【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月20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】	ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

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 4月21日から2021年10月20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＞
収益分配金の再投資の場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

DR(預託証券)とは

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券
①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。
(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。
(5)資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。
①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］
(1)年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
(2)年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
(3)年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
(4)年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
(5)年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］
(1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
(2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

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

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

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

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

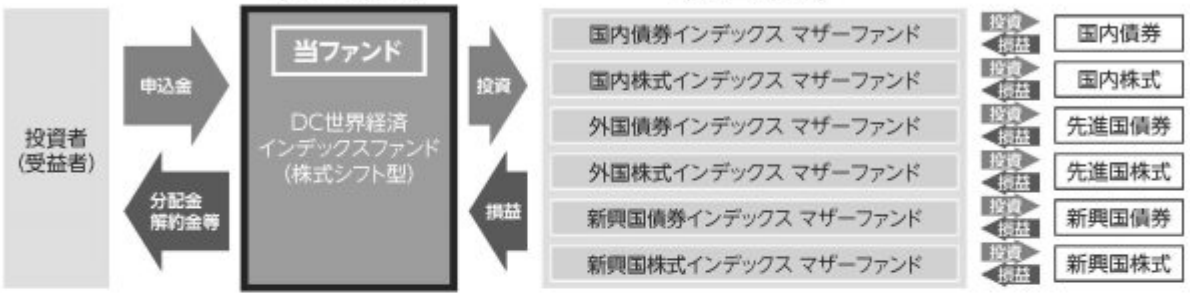
［特殊型］
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左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

＜ファンドの特色＞

1. 世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●世界の債券及び株式に分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
●各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)への連動を目指す運用を行います。
●原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ

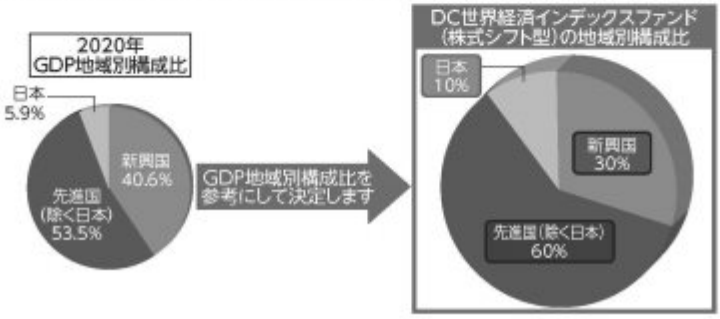


ファミリーファンド方式とは

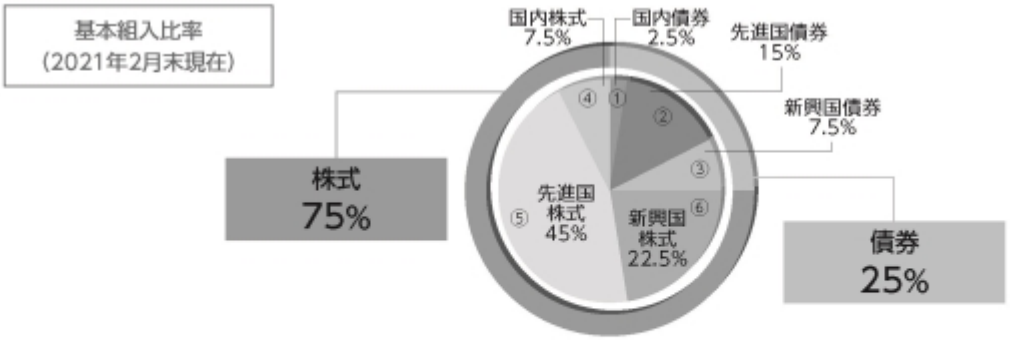
投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

2. 世界経済全体の発展を享受します。

●基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定します。
※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行います。
※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



(出所)IMF「世界経済見通し2020年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
※上記のファンドの地域別構成比は、2021年2月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



●基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
●基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合もあります。

資産	インデックス
①国内債券	NOMURA-BPI 総合※1

②先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）※2
③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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）※3
④国内株式	TOPIX（東証株価指数）※4
⑤先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）※5
⑥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）※6

＊ 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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

※1「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。

※2「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。

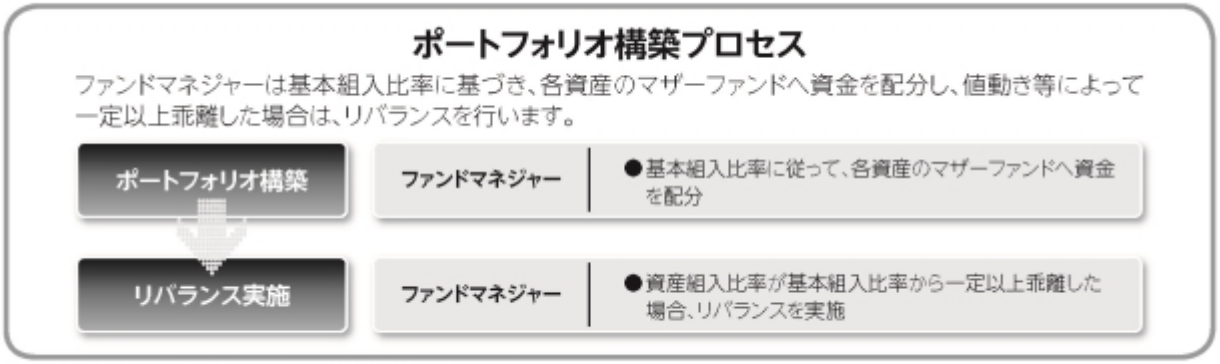
※3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。
同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

※5「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。

※6「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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

●原則として、毎年1月20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

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

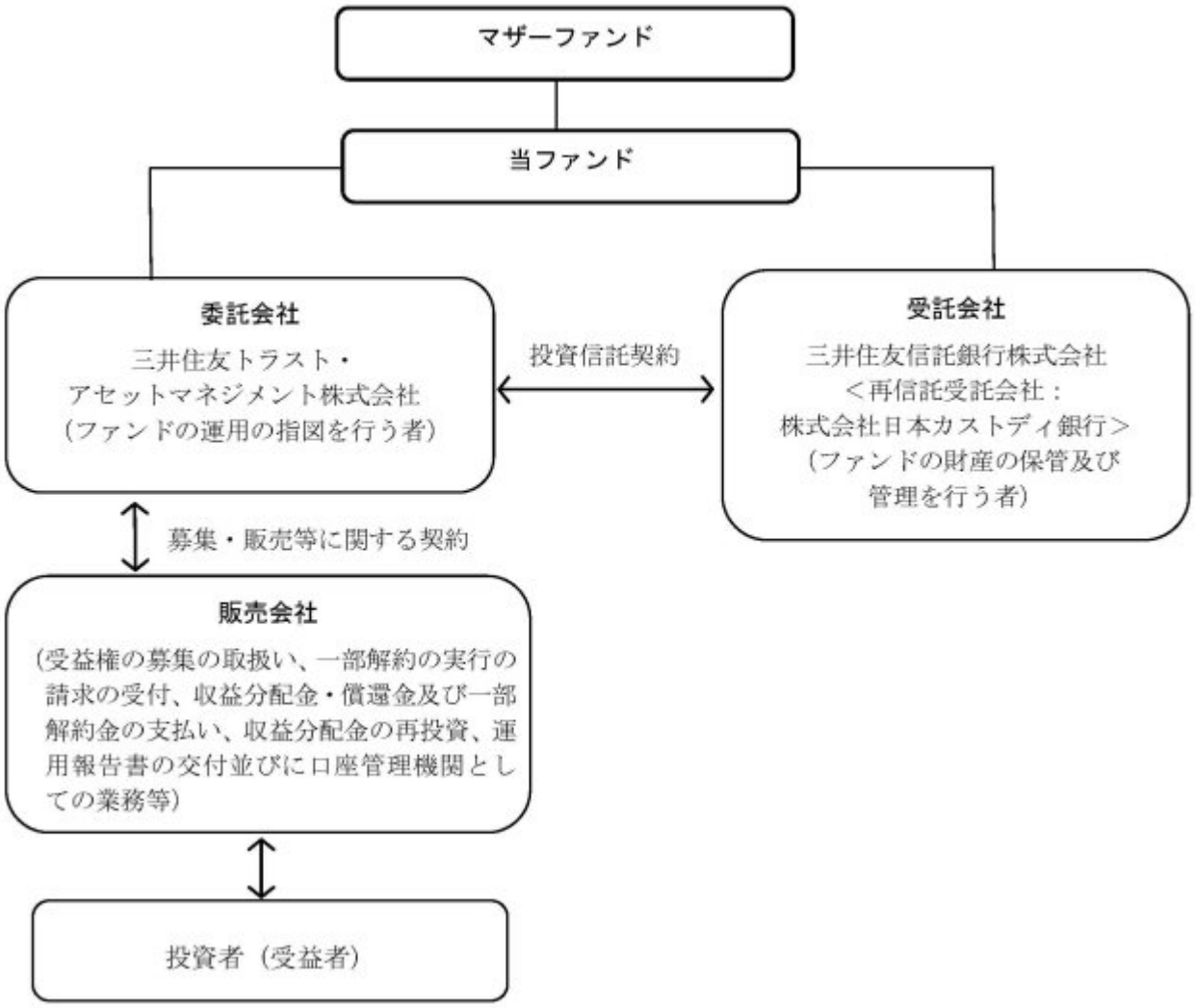
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2013年7月12日　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2021年 2月26日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもと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。

②投資対象

「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下総称して、又はそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下総称して、又はそれぞれを「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

③投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

ロ．株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式75%、債券25%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。

ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1.有価証券

2.デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第21条、第22条及び第23条に定めるものに限ります。）

3.金銭債権

4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として、次に掲げる第1号から第6号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに第7号から第28号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価

証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.国内債券インデックス マザーファンド
2.国内株式インデックス マザーファンド
3.外国債券インデックス マザーファンド
4.外国株式インデックス マザーファンド
5.新興国債券インデックス マザーファンド
6.新興国株式インデックス マザーファンド
7.株券又は新株引受権証書
8.国債証券
9.地方債証券
10.特別の法律により法人の発行する債券
11.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
14.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
15.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
16.コマーシャル・ペーパー
17.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
18.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、第7号から第17号の証券又は証書の性質を有するもの
19.投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
20.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
21.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
22.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
23.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24.外国法人が発行する譲渡性預金証書
25.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。）
26.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
27.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
28.外国の者に対する権利で第27号の有価証券の性質を有するもの

なお、第7号の証券又は証書、第18号ならびに第23号の証券又は証書のうち第7号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第8号から第12号までの証券及び第18号ならびに第23号の証券又は証書のうち第8号から第12号までの証券の性質を有するもの、及び第20号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第19号及び

