	37,908,712
純資産の部	
元本等	
元本	37,549,945,518
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	27,071,852,523
元本等合計	64,621,798,041
純資産合計	64,621,798,041
負債純資産合計	64,659,706,753

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2021年 2月28日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	37,549,945,518口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7210円 (1万口当たり純資産額) (17,210円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月28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。

	2021年 2月28日現在

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	36,297,390,834円
期中追加設定元本額	3,041,467,688円
期中一部解約元本額	1,788,913,004円
期末元本額	37,549,945,518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	4,272,440,401円
世界経済インデックスファンド	6,909,793,452円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,767,129,645円
DC世界経済インデックスファンド	8,661,518,412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）	1,810,726,595円
コア投資戦略ファンド（安定型）	121,588,116円
コア投資戦略ファンド（成長型）	384,201,913円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	82,684,537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）	327,247,019円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,897,972,982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）	179,213,152円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	85,877,945円
SMT インデックスバランス・オープン	147,620,096円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,145,956,203円
SMT 世界経済インデックス・オープン	193,469,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	187,299,744円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	309,423,287円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,775,175円
グローバル経済コア	640,561,239円

区分	2021年 2月28日現在
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	805,116円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	776,269円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	308,503円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	517,423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）	78,664,427円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	182,736,690円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	300,211,439円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	307,077,025円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	296,287,712円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	291,979,501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】

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

【純資産額計算書】

（2021年 3月31日現在）

資産総額	20,351,688円
負債総額	7,461円
純資産総額（ - ）	20,344,227円
発行済口数	16,999,707口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1967円
（1万口当たり純資産額）	（11,967円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

【純資産額計算書】

（2021年 3月31日現在）

資産総額	18,329,719円
負債総額	6,717円
純資産総額（ - ）	18,323,002円
発行済口数	15,160,030口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2086円
（1万口当たり純資産額）	（12,086円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

【純資産額計算書】

（2021年 3月31日現在）

資産総額	7,252,487円
負債総額	2,618円
純資産総額（ - ）	7,249,869円
発行済口数	5,905,463口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2277円
（1万口当たり純資産額）	（12,277円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

【純資産額計算書】

(2021年 3月31日現在)

資産総額	14,431,862円
負債総額	4,843円
純資産総額（ - ）	14,427,019円
発行済口数	11,543,160口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2498円
（1万口当たり純資産額）	（12,498円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 3月31日現在)

資産総額	471,189,899,302円
負債総額	322,160,155円
純資産総額（ - ）	470,867,739,147円
発行済口数	250,048,587,254口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8831円
（1万口当たり純資産額）	（18,831円）

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 3月31日現在)

資産総額	501,603,734,095円
負債総額	440,140,126円
純資産総額（ - ）	501,163,593,969円
発行済口数	141,658,377,699口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5378円
（1万口当たり純資産額）	（35,378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

（2021年 3月31日現在）

資産総額	94,177,616,246円
負債総額	117,669,248円
純資産総額（ - ）	94,059,946,998円
発行済口数	25,380,503,035口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7060円
（1万口当たり純資産額）	（37,060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

（2021年 3月31日現在）

資産総額	625,754,932,864円
負債総額	5,633,828,347円
純資産総額（ - ）	620,121,104,517円
発行済口数	441,384,593,193口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4049円
（1万口当たり純資産額）	（14,049円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 3月31日現在）

資産総額	293,737,070,023円
負債総額	91,892,180円
純資産総額（ - ）	293,645,177,843円
発行済口数	96,792,324,709口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0338円
（1万口当たり純資産額）	（30,338円）

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 3月31日現在）

資産総額	65,637,732,264円
負債総額	2,108,873円
純資産総額（ - ）	65,635,623,391円

発行済口数	38,203,123,765口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7181円
（1万口当たり純資産額）	（17,181円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 3月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

また、監査等委員以外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發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2021年 5月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年3月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	520	14,190,499
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	292,510
単位型公社債投資信託	44	284,118
合計	642	14,767,128

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

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

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	株主資本				
	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		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. 其他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	125 百万円	168 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40 "	99 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	164 "	183 "
有価証券評価差額	-	259 "
その他	82 "	151 "
繰延税金資産 合計	413 "	862 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	173 "	-
繰延ヘッジ損益	58 "	125 "
その他	38 "	35 "
繰延税金負債 合計	271 "	161 "
繰延税金資産の純額	141 "	700 "

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2020年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

資産の部

流動資産

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

固定資産

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

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473

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

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

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

中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

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

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

中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益剰余金			
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

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

重要な会計方針

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

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

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

（単位：百万円）

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

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

(デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

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

(関連情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

(注)1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常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5月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

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

(2)販売会社

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載すること

があります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2019年8月29日から2020年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2020年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2019年8月29日から2020年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2020年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2019年8月29日から2020年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2020年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2019年8月29日から2020年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2020年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年4月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2020年8月29日から2021年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2021年2月28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8月29日から2021年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年4月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2020年8月29日から2021年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2021年2月28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8月29日から2021年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年4月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2020年8月29日から2021年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2021年2月28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8月29日から2021年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年4月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2020年8月29日から2021年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2021年2月28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8月29日から2021年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。