第20号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

1.預金

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

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、並びに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。
②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
③外貨建資産への投資は、行いません。
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。
②外貨建資産への投資は、行いません。
③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エ

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純

資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

３．運用制限

①株式への投資は行いません。

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

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

３．運用制限

①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

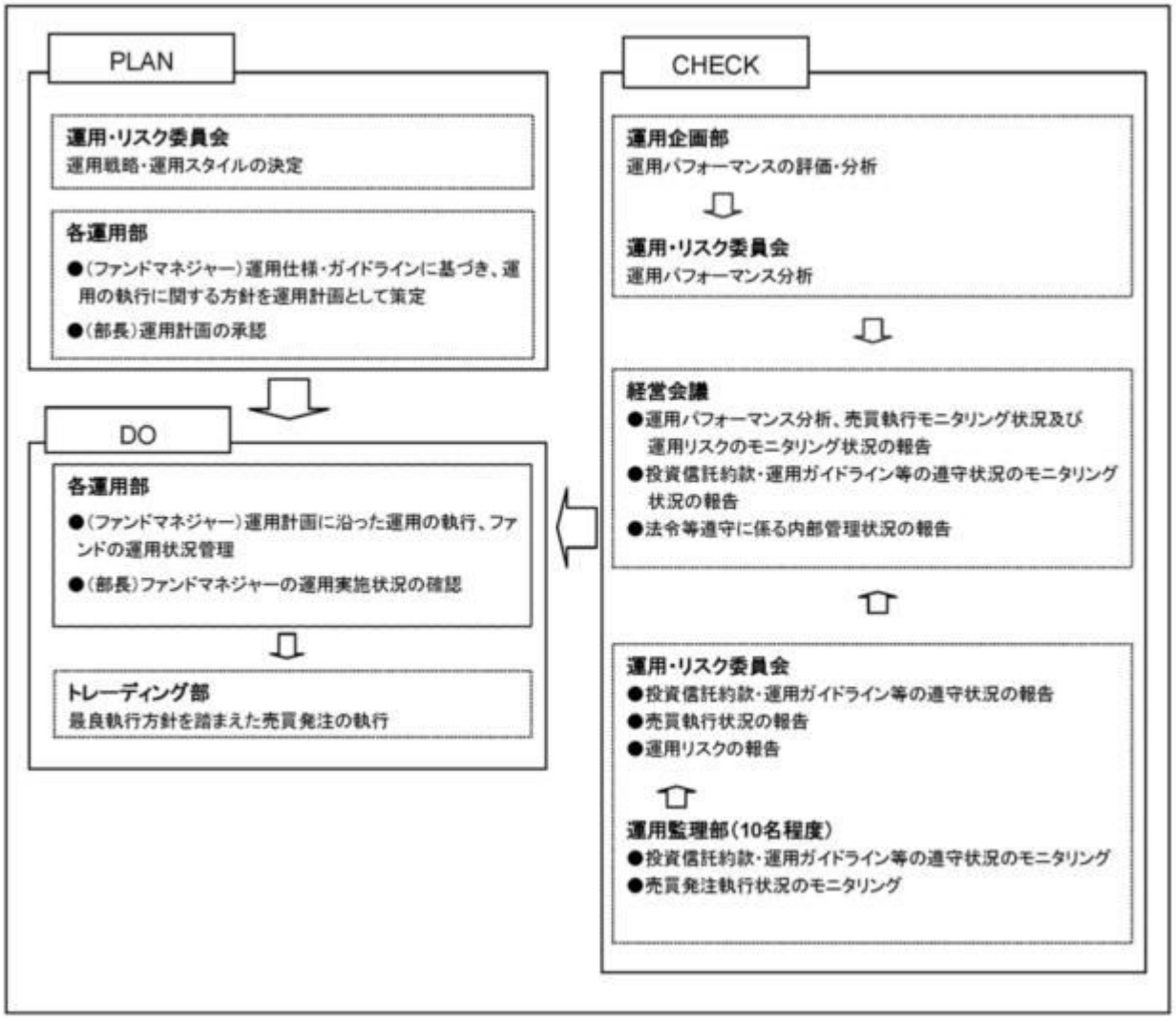
③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年1月20日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）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、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式への投資割合

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ホ．信用取引の指図範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロ

に掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

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

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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、この指図は、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。

ヲ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ワ．資金の借入れ

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用なら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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

カ．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。

ヨ．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。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク
株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

②為替変動リスク
為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

③金利変動リスク
債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

④信用リスク
有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑤カントリーリスク
投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑥流動性リスク
時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

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

④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。

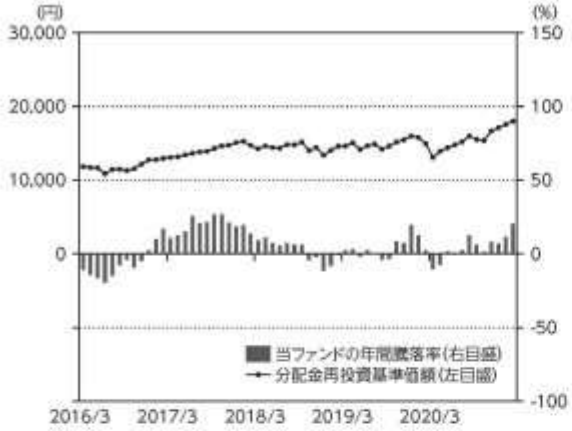
(2)リスクの管理体制

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〕

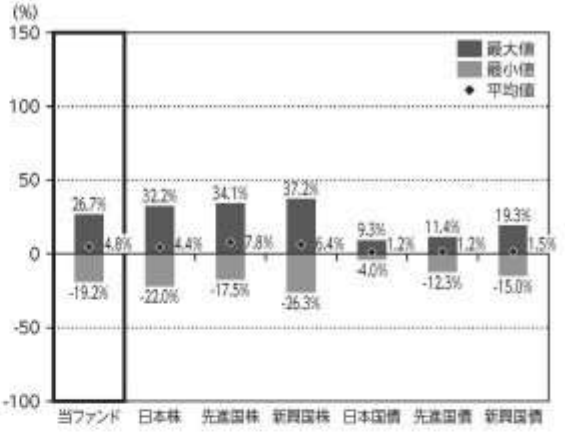
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2016年3月～2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは勧誘促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガンガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.605%（税抜　0.55%）（※）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　0.2805%　（税抜　0.255%）	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　0.2805%　（税抜　0.255%）	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。

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
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 2月26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2月26日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	8,640,371,067	99.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	81,884,396	0.94
合計(純資産総額)		8,722,255,463	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	1,215,967,612	3.2153	3,909,720,897	3.3155	4,031,540,617	46.22

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	555,677,058	3.6259	2,014,841,385	3.7088	2,060,895,072	23.63
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	401,614,592	2.9803	1,196,970,108	2.9638	1,190,305,327	13.65
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	361,675,385	1.7665	638,918,172	1.7815	644,324,698	7.39
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	327,247,019	1.7248	564,448,751	1.7210	563,192,119	6.46
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	107,592,628	1.4075	151,443,986	1.3952	150,113,234	1.72

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.06
合計	99.06

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末　(2014年 1月20日)	1,113,212	1,113,212	11,132	11,132
第2期計算期間末　(2015年 1月20日)	260,663,230	260,663,230	12,709	12,709
第3期計算期間末　(2016年 1月20日)	786,476,196	786,476,196	11,144	11,144
第4期計算期間末　(2017年 1月20日)	1,527,874,637	1,527,874,637	12,805	12,805
第5期計算期間末　(2018年 1月22日)	2,862,203,968	2,862,203,968	15,465	15,465
第6期計算期間末　(2019年 1月21日)	4,026,889,787	4,026,889,787	13,941	13,941
第7期計算期間末　(2020年 1月20日)	6,365,443,282	6,365,443,282	16,326	16,326
第8期計算期間末　(2021年 1月20日)	8,447,670,638	8,447,670,638	17,659	17,659
2020年 2月末日	6,083,035,009	—	14,960	—
3月末日	5,454,580,573	—	13,073	—
4月末日	5,906,841,702	—	13,917	—

5月末日	6,276,127,585	—	14,382	—
6月末日	6,565,761,363	—	14,793	—
7月末日	6,853,888,899	—	15,194	—
8月末日	7,276,346,665	—	15,966	—
9月末日	7,192,160,523	—	15,504	—
10月末日	7,188,559,516	—	15,358	—
11月末日	7,765,385,689	—	16,683	—
12月末日	8,046,471,726	—	17,092	—
2021年 1月末日	8,484,157,100	—	17,551	—
2月末日	8,722,255,463	—	17,986	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2013年 7月12日～2014年 1月20日	0
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	0
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	0
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2013年 7月12日～2014年 1月20日	11.3
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	14.2
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	△12.3
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	14.9
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	20.8
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	△9.9
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	17.1
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	8.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2013年 7月12日～2014年 1月20日	1,000,000	―	1,000,000
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	207,048,609	2,939,471	205,109,138
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	540,137,206	39,487,441	705,758,903
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	549,806,259	62,412,277	1,193,152,885
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	815,901,772	158,315,097	1,850,739,560
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	1,221,325,867	183,620,278	2,888,445,149
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	1,325,160,900	314,562,483	3,899,043,566
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	1,417,302,063	532,508,199	4,783,837,430

(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	503,787,131,650	83.18
地方債証券	日本	32,688,822,883	5.40
特殊債券	日本	41,048,085,465	6.78
社債券	日本	24,639,201,180	4.07
	フランス	1,298,682,000	0.21
	オーストラリア	399,624,000	0.07
	小計	26,337,507,180	4.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,814,459,925	0.30
合計(純資産総額)		605,676,007,103	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	100.75	8,584,240,800	0.100	2025/9/20	1.42
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	100.67	7,842,738,300	0.100	2024/9/20	1.29
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	100.45	7,815,554,600	0.100	2028/3/20	1.29

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	100.64	7,347,158,000	0.100	2024/6/20	1.21
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	7,050,000,000	100.91	7,114,155,000	100.61	7,093,639,500	0.100	2023/12/20	1.17
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	100.86	6,818,136,000	100.53	6,796,368,800	0.100	2023/9/20	1.12
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,720,000,000	100.98	6,786,395,200	100.73	6,769,257,600	0.100	2025/6/20	1.12
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	101.42	6,734,288,000	100.69	6,686,148,000	0.100	2026/9/20	1.10
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	99.52	6,519,084,000	0.100	2030/9/20	1.08
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	102.12	6,454,236,800	0.400	2025/9/20	1.07
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	5,850,000,000	100.67	5,889,195,000	100.38	5,872,698,000	0.100	2022/12/20	0.97
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	100.68	5,578,059,800	0.100	2024/12/20	0.92
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	5,480,000,000	101.31	5,551,788,000	100.73	5,520,223,200	0.100	2026/3/20	0.91
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,200,000,000	101.47	5,276,596,000	100.63	5,233,020,000	0.100	2027/3/20	0.86
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	102.28	5,206,357,400	0.600	2024/6/20	0.86
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	102.02	4,948,406,500	0.400	2025/6/20	0.82
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	4,870,000,000	101.22	4,929,414,000	100.08	4,873,993,400	0.100	2029/6/20	0.80
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,840,000,000	101.50	4,912,987,200	100.55	4,866,910,400	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	4,810,000,000	101.47	4,880,707,000	100.40	4,829,240,000	0.100	2028/6/20	0.80
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	99.95	4,827,923,100	0.100	2029/9/20	0.80
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	100.16	4,797,664,000	0.100	2029/3/20	0.79
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	4,760,000,000	100.93	4,804,713,200	100.62	4,789,845,200	0.100	2024/3/20	0.79
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	100.33	4,786,170,300	0.100	2022/9/1	0.79
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	100.54	4,795,996,500	100.28	4,783,689,900	0.100	2022/6/20	0.79
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	114.25	4,615,861,600	1.400	2034/9/20	0.76
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	100.23	4,480,370,400	0.100	2028/12/20	0.74
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	100.34	4,394,979,600	0.100	2022/9/20	0.73
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,250,000,000	102.61	4,360,940,300	101.99	4,334,915,000	0.600	2023/12/20	0.72
日本	国債証券	第４１７回利付国債（２年）	4,240,000,000	100.46	4,259,693,000	100.36	4,255,476,000	0.100	2022/10/1	0.70
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	4,130,000,000	101.45	4,189,903,600	100.54	4,152,425,900	0.100	2027/12/20	0.69

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）

国債証券	83.18
地方債証券	5.40
特殊債券	6.78
社債券	4.35
合計	99.70

(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。

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	447,390,619,720	99.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,620,599,007	0.58
合計(純資産総額)		450,011,218,727	100.00

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	2,494,415,000	0.55

(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	1,772,800	7,020.22	12,445,446,016	7,873.00	13,957,254,400	3.10
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,362,500	5,863.88	7,989,536,500	9,895.00	13,481,937,500	3.00
日本	株式	ソニー	電気機器	1,096,300	8,002.33	8,772,954,379	11,120.00	12,190,856,000	2.71
日本	株式	キーエンス	電気機器	171,800	47,672.26	8,190,094,268	50,560.00	8,686,208,000	1.93
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,806,900	458.53	5,413,817,857	558.00	6,588,250,200	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	100,200	48,463.65	4,856,057,730	64,750.00	6,487,950,000	1.44
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,197,900	3,990.37	4,780,064,223	5,281.00	6,326,109,900	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	421,200	8,341.63	3,513,494,556	13,520.00	5,694,624,000	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,008,600	2,502.47	5,026,461,242	2,758.00	5,539,718,800	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	316,900	14,130.06	4,477,816,014	17,350.00	5,498,215,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,456,000	4,053.68	5,902,158,080	3,582.00	5,215,392,000	1.16
日本	株式	村田製作所	電気機器	514,200	6,774.19	3,483,288,498	9,081.00	4,669,450,200	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	223,000	17,672.47	3,940,960,810	20,720.00	4,620,560,000	1.03
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,377,200	3,165.17	4,359,072,124	3,290.00	4,530,988,000	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,502,400	3,314.58	4,979,824,992	3,010.00	4,522,224,000	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,194,500	3,207.38	3,831,215,410	3,742.00	4,469,819,000	0.99
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	102,500	25,726.26	2,636,941,650	43,550.00	4,463,875,000	0.99
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	347,200	10,771.46	3,739,850,912	12,100.00	4,201,120,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	841,400	3,766.96	3,169,520,144	4,876.00	4,102,666,400	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	153,600	21,009.31	3,227,030,016	26,340.00	4,045,824,000	0.90
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,377,900	2,824.53	3,891,919,887	2,911.50	4,011,755,850	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,205,500	2,497.65	3,010,917,075	3,168.00	3,819,024,000	0.85
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,345,400	1,385.19	3,248,824,626	1,559.00	3,656,478,600	0.81
日本	株式	ＳＭＣ	機械	51,200	56,714.42	2,903,778,304	62,900.00	3,220,480,000	0.72
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	177,900	15,951.29	2,837,734,491	17,840.00	3,173,736,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	1,399,400	1,727.39	2,417,309,566	2,263.50	3,167,541,900	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,049,400	2,575.04	2,702,246,976	3,003.00	3,151,348,200	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	572,100	4,854.15	2,777,059,215	5,253.00	3,005,241,300	0.67
日本	株式	花王	化学	419,000	8,386.04	3,513,750,760	7,144.00	2,993,336,000	0.67
日本	株式	資生堂	化学	347,700	6,793.14	2,361,974,778	7,913.00	2,751,350,100	0.61

(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	0.18

		建設業	2.27
		食料品	3.31
		繊維製品	0.49
		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	0.59
		ガラス・土石製品	0.79
		鉄鋼	0.69
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.63
		機械	5.54
		電気機器	17.56
		輸送用機器	6.94
		精密機器	2.54
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.28
		陸運業	3.61
		海運業	0.20
		空運業	0.48
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.54
		卸売業	4.68
		小売業	4.71
		銀行業	5.02
		証券、商品先物取引業	0.82
		保険業	1.88
		その他金融業	1.08
		不動産業	1.99
		サービス業	5.71
		小計	99.42
合計			99.42

(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	133	円	2,519,965,400	2,494,415,000	0.55

(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	119,668,786,719	42.03
	フランス	29,959,311,079	10.52
	イタリア	26,920,226,869	9.45
	ドイツ	21,371,643,623	7.51
	イギリス	18,617,920,800	6.54
	スペイン	17,143,683,249	6.02
	オーストラリア	7,616,102,202	2.67
	ベルギー	7,052,170,931	2.48
	カナダ	5,525,483,424	1.94
	オランダ	5,257,233,510	1.85
	オーストリア	4,252,015,895	1.49
	アイルランド	2,442,735,621	0.86
	メキシコ	2,179,083,857	0.77
	ポーランド	1,837,786,953	0.65
	フィンランド	1,788,654,065	0.63
	デンマーク	1,442,386,519	0.51
	マレーシア	1,369,354,848	0.48
	イスラエル	1,278,703,504	0.45
	シンガポール	1,225,611,462	0.43
	スウェーデン	946,565,058	0.33
	ノルウェー	649,470,867	0.23
	小計	278,544,931,055	97.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,189,476,986	2.17
合計(純資産総額)		284,734,408,041	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	1,506,249,844	0.53
	買建	ドイツ	2,112,275,371	0.74

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	3,600,918,000	1.26

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	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	10,491.48	1,673,391,454	9,809.86	1,564,673,193	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,576.66	1,491,310,317	9,848.87	1,388,691,658	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,975.53	1,287,370,244	11,467.52	1,232,759,405	2.375	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,424.60	1,241,218,476	11,670.89	1,165,922,753	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,644.75	1,190,093,547	11,234.69	1,148,185,558	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,536.84	1,170,989,340	11,306.07	1,147,567,026	2.250	2024/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,790.18	1,170,786,705	13,457.68	1,142,557,737	3.000	2022/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,089.01	1,108,901,373	10,951.63	1,095,163,577	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,934.20	1,093,420,407	10,835.83	1,083,583,984	1.500	2022/8/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	23,389.31	1,103,975,478	22,882.53	1,080,055,827	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,646.03	1,080,572,807	10,636.62	1,079,617,041	0.250	2023/4/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	13,234.13	1,070,641,532	13,165.93	1,065,124,419	0.000	2025/3/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,565.72	1,120,862,461	11,850.19	1,057,037,422	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,618.41	1,061,841,250	10,419.14	1,041,914,062	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,958.69	1,046,555,029	10,840.61	1,035,278,523	1.750	2022/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,931.09	1,043,919,216	10,814.88	1,032,821,071	1.750	2022/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	10,909.27	1,036,380,989	10,845.59	1,030,331,361	1.500	2022/9/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,851.02	1,060,666,776	11,384.93	1,018,951,820	2.250	2027/2/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	16,228.25	1,035,362,850	15,949.63	1,017,586,877	2.500	2030/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,826.36	1,077,414,844	12,056.05	1,012,708,594	3.125	2028/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,873.37	1,007,959,279	15,543.84	987,034,364	3.500	2026/4/25	0.35

アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,147.85	1,003,307,062	10,953.71	985,833,984	1.375	2025/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,013.89	991,250,242	10,886.47	979,782,720	1.875	2022/7/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000	19,431.39	1,004,602,987	18,927.44	978,549,118	5.500	2029/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,918.26	1,019,011,376	11,381.20	973,092,704	2.250	2027/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,395.31	1,000,508,437	11,010.57	966,728,156	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,574.31	1,004,560,282	10,135.66	962,888,547	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 12/31/24	8,400,000	11,556.76	970,768,064	11,317.70	950,686,814	2.250	2024/12/31	0.33
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	11,454.66	969,064,499	11,220.58	949,261,159	2.000	2025/2/15	0.33
フランス	国債証券	FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000	13,914.16	955,903,079	13,815.69	949,138,047	0.750	2028/5/25	0.33

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.83
合計	97.83

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	44	アメリカドル	5,498,717.06	584,238,687	5,452,562.72	579,334,789	0.20
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	30	アメリカドル	4,028,630.88	428,042,031	3,977,343.9	422,592,789	0.15
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	30	アメリカドル	4,816,427.75	511,745,449	4,746,562.5	504,322,266	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	22	ユーロ	2,469,776.2	318,971,596	2,467,190	318,637,588	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	30	ユーロ	4,050,353	523,103,090	4,023,600	519,647,940	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	57	ユーロ	10,057,079.7	1,298,871,843	9,864,420	1,273,989,843	0.45

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	14,850,000.00	1,561,803,383	1,577,367,000	0.55
	カナダドル	買建	2,260,000.00	186,953,985	189,998,200	0.07
	ユーロ	買建	12,150,000.00	1,548,794,670	1,569,294,000	0.55
	イギリスポンド	買建	1,780,000.00	258,785,524	264,258,800	0.09

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

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

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	312,243,655,762	65.65
	イギリス	21,536,083,961	4.53
	カナダ	16,487,004,486	3.47
	フランス	15,749,709,415	3.31
	スイス	15,602,629,429	3.28
	ドイツ	14,249,832,093	3.00
	オーストラリア	10,230,489,166	2.15
	オランダ	9,001,013,749	1.89
	アイルランド	8,479,242,490	1.78
	スウェーデン	5,196,824,163	1.09
	香港	3,983,598,318	0.84
	スペイン	3,834,013,645	0.81
	デンマーク	3,782,438,319	0.80
	イタリア	2,911,368,109	0.61
	フィンランド	1,957,260,252	0.41
	ジャージー	1,509,130,833	0.32
	バミューダ	1,505,225,080	0.32
	シンガポール	1,432,595,956	0.30
	ベルギー	1,344,055,741	0.28
	ノルウェー	977,884,472	0.21
	イスラエル	961,108,863	0.20
	ケイマン	957,960,830	0.20
	ニュージーランド	535,657,671	0.11
	ルクセンブルク	438,998,954	0.09
	キュラソー	371,578,314	0.08
	オーストリア	292,421,089	0.06

	ポルトガル	265,703,725	0.06
	リベリア	164,757,040	0.03
	パナマ	131,304,217	0.03
	マン島	105,746,045	0.02
	パプアニューギニア	67,138,413	0.01
	小計	456,306,430,600	95.94
投資信託受益証券	オーストラリア	224,782,020	0.05
	香港	78,201,586	0.02
	小計	302,983,606	0.06
投資証券	アメリカ	8,363,803,336	1.76
	オーストラリア	646,250,250	0.14
	イギリス	276,517,863	0.06
	フランス	238,555,188	0.05
	シンガポール	238,026,629	0.05
	香港	173,436,862	0.04
	カナダ	62,570,860	0.01
	小計	9,999,160,988	2.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	9,015,575,227	1.90
合計(純資産総額)		475,624,150,421	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,304,237,500	1.33
	買建	カナダ	509,047,224	0.11
	買建	ドイツ	1,347,808,509	0.28
	買建	イギリス	413,301,504	0.09
	買建	オーストラリア	240,518,052	0.05

(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	―	167,112,700	△0.04

(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	1,550,117	8,565.87	13,278,108,457	12,855.18	19,927,044,682	4.19
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	651,460	19,356.62	12,610,066,923	24,330.18	15,850,143,949	3.33
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	38,569	257,585.06	9,934,798,275	324,823.24	12,528,107,929	2.63
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	217,520	24,101.75	5,242,612,660	27,060.81	5,886,267,935	1.24
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,164	150,881.37	4,098,541,670	215,832.00	5,862,860,448	1.23
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	27,179	151,022.68	4,104,645,624	214,194.68	5,821,597,412	1.22
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	68,317	18,207.00	1,243,847,619	72,485.87	4,952,017,522	1.04
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	275,361	10,609.06	2,921,322,059	16,062.87	4,423,089,323	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	237,907	15,621.93	3,716,568,285	17,293.25	4,114,185,228	0.87
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	154,172	20,677.31	3,187,862,622	22,710.93	3,501,390,656	0.74
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	163,105	12,459.93	2,032,278,106	20,291.62	3,309,665,496	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	126,483	19,807.12	2,505,264,591	25,892.06	3,274,905,741	0.69
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	55,706	36,729.56	2,046,057,009	56,556.87	3,150,557,279	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	80,578	32,254.31	2,598,987,992	37,673.06	3,035,620,030	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	224,638	12,405.75	2,786,802,869	13,449.12	3,021,184,542	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	85,744	32,306.37	2,770,077,818	34,942.43	2,996,104,361	0.63
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	259,992	12,096.58	3,145,014,183	11,288.10	2,934,817,775	0.62
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	100,666	15,935.37	1,604,150,459	26,981.12	2,716,081,929	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	702,805	2,643.50	1,857,865,018	3,817.56	2,683,002,013	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,097	26,176.81	2,541,689,964	27,120.31	2,633,300,983	0.55

アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	383,348	6,513.12	2,496,793,443	6,417.50	2,460,135,790	0.52
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	38,356	38,171.57	1,464,108,892	61,339.79	2,352,749,081	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	39,733	44,194.68	1,755,987,518	58,086.87	2,307,965,804	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	410,677	4,228.75	1,736,650,364	5,550.50	2,279,462,689	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	380,565	4,756.81	1,810,276,350	5,924.50	2,254,657,343	0.47
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	372,585	5,938.31	2,212,526,163	6,003.12	2,236,674,328	0.47
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	40,011.76	2,532,704,814	34,855.84	2,206,340,259	0.46
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	43,204	40,710.75	1,758,867,243	48,785.75	2,107,739,543	0.44
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	159,428	9,838.75	1,568,572,236	12,917.87	2,059,470,976	0.43
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	81,919	19,924.00	1,632,154,156	24,552.25	2,011,295,768	0.42

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	3.41
		素材	4.52
		資本財	6.46
		商業・専門サービス	1.06
		運輸	1.96
		自動車・自動車部品	2.01
		耐久消費財・アパレル	1.90
		消費者サービス	1.63
		メディア・娯楽	7.08
		小売	5.58
		食品・生活必需品小売り	1.30
		食品・飲料・タバコ	3.83
		家庭用品・パーソナル用品	1.78
		ヘルスケア機器・サービス	5.05
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.44
		銀行	6.14
		各種金融	4.49
		保険	3.21

		不動産	0.49
		ソフトウェア・サービス	11.75
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.68
		電気通信サービス	1.76
		公益事業	2.96
		半導体・半導体製造装置	4.45
		小計	95.94
投資信託受益証券	—	—	0.06
投資証券	—	—	2.10
合計			98.10

(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	310	アメリカドル	59,550,182.5	6,327,206,891	59,334,000	6,304,237,500	1.33
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	28	カナダドル	5,929,518	498,613,169	6,053,600	509,047,224	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	33	スイスフラン	3,538,791	415,241,736	3,489,750	409,487,265	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	197	ユーロ	7,137,196.5	921,768,928	7,265,360	938,321,244	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	17	オーストラリアドル	2,856,369	237,964,101	2,887,025	240,518,052	0.05
	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	42	イギリスポンド	2,771,387.5	411,495,616	2,783,550	413,301,504	0.09

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	1,000,000.00	106,050,000	106,240,000	△0.02
	イギリスポンド	売建	410,000.00	61,515,990	60,872,700	△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	6,549,151,471	10.13
	インドネシア	6,119,063,566	9.47
	メキシコ	5,857,544,345	9.06
	タイ	5,555,638,503	8.60
	ポーランド	5,464,720,544	8.46
	ブラジル	5,209,828,613	8.06
	南アフリカ	4,772,215,006	7.38
	マレーシア	4,637,333,352	7.18
	ロシア	4,576,218,545	7.08
	コロンビア	3,388,085,384	5.24
	ハンガリー	2,609,498,618	4.04
	チェコ	2,454,866,752	3.80
	チリ	1,719,921,117	2.66
	ペルー	1,713,341,854	2.65
	トルコ	1,180,354,586	1.83
	フィリピン	90,469,455	0.14
	ドミニカ共和国	88,334,905	0.14
	ウルグアイ	85,640,863	0.13
	小計	62,072,227,479	96.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,549,570,562	3.95
合計(純資産総額)		64,621,798,041	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	89,200,000,000	3.81	3,404,188,062	3.79	3,388,085,384	9.850	2027/6/28	5.24

ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000	1,611.84	1,350,722,676	1,595.08	1,336,684,039	0.000	2024/1/1	2.07
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	119,400,000	832.97	994,569,412	811.03	968,372,208	10.500	2026/12/21	1.50
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,664.84	852,398,913	1,666.39	853,193,952	0.000	2023/7/1	1.32
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000	2,116.68	799,047,376	2,064.77	779,451,680	10.000	2023/1/1	1.21
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	25,750,000	2,881.62	742,019,439	2,792.48	719,066,098	3.885	2029/8/15	1.11
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000	2,177.77	731,732,601	2,097.62	704,802,310	10.000	2025/1/1	1.09
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	171,200,000	431.31	738,408,192	403.95	691,565,276	3.300	2038/6/17	1.07
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	39,000,000	1,635.16	637,713,766	1,636.84	638,370,545	2.940	2024/10/17	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	106,900,000	604.71	646,437,097	591.74	632,574,122	8.500	2029/5/31	0.98
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000	672.38	640,113,848	663.38	631,541,425	8.000	2030/1/31	0.98
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	29,350,000	2,209.16	648,390,629	2,111.70	619,785,357	10.000	2027/1/1	0.96
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,720.80	621,704,824	2,702.09	617,427,601	3.480	2023/3/15	0.96
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	565.83	614,780,597	560.61	609,106,633	7.500	2027/6/3	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	19,850,000	3,090.71	613,506,086	3,047.61	604,951,649	2.500	2024/4/25	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	19,400,000	3,160.54	613,146,340	3,105.23	602,416,099	2.500	2026/7/25	0.93
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	604.75	606,268,259	598.55	600,047,378	10.000	2024/12/5	0.93
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	3,009.11	598,813,865	2,984.31	593,878,414	2.500	2023/1/25	0.92
中国	国債証券	CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000	1,651.15	577,903,831	1,650.54	577,692,098	3.250	2026/6/6	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	524.84	567,877,097	523.18	566,085,218	6.500	2022/6/9	0.88
中国	国債証券	CGB 2.68% 05/21/30	35,400,000	1,561.08	552,623,640	1,552.26	549,503,226	2.680	2030/5/21	0.85
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	557.82	546,389,235	555.20	543,821,691	8.000	2023/12/7	0.84
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	571.25	510,130,224	581.64	519,410,012	8.750	2048/2/28	0.80
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000	436.09	519,822,618	412.35	491,525,873	3.400	2036/6/17	0.76
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,595.27	486,558,652	1,598.91	487,669,242	2.850	2027/6/4	0.75
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	3,253.81	489,699,438	3,168.56	476,869,466	2.750	2029/10/25	0.74
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	429.60	491,039,018	413.29	472,398,791	3.650	2031/6/20	0.73
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000	454.03	479,002,780	441.23	465,499,760	4.875	2029/6/22	0.72
中国	国債証券	CGB 3.19% 04/11/24	28,000,000	1,648.97	461,713,503	1,651.31	462,368,844	3.190	2024/4/11	0.72
中国	国債証券	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000	1,630.50	456,540,592	1,633.13	457,278,108	3.020	2025/10/22	0.71

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	96.05
合計	96.05

(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。

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	22,803,760,403	24.76
	台湾	12,001,761,097	13.03
	韓国	11,637,761,582	12.64
	中国	10,110,574,475	10.98
	インド	8,270,810,147	8.98
	ブラジル	3,580,087,579	3.89
	南アフリカ	3,010,249,820	3.27
	サウジアラビア	2,197,317,411	2.39
	ロシア	2,163,538,445	2.35
	タイ	1,575,815,650	1.71
	メキシコ	1,298,356,075	1.41
	マレーシア	1,194,252,386	1.30
	インドネシア	1,104,286,147	1.20
	香港	989,075,787	1.07
	バミューダ	756,591,307	0.82
	フィリピン	580,397,006	0.63
	カタール	573,362,830	0.62
	ポーランド	493,735,198	0.54
	アラブ首長国連邦	473,688,723	0.51
	チリ	464,388,390	0.50
	クウェート	410,416,222	0.45
	アメリカ	328,990,685	0.36
	トルコ	305,954,084	0.33
	オランダ	208,853,058	0.23
	ハンガリー	186,187,818	0.20
	ルクセンブルク	173,325,429	0.19
	コロンビア	140,584,073	0.15
	ギリシャ	78,921,483	0.09
	チェコ	77,737,928	0.08

	エジプト	59,880,924	0.07
	ジャージー	57,563,320	0.06
	英ヴァージン諸島	30,521,062	0.03
	シンガポール	24,878,378	0.03
	マン島	21,564,495	0.02
	ペルー	20,200,664	0.02
	パキスタン	17,286,908	0.02
	アルゼンチン	16,169,269	0.02
	小計	87,438,846,258	94.94
投資信託受益証券	ブラジル	153,398,804	0.17
	メキシコ	26,391,941	0.03
	小計	179,790,745	0.20
投資証券	メキシコ	36,895,125	0.04
	南アフリカ	28,538,716	0.03
	小計	65,433,841	0.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,415,966,407	4.79
合計(純資産総額)		92,100,037,251	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	4,505,664,062	4.89

(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	—	163,945,929	0.18
	売建	—	338,897	△0.00

(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	2,431,389	1,751.47	4,258,504,892	2,425.69	5,897,820,297	6.40
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	567,600	8,528.25	4,840,634,700	9,473.55	5,377,186,980	5.84
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	186,909	30,868.81	5,769,658,876	25,519.12	4,769,754,135	5.18
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	471,371	5,718.99	2,695,770,748	8,103.49	3,819,754,898	4.15
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	356,000	4,592.24	1,634,837,440	5,074.48	1,806,514,880	1.96
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	42,901	23,737.91	1,018,380,249	25,111.25	1,077,297,908	1.17
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	279,072	3,014.52	841,270,637	3,152.19	879,689,223	0.96
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	85,581	9,016.37	771,630,388	9,919.49	848,920,729	0.92
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	26,907	15,320.18	412,220,285	31,258.74	841,079,186	0.91
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,450,620	80.96	765,188,350	86.99	822,156,687	0.89
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	588,000	1,149.43	675,864,840	1,337.12	786,226,560	0.85
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	53,279	8,170.00	435,289,431	14,107.50	751,633,493	0.82
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	37,614	12,217.68	459,556,098	18,175.12	683,639,152	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	368,378	1,215.77	447,864,984	1,841.46	678,353,499	0.74
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	165,529	3,163.58	523,665,392	3,946.50	653,261,688	0.71
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	126,816	4,799.31	608,629,614	4,973.56	630,727,302	0.68
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	332,785	1,670.72	555,993,384	1,873.58	623,502,149	0.68
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	80,374	5,225.00	419,954,150	7,039.50	565,792,773	0.61
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	310.18	374,779,197	445.02	537,706,607	0.58
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	147,804	2,681.63	396,357,118	3,606.07	532,993,048	0.58
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	359.76	505,753,420	367.84	517,116,501	0.56
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	40,751	9,333.00	380,329,083	11,545.12	470,475,389	0.51
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	489,955	680.16	333,252,203	923.16	452,306,858	0.49
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	11,900	28,310.00	336,889,000	36,385.00	432,981,500	0.47
ケイマン	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	303,000	1,097.78	332,627,643	1,428.91	432,959,730	0.47
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	5,924,515	64.39	381,479,521	71.78	425,309,083	0.46
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	257,781	1,307.93	337,161,437	1,583.12	408,099,546	0.44

インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	89,655	4,008.10	359,346,385	4,403.09	394,759,124	0.43
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	4,588	69,730.00	319,921,240	84,550.00	387,915,400	0.42
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	575,861	469.62	270,438,722	636.64	366,621,905	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	4.52
		素材	7.39
		資本財	2.43
		商業・専門サービス	0.26
		運輸	1.28
		自動車・自動車部品	3.23
		耐久消費財・アパレル	1.32
		消費者サービス	1.51
		メディア・娯楽	9.61
		小売	11.50
		食品・生活必需品小売り	1.12
		食品・飲料・タバコ	3.09
		家庭用品・パーソナル用品	0.88
		ヘルスケア機器・サービス	1.16
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.10
		銀行	11.88
		各種金融	1.89
		保険	2.72
		不動産	1.88
		ソフトウェア・サービス	2.21
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.84
		電気通信サービス	2.13
		公益事業	1.79
		半導体・半導体製造装置	9.17
		小計	94.94
投資信託受益証券	—	—	0.20
投資証券	—	—	0.07
合計			95.21

(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	625	アメリカドル	42,425,225	4,507,680,156	42,406,250	4,505,664,062	4.89

(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	1,540,000.00	163,518,400	163,609,600	0.18
	ブラジルレアル	買建	17,480.76	338,322	336,329	0.00
	アメリカドル	売建	3,189.92	338,322	338,897	△0.00

(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：2013年7月12日
作成基準日：2021年2月26日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	17,986円
純資産総額	87.22億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年1月	0円
2018年1月	0円
2019年1月	0円
2020年1月	0円
2021年1月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	46.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	23.6%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.5%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸	株式	メディア・娯楽	-	-	1.4%
外国債券インデックスマザーファンド	13.6%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.1%
国内株式インデックスマザーファンド	7.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.2%
新興国債券インデックスマザーファンド	6.5%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.4%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	1.7%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.0%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

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

＜その他＞
取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

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、6営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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拠ることとなります。

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

ます。

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2013年 7月12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1月21日から翌年1月20日までとします。
ただし、第1計算期間は2013年7月12日から2014年1月20日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。
・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合
②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。
④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）①によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。
①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のう

え、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

＜公告＞
委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞
①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。
②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。
③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
④動産(金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権
①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
②収益分配金は、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
①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2020年1月21日から2021年1月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （2020年 1月20日現在）	第8期 （2021年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,893
コール・ローン	56,214,959	76,034,866
親投資信託受益証券	6,311,318,180	8,361,483,372
未収入金	15,340,000	43,620,000
流動資産合計	6,382,873,139	8,481,142,131
資産合計	6,382,873,139	8,481,142,131
負債の部		
流動負債		
未払解約金	947,162	10,490,412
未払受託者報酬	1,187,950	1,656,300
未払委託者報酬	15,146,291	21,117,753
未払利息	22	51
その他未払費用	148,432	206,977
流動負債合計	17,429,857	33,471,493
負債合計	17,429,857	33,471,493
純資産の部		
元本等		
元本	3,899,043,566	4,783,837,430
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,466,399,716	3,663,833,208
（分配準備積立金）	920,063,150	1,606,541,668
元本等合計	6,365,443,282	8,447,670,638
純資産合計	6,365,443,282	8,447,670,638
負債純資産合計	6,382,873,139	8,481,142,131

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2019年 1月22日 至　2020年 1月20日	第8期 自　2020年 1月21日 至　2021年 1月20日
営業収益		
受取利息	23	500
有価証券売買等損益	866,526,402	796,885,192
営業収益合計	866,526,425	796,885,692
営業費用		
支払利息	29,916	32,220
受託者報酬	2,171,044	2,989,664
委託者報酬	27,680,661	38,118,161
その他費用	271,524	373,690
営業費用合計	30,153,145	41,513,735
営業利益又は営業損失（△）	836,373,280	755,371,957
経常利益又は経常損失（△）	836,373,280	755,371,957
当期純利益又は当期純損失（△）	836,373,280	755,371,957
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（△）	24,454,482	△35,413,011
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,138,444,638	2,466,399,716
剰余金増加額又は欠損金減少額	643,637,114	729,395,145
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	643,637,114	729,395,145
剰余金減少額又は欠損金増加額	127,600,834	322,746,621
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	127,600,834	322,746,621
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,466,399,716	3,663,833,208

（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7期 (2020年 1月20日現在)	第8期 (2021年 1月20日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	3,899,043,566口	4,783,837,430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 1.6326円 (1万口当たり純資産額) (16,326円)	1口当たり純資産額 1.7659円 (1万口当たり純資産額) (17,659円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第7期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日	第8期 自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	120,924,454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	328,236,988円
収益調整金額	C	1,546,336,566円
分配準備積立金額	D	470,901,708円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,466,399,716円
当ファンドの期末残存口数	F	3,899,043,566口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,325円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	133,880,964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	656,904,004円
収益調整金額	C	2,057,291,540円
分配準備積立金額	D	815,756,700円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,663,833,208円
当ファンドの期末残存口数	F	4,783,837,430口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,658円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第8期 自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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8期 (2021年 1月20日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第7期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日	第8期 自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,888,445,149円	3,899,043,566円
期中追加設定元本額	1,325,160,900円	1,417,302,063円
期中一部解約元本額	314,562,483円	532,508,199円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第7期 (2020年 1月20日現在)	第8期 (2021年 1月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	852,511,746	796,537,650
合計	852,511,746	796,537,650

（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	553,047,967	2,005,296,623	
	国内株式インデックス　マザーファンド	359,877,970	635,760,421	
	外国株式インデックス　マザーファンド	1,210,061,402	3,890,589,419	
	国内債券インデックス　マザーファンド	101,667,748	143,148,189	
	外国債券インデックス　マザーファンド	384,859,624	1,147,151,081	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	312,684,810	539,537,639	
合計		2,922,199,521	8,361,483,372	

(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。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	56,937
コール・ローン	1,111,998,060
国債証券	506,700,077,550
地方債証券	33,246,123,757
特殊債券	39,860,565,417
社債券	25,983,464,360
未収入金	397,360
未収利息	975,652,499
前払費用	26,664,334
流動資産合計	607,905,000,274
資産合計	607,905,000,274
負債の部	
流動負債	
未払金	695,101,700
未払解約金	150,729,883
未払利息	755
流動負債合計	845,832,338
負債合計	845,832,338
純資産の部	
元本等	

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
元本	431,157,941,659
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	175,901,226,277
元本等合計	607,059,167,936
純資産合計	607,059,167,936
負債純資産合計	607,905,000,274

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 1月20日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		431,157,941,659口
2． 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	有価証券	101,369,000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	1.4080円
	(1万口当たり純資産額)	(14,080円)

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 1月20日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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

	2021年 1月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	389,894,814,663円
期中追加設定元本額	78,209,607,894円
期中一部解約元本額	36,946,480,898円
期末元本額	431,157,941,659円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,640,927,523円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,000,136円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	19,289,847,114円
世界経済インデックスファンド	2,150,688,122円
ＤＣマイセレクション２５	22,943,582,789円
ＤＣマイセレクション５０	25,531,084,360円
ＤＣマイセレクション７５	6,835,411,171円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	438,397,196円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	92,324,962,718円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	69,176,349,668円
ＤＣマイセレクションＳ２５	10,236,481,569円
ＤＣマイセレクションＳ５０	10,967,335,318円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,123,452,715円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,025,525,689円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,620,797,230円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	567,576,494円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,747,542,695円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	15,085,130円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,850,843円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	39,578,284円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,325,153円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	944,620円

区分	2021年 1月20日現在
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	137,898,512円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	194,655,179円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	47,443,354円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	48,798,841円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,596,454,411円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	830,238,693円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,302,536,140円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	713,286,066円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	82,926,220円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,111,742,446円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,302,968,951円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,571,410,021円
国内バランス２５ＶＡ１（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	6,214,601,146円
日本債券ファンド・シリーズ１	12,936,352,249円
分散投資コア戦略ファンドＡ	24,846,858,931円
分散投資コア戦略ファンドＳ	24,412,449,633円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	101,667,748円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,064,394,365円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	47,502,646円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,749,767円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	54,699,397円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	19,242,748円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	32,281,825円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	48,369,597円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,319,469円
グローバル経済コア	199,062,924円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	19,358,011円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	3,238,391円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	757,291円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	529,169円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	177,772円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	109,621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）	76,288,559,747円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	32,317,921円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△4,580,587,000

地方債証券	△94,377,773
特殊債券	△157,005,377
社債券	44,953,410
合計	△4,787,016,740

(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４０９回利付国債（２年）	1,700,000,000	1,704,114,000	
	第４１０回利付国債（２年）	80,000,000	80,212,800	
	第４１２回利付国債（２年）	780,000,000	782,386,800	
	第４１３回利付国債（２年）	1,640,000,000	1,645,346,400	
	第４１４回利付国債（２年）	2,360,000,000	2,368,165,600	
	第４１５回利付国債（２年）	100,000,000	100,359,000	
	第４１６回利付国債（２年）	3,990,000,000	4,005,122,100	
	第４１７回利付国債（２年）	4,300,000,000	4,317,501,000	
	第４１８回利付国債（２年）	1,040,000,000	1,044,815,200	
	第４１９回利付国債（２年）	740,000,000	743,241,200	
	第４２０回利付国債（２年）	1,230,000,000	1,235,633,400	
	第１３１回利付国債（５年）	4,990,000,000	5,003,273,400	
	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	4,785,836,400	
	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,397,125,800	
	第１３４回利付国債（５年）	5,850,000,000	5,876,325,000	
	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,100,277,600	
	第１３６回利付国債（５年）	2,840,000,000	2,855,790,400	
	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	6,801,506,400	
	第１３８回利付国債（５年）	7,050,000,000	7,097,376,000	
	第１３９回利付国債（５年）	4,760,000,000	4,793,938,800	

第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	7,356,210,000	
第１４１回利付国債（５年）	7,420,000,000	7,481,363,400	
第１４２回利付国債（５年）	5,630,000,000	5,679,769,200	
第１４３回利付国債（５年）	3,300,000,000	3,331,020,000	
第１４４回利付国債（５年）	6,720,000,000	6,786,998,400	
第１４５回利付国債（５年）	8,520,000,000	8,607,841,200	
第１４６回利付国債（５年）	180,000,000	181,911,600	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	578,272,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,584,610,300	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	776,094,000	
第４回利付国債（４０年）	1,200,000,000	1,701,180,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,469,024,400	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,706,153,400	
第７回利付国債（４０年）	1,040,000,000	1,356,388,800	
第８回利付国債（４０年）	1,030,000,000	1,256,466,100	
第９回利付国債（４０年）	1,220,000,000	1,113,579,400	
第１０回利付国債（４０年）	2,370,000,000	2,536,042,200	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,859,219,300	
第１２回利付国債（４０年）	1,710,000,000	1,604,578,500	
第１３回利付国債（４０年）	1,390,000,000	1,302,555,100	
第３２１回利付国債（１０年）	2,600,000,000	2,634,086,000	
第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	758,962,500	
第３２３回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,958,081,500	
第３２４回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,776,003,600	
第３２５回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,965,230,800	
第３２６回利付国債（１０年）	3,120,000,000	3,169,639,200	
第３２７回利付国債（１０年）	3,190,000,000	3,246,845,800	
第３２８回利付国債（１０年）	3,400,000,000	3,453,346,000	
第３２９回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,300,310,000	
第３３０回利付国債（１０年）	1,900,000,000	1,946,683,000	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	917,433,000	
第３３２回利付国債（１０年）	4,250,000,000	4,339,420,000	
第３３３回利付国債（１０年）	3,030,000,000	3,099,174,900	
第３３４回利付国債（１０年）	5,090,000,000	5,215,468,500	
第３３５回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,505,884,500	
第３３６回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,075,588,500	
第３３７回利付国債（１０年）	2,850,000,000	2,897,025,000	
第３３８回利付国債（１０年）	3,060,000,000	3,126,493,800	
第３３９回利付国債（１０年）	4,850,000,000	4,962,908,000	
第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	6,474,081,600	
第３４１回利付国債（１０年）	2,160,000,000	2,204,820,000	
第３４２回利付国債（１０年）	6,380,000,000	6,451,137,000	

第３４３回利付国債（１０年）	4,050,000,000	4,097,385,000	
第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	6,719,414,400	
第３４５回利付国債（１０年）	3,340,000,000	3,381,716,600	
第３４６回利付国債（１０年）	5,200,000,000	5,266,040,000	
第３４７回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,930,052,000	
第３４８回利付国債（１０年）	4,840,000,000	4,904,904,400	
第３４９回利付国債（１０年）	4,130,000,000	4,186,002,800	
第３５０回利付国債（１０年）	5,590,000,000	5,666,527,100	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	4,810,000,000	4,874,502,100	
第３５２回利付国債（１０年）	3,660,000,000	3,707,909,400	
第３５３回利付国債（１０年）	4,470,000,000	4,526,858,400	
第３５４回利付国債（１０年）	5,030,000,000	5,091,768,400	
第３５５回利付国債（１０年）	4,870,000,000	4,927,514,700	
第３５６回利付国債（１０年）	4,830,000,000	4,884,530,700	
第３５７回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,697,394,200	
第３５８回利付国債（１０年）	3,620,000,000	3,654,824,400	
第３５９回利付国債（１０年）	3,070,000,000	3,095,972,200	
第３６０回利付国債（１０年）	6,650,000,000	6,701,271,500	
第３６１回利付国債（１０年）	110,000,000	110,706,200	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	136,919,200	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	195,051,200	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	145,671,600	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	141,011,200	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	61,043,000	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	437,654,000	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	224,598,600	
第８回利付国債（３０年）	140,000,000	167,643,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	276,240,000	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	178,683,200	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	309,667,800	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	236,187,100	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	357,729,500	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	386,604,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	444,162,400	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	262,048,000	
第１７回利付国債（３０年）	770,000,000	1,001,323,400	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	445,060,350	
第１９回利付国債（３０年）	380,000,000	491,431,200	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	636,360,000	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	649,690,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	533,004,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	574,419,800	

第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	508,869,400	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	459,098,500	
第２６回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,515,960,600	
第２７回利付国債（３０年）	1,510,000,000	2,042,048,500	
第２８回利付国債（３０年）	2,140,000,000	2,905,906,000	
第２９回利付国債（３０年）	1,520,000,000	2,045,129,600	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,359,286,100	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,451,417,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,096,764,800	
第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,352,968,800	
第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,395,481,350	
第３５回利付国債（３０年）	2,240,000,000	2,912,896,000	
第３６回利付国債（３０年）	2,030,000,000	2,648,114,700	
第３７回利付国債（３０年）	2,230,000,000	2,873,912,500	
第３８回利付国債（３０年）	1,750,000,000	2,226,035,000	
第３９回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,811,418,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,190,000,000	1,515,703,000	
第４１回利付国債（３０年）	610,000,000	765,196,200	
第４２回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,908,481,600	
第４３回利付国債（３０年）	1,290,000,000	1,621,220,400	
第４４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,534,638,000	
第４５回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,334,938,000	
第４６回利付国債（３０年）	1,750,000,000	2,124,920,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,671,246,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,990,000,000	2,372,796,400	
第４９回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,717,588,800	
第５０回利付国債（３０年）	1,840,000,000	1,937,372,800	
第５１回利付国債（３０年）	1,810,000,000	1,692,132,800	
第５２回利付国債（３０年）	1,980,000,000	1,942,439,400	
第５３回利付国債（３０年）	690,000,000	692,325,300	
第５４回利付国債（３０年）	2,200,000,000	2,309,912,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,091,147,200	
第５６回利付国債（３０年）	1,700,000,000	1,782,246,000	
第５７回利付国債（３０年）	1,550,000,000	1,623,702,500	
第５８回利付国債（３０年）	1,890,000,000	1,978,263,000	
第５９回利付国債（３０年）	340,000,000	347,184,200	
第６０回利付国債（３０年）	2,560,000,000	2,738,944,000	
第６１回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,689,581,200	
第６２回利付国債（３０年）	20,000,000	19,308,800	
第６３回利付国債（３０年）	1,080,000,000	1,012,813,200	
第６４回利付国債（３０年）	2,060,000,000	1,928,572,000	
第６５回利付国債（３０年）	860,000,000	803,756,000	
第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	962,153,900	

第６７回利付国債（３０年）	1,360,000,000	1,339,899,200	
第６８回利付国債（３０年）	1,970,000,000	1,938,263,300	
第６９回利付国債（３０年）	110,000,000	111,098,900	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	143,469,200	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	154,515,000	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	246,885,600	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	310,149,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	207,016,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	360,265,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	245,844,000	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	327,155,200	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	209,310,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	337,267,200	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	232,986,600	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	348,516,300	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	138,326,500	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	203,976,400	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	417,452,100	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	434,520,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	215,890,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	681,452,100	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	389,998,800	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	217,452,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	142,032,800	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	292,734,000	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	315,630,200	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	185,186,100	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	295,315,200	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	241,604,000	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	428,668,500	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	662,304,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	321,731,800	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	519,105,600	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	323,251,400	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	236,256,300	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	615,917,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	475,095,600	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	394,009,000	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	712,725,300	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	511,654,500	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	995,438,400	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	463,353,300	

第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	693,161,300	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	704,458,500	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,815,700,500	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	461,556,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	504,759,200	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,486,492,800	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	558,998,400	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	842,970,700	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,492,394,400	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	470,796,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	185,932,800	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,376,741,400	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	446,283,400	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	304,525,000	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	762,537,600	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	603,070,000	
第１１０回利付国債（２０年）	950,000,000	1,117,323,500	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,153,368,800	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	932,674,000	
第１１３回利付国債（２０年）	1,720,000,000	2,038,200,000	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,769,764,200	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	838,369,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,791,039,600	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,288,310,400	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	783,486,000	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	619,193,700	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,804,699,300	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,772,820,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,101,896,200	
第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,252,545,900	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	728,760,900	
第１２５回利付国債（２０年）	820,000,000	998,694,400	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	874,321,000	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,211,341,800	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,155,250,600	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,050,760,700	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,521,080,200	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,173,140,000	
第１３２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,364,020,800	
第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,459,641,000	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,344,214,100	
第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,213,875,600	
第１３６回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,692,817,000	

	第１３７回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,287,486,200	
	第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	718,332,000	
	第１３９回利付国債（２０年）	670,000,000	783,826,300	
	第１４０回利付国債（２０年）	1,680,000,000	1,988,733,600	
	第１４１回利付国債（２０年）	1,780,000,000	2,111,525,000	
	第１４２回利付国債（２０年）	1,040,000,000	1,245,930,400	
	第１４３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,706,142,500	
	第１４４回利付国債（２０年）	1,740,000,000	2,026,543,200	
	第１４５回利付国債（２０年）	2,445,000,000	2,912,068,350	
	第１４６回利付国債（２０年）	2,780,000,000	3,317,513,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,543,278,000	
	第１４８回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,921,965,200	
	第１４９回利付国債（２０年）	3,110,000,000	3,649,958,200	
	第１５０回利付国債（２０年）	4,340,000,000	5,042,689,400	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,325,000,000	1,505,359,000	
	第１５２回利付国債（２０年）	3,290,000,000	3,740,401,000	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,570,000,000	2,959,740,500	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,950,000,000	3,358,250,500	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,550,000,000	2,828,995,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,560,000,000	2,612,249,600	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,780,000,000	2,749,169,800	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,320,000,000	2,396,583,200	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,920,000,000	3,059,984,800	
	第１６０回利付国債（２０年）	2,680,000,000	2,847,392,800	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,710,000,000	1,787,428,800	
	第１６２回利付国債（２０年）	450,000,000	469,930,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,722,856,400	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,780,000,000	1,824,678,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,677,605,200	
	第１６６回利付国債（２０年）	900,000,000	950,022,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,770,000,000	2,825,732,400	
	第１６８回利付国債（２０年）	2,430,000,000	2,432,041,200	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,010,594,800	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,360,000,000	2,310,982,800	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,261,761,900	
	第１７２回利付国債（２０年）	1,360,000,000	1,352,764,800	
	第１７３回利付国債（２０年）	3,250,000,000	3,226,730,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,520,000,000	2,499,487,200	
国債証券合計		472,530,000,000	506,700,077,550	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,128,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,301,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	133,020,000	

第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	131,317,000	
第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	127,119,000	
第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	126,226,000	
第１６回東京都公募公債（２０年）	300,000,000	345,252,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	115,712,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,979,000	
第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	99,882,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	234,484,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	234,044,000	
第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	200,058,000	
第７１６回東京都公募公債	100,000,000	101,465,000	
第７１７回東京都公募公債	100,000,000	101,350,000	
第７２０回東京都公募公債	100,000,000	102,086,000	
第７２６回東京都公募公債	200,000,000	204,226,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	101,880,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,798,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,920,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,765,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	301,878,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	199,224,000	
平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,642,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,840,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,157,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,031,000	
平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	201,336,000	
第２９回１号宮城県公募公債（１０年）	100,000,000	101,863,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	272,582,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,674,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,862,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,711,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	203,490,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,937,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,828,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,765,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	199,136,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	234,798,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,292,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,265,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,121,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,966,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,925,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,675,720	

第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,340,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,296,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,285,480	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,404,000	
第４３９回大阪府公募公債（１０年）	500,000,000	503,260,000	
第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,836,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	117,898,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	117,026,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	102,117,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,417,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	99,369,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	103,654,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	103,699,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	115,239,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	102,288,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	400,000,000	437,592,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,978,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,083,000	
平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	200,000,000	202,290,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	102,058,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,806,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	102,245,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	300,951,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	120,251,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	102,893,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	117,072,000	
第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,630,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,458,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,829,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,957,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	101,027,000	
平成２９年度第１４回静岡県公募公債（５年）	100,000,000	100,075,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	118,231,000	
平成２４年度第１８回愛知県公募公債（１０年）	150,000,000	152,515,500	
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,384,000	
平成２５年度第２回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,291,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,161,000	

平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,884,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,135,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,076,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	309,504,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,831,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	101,645,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	199,648,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	117,219,000	
平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	235,128,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,494,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	128,092,757	
平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,726,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	115,063,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,222,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	233,218,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	106,592,000	
第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	236,652,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,218,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	198,928,000	
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,320,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,703,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,069,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	102,291,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,227,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,147,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,831,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,205,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,398,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	108,053,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	118,850,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	108,438,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	131,431,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,985,000	

平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,267,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	101,645,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	103,247,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	300,564,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	233,218,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,708,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,072,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	102,165,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,740,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	102,360,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,226,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,861,600	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	299,196,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,943,000	
第１０７回共同発行市場公募地方債	800,000,000	808,840,000	
第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,182,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,317,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,189,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	220,000,000	222,772,000	
第１１３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,438,000	
第１１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,469,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,744,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,668,000	
第１２１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,276,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,226,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,863,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,862,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,554,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,246,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,125,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,015,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,924,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,420,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,756,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,497,380	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,383,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,283,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,183,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,270,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,054,000	

第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,332,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,029,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,718,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,124,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,600,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,397,795	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,009,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,382,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	202,806,000	
平成２９年度第１回熊本県公募公債（５年）	100,000,000	100,007,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,055,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	236,424,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	299,436,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	104,209,000	
平成２９年度第１回大阪市公募公債（５年）	100,000,000	100,006,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	130,728,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	135,161,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	115,555,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	125,237,000	
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,415,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,015,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	300,558,000	
平成２４年度第２回京都市公募公債	122,500,000	124,159,875	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,394,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	101,724,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,438,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	136,159,200	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	233,750,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	119,075,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	117,370,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	98,751,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	109,555,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	351,852,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,688,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	101,162,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,900,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	203,058,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	229,020,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	300,567,000	
	100,000,000	108,655,000	

	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）			
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,523,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,663,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	116,596,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,677,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,690,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,280,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,130,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	117,458,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	115,890,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	204,030,000	
	平成２８年度第１０回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,018,000	
	平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,126,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,536,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	153,088,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,772,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,744,450	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	171,904,000	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	550,258,500	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	200,146,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	199,464,000	
	平成２４年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	101,466,000	
	平成２４年度第２回岡山県公募公債（１０年）	150,000,000	152,214,000	
	平成２４年度第１回岡山市公募公債（１０年）	200,000,000	203,406,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	202,620,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,032,000	
地方債証券合計		31,609,430,000	33,246,123,757	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,185,860	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	415,879,400	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	315,942,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,412,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,907,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	95,758,000	
	第５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,670,000	

第１４回道路債券	100,000,000	103,649,000	
第１７回道路債券	100,000,000	102,941,000	
第２１回道路債券	100,000,000	130,014,000	
第２８回道路債券	200,000,000	263,880,000	
第３３回道路債券	200,000,000	267,810,000	
第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,217,000	
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,275,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,981,000	
第４２回道路債券	100,000,000	109,089,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,692,000	
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,233,000	
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	143,252,000	
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	235,046,000	
第９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,704,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,380,000	
第１０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,812,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	913,608,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,210,000	
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	131,632,000	
第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,036,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,926,000	
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	119,669,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,687,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,724,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,622,000	
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	202,048,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,500,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,516,000	
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	101,325,000	

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	101,330,000	
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,410,000	
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	117,160,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,744,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,151,000	
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	202,876,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	616,692,000	
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	305,732,720	
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	636,980,400	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,310,000	
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	151,189,400	
第２０２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,941,000	
第２０４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	270,884,754	
第２０７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,070,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,624,000	
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	102,042,000	
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,724,000	
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	104,217,480	
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	102,192,000	
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	102,101,000	
第２２８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	230,182,000	
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	102,019,000	
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	101,813,000	
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,813,000	
第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,171,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,002,000	
	200,000,000	203,170,000	

第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,664,000	
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,922,000	
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	106,936,870	
第２９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,311,400	
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	206,232,050	
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	100,804,000	
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	201,502,000	
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	100,891,000	
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	121,479,600	
第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,688,000	
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	309,873,000	
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	216,884,720	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	379,350,000	
第３回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,533,000	
第３回公営企業債券（２０年）	210,000,000	214,615,800	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	108,381,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	395,577,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	106,920,000	
第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	132,369,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	42,831,200	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	130,369,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	235,226,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	194,154,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	234,840,000	
第２１回地方公共団体金融機構債券（５年）	400,000,000	400,024,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	116,618,000	
第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	506,300,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,476,000	
第４４回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,436,000	
第４４回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,132,000	
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,692,000	

第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,876,000	
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,225,000	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,402,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,156,000	
第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,983,450	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,030,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,306,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,883,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,294,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,834,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,026,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,028,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,412,000	
第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,599,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,874,970	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,906,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,884,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,344,200	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,688,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,987,440	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,341,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,357,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,835,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,620,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,007,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,297,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	108,787,000	
第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,912,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,988,000	
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	203,416,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,032,760	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,908,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,978,600	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,408,560	
第８５回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,979,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	212,294,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	170,576,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	93,527,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	108,496,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	103,350,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,517,600	

第５９回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	505,435,000	
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,992,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,022,000	12,368,353	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,470,000	12,846,344	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,741,000	13,171,645	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	185,850,000	185,809,113	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	132,220,000	132,278,176	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,542,000	12,923,402	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,505,000	13,991,044	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	238,923,000	238,380,644	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,930,000	11,068,483	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	22,724,000	23,186,433	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,308,000	13,783,627	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	256,617,000	255,734,237	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	91,410,000	91,384,405	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,995,000	12,311,668	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,004,000	14,561,779	
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	293,154,000	292,986,902	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,958,000	12,275,126	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,025,000	14,600,866	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,077,000	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	9,930,000	9,959,492	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,144,000	10,174,330	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,374,000	19,510,248	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,759,000	20,010,225	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,059,000	22,632,949	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,632,000	24,153,323	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,071,000	26,903,690	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,793,000	27,619,660	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,444,000	59,359,455	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,133,000	12,434,626	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,393,000	26,902,613	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,299,000	12,611,271	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,112,000	12,492,559	

第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,118,000	29,864,408	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,313,000	11,547,631	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,121,000	31,013,573	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,418,000	29,149,446	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,357,000	13,939,365	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,020,000	59,231,626	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,270,000	32,036,557	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,017,000	13,457,495	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,324,000	42,669,647	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,136,000	40,288,395	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,255,000	40,444,333	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,986,000	86,463,255	
第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,846,000	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,150,000	93,199,193	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,362,000	47,372,443	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,476,000	47,877,587	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,049,000	48,541,632	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,017,000	42,009,446	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,834,000	41,521,368	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,477,000	47,971,868	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	178,768,500	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,274,000	127,437,631	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,016,000	170,940,755	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,433,000	48,340,003	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,905,000	49,908,387	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,598,000	50,493,807	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,564,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,506,000	160,499,287	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,735,000	54,564,904	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,630,000	113,742,021	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,635,000	63,580,816	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,298,000	67,161,604	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,759,000	66,931,664	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,508,000	208,057,126	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,546,000	139,467,692	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,637,000	67,919,854	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,750,000	73,273,652	
第１０７回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	404,776,000	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,711,000	77,078,445	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,503,000	82,036,844	

第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,570,000	81,928,908	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,786,000	82,495,084	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,326,000	83,456,335	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,799,000	83,811,631	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,593,000	85,516,755	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,224,000	86,253,505	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,049,000	85,844,208	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,350,000	86,144,608	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,836,000	86,683,201	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,212,000	174,549,196	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,048,000	86,837,060	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,614,000	176,651,745	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,210,000	88,021,053	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,182,000	176,529,149	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,286,000	89,084,105	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,754,000	179,946,289	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,334,000	179,512,787	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	129,438,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,196,000	91,357,724	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,564,000	91,924,271	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,570,000	91,140,591	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,188,000	184,493,752	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,447,000	92,508,015	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,443,000	92,638,054	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,868,000	185,933,053	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,984,000	93,297,916	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	283,605,000	280,071,281	

第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,100,000	187,693,334	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,581,000	96,806,999	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,978,000	96,892,659	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,860,000	198,712,776	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,530,000	99,786,787	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,752,000	200,231,404	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,106,000	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,000,000	
第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,141,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,653,000	
第２９４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,023,000	
第５８回日本学生支援債券	100,000,000	99,990,000	
第５９回日本学生支援債券	200,000,000	199,988,000	
第６０回日本学生支援債券	200,000,000	199,986,000	
第６２回日本学生支援債券	100,000,000	100,012,000	
第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	108,834,000	
い第８０２号商工債	100,000,000	100,035,000	
い第８０４号商工債	300,000,000	300,120,000	
い第８２３号商工債	200,000,000	200,762,000	
い第８２９号商工債	200,000,000	200,438,000	
い第８３２号商工債	200,000,000	199,968,000	
い第８３３号商工債	100,000,000	99,889,000	
い第８４３号商工債	200,000,000	200,274,000	
第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,164,000	
第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,161,000	
第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,336,000	
第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,185,000	
第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,136,000	
第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,808,000	
第２３６号商工債（３年）	300,000,000	299,949,000	
第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,243,000	
第２１回国際協力機構債券	100,000,000	117,781,000	
第４８回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,858,000	
第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,658,000	
第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,632,000	
第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	500,300,000	
第７４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,029,000	
第４２回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,072,000	

	第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,032,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,417,000	
	第２８回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,444,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,785,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,916,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,156,000	
特殊債券合計		38,322,324,000	39,860,565,417	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,355,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	298,995,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,239,000	
	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	100,391,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,486,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,348,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,962,000	
	第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,992,000	
	第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,362,000	
	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	400,048,000	
	第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,988,000	
	第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,162,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,008,000	
	第１５回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,828,000	
	第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,922,000	
	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	100,199,000	
	第９回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,804,000	
	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	100,185,000	
	第１３回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,866,000	
	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	101,827,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,131,000	
	第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,374,000	
	第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,175,000	
	第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,255,000	

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	101,990,000	
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	99,983,000	
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	99,740,000	
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	100,689,000	
第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	200,666,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,065,000	
第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,880,000	
第９回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,686,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,298,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,458,000	
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,482,000	
第３５回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,428,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,181,000	
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,752,000	
第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,684,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,173,000	
第６回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,662,000	
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	100,090,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,009,000	
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	199,890,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,760,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,229,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,288,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,300,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,668,000	
第２８回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	99,177,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,387,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,894,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,996,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,559,000	
第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,084,000	
第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,116,000	

第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,096,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,477,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,256,000	
第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,583,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,845,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
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	100,180,000	
第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,296,000	
第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,468,000	
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	100,198,000	
第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,091,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	96,005,000	
第１４回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,816,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,137,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,758,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,785,000	
第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,414,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,265,000	
第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,710,000	
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	99,778,000	
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	118,780,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	113,096,000	
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,473,000	
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	101,212,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,462,000	
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	304,311,000	
第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,907,000	
第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,854,000	
第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,666,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,406,000	
第２９回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
	100,000,000	99,614,000	

第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債			
第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,790,000	
第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,179,000	
第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,096,000	
第３７回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,295,000	
第７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,502,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,934,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,173,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,226,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,040,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,420,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,138,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,126,000	
第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,339,000	
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	199,790,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,282,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,516,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,820,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,265,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,142,000	
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	102,043,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,223,000	
第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,675,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,043,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,406,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,733,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,568,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,894,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,312,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,898,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,154,000	

第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	233,986,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,698,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,160,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,350,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,648,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,505,780	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,027,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,238,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,071,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,760,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,568,600	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,802,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,294,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,976,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,131,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,515,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,141,000	
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	192,684,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,675,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,942,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,879,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,458,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,931,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,340,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,300,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,115,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	97,712,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,356,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,072,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,014,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,508,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,525,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,657,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,444,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,889,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,507,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,388,000	

	第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,552,000	
	第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,758,000	
	第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,078,000	
	第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	200,978,000	
	第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,871,980	
	第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,947,000	
	第４８７回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,200,000	
	第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,921,000	
	第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,568,000	
	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,233,000	
	第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,014,000	
	第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,942,000	
	第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,652,000	
	第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,884,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,265,000	
	第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,218,000	
	第３１７回北海道電力株式会社社債	200,000,000	205,834,000	
	第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,954,000	
	第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,447,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,281,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,521,000	
	第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,371,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,161,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,590,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	404,132,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,811,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,129,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,608,000	
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,364,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	199,990,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,886,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,952,000	
	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	100,807,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	201,450,000	
社債券合計		25,665,000,000	25,983,464,360	
合計			605,790,231,084	

(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。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	159,183
コール・ローン	3,108,878,003
株式	370,896,226,800
派生商品評価勘定	67,255,600
未収入金	773,119,257
未収配当金	480,975,379
差入委託証拠金	115,115,000
流動資産合計	375,441,729,222
資産合計	375,441,729,222
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,480,000
前受金	64,799,800
未払解約金	892,177,735
未払利息	2,112
流動負債合計	959,459,647
負債合計	959,459,647
純資産の部	
元本等	
元本	211,981,845,770
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	162,500,423,805
元本等合計	374,482,269,575
純資産合計	374,482,269,575
負債純資産合計	375,441,729,222

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	2021年 1月20日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	211,981,845,770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 1.7666円 (1万口当たり純資産額) (17,666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

	2021年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 1月20日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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

	2021年 1月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	203,008,903,193円
期中追加設定元本額	61,313,272,877円
期中一部解約元本額	52,340,330,300円
期末元本額	211,981,845,770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）	469,053,291円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,914,606,315円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,081,785円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,634,966,009円
世界経済インデックスファンド	2,427,866,961円
日本株式インデックス・オープン	3,751,401,116円
ＤＣマイセレクション２５	6,685,894,628円
ＤＣマイセレクション５０	18,683,708,272円
ＤＣマイセレクション７５	17,771,178,469円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,748,228,227円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,686,557,145円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,150,003,857円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,456,238,584円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,199,967,849円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	313,012,120円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	714,081,173円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	489,910,345円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,076,833,535円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,601,702,591円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,524,205円

区分	2021年 1月20日現在
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	29,040,518円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	30,422,250円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	243,293,045円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,499,588円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	60,074,262円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	206,737,607円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	40,102,374円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	139,178,306円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,308,258,062円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	566,394,048円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,473,913,135円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	468,307,874円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	30,612,180円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	637,590,766円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	335,589,822円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	439,450,781円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	43,585,582円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	727,508,160円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	4,229,085,115円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,797,148,357円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,117,954,573円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,995,370,687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
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	359,877,970円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	369,379,069円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,246,595,330円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	202,448,918円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,458,875円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	61,681,242円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	26,402,806,618円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	711,059,384円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	29,511,971円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	92,443,907円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	16,169,532円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,938,806円
グローバル経済コア	240,117,845円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	21,223,329円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	96,529,375円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,942,364円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,205,588,025円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	113,342,689円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	516,288円

区分	2021年 1月20日現在
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	510,189円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	243,275円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	348,121円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	45,346,863,596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）	1,425,768,720円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	86,116,945円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,406,958円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	462,989,731円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	55,016,859,019
合計	55,016,859,019

(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

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,668,760,200	－	2,733,560,000	64,799,800
合計		2,668,760,200	－	2,733,560,000	64,799,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

		評価額	

銘　柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	6,900	3,020.00	20,838,000	
日本水産	196,700	426.00	83,794,200	
マルハニチロ	28,400	2,308.00	65,547,200	
雪国まいたけ	12,100	1,804.00	21,828,400	
カネコ種苗	6,000	1,540.00	9,240,000	
サカタのタネ	23,500	3,720.00	87,420,000	
ホクト	15,000	2,165.00	32,475,000	
ホクリヨウ	3,000	689.00	2,067,000	
住石ホールディングス	39,700	114.00	4,525,800	
日鉄鉱業	4,500	5,980.00	26,910,000	
三井松島ホールディングス	7,600	790.00	6,004,000	
国際石油開発帝石	723,300	642.00	464,358,600	
石油資源開発	25,700	2,126.00	54,638,200	
K＆Oエナジーグループ	9,500	1,461.00	13,879,500	
ヒノキヤグループ	4,900	2,029.00	9,942,100	
ショーボンドホールディングス	30,600	4,545.00	139,077,000	
ミライト・ホールディングス	58,500	1,737.00	101,614,500	
タマホーム	10,600	1,915.00	20,299,000	
サンヨーホームズ	1,700	820.00	1,394,000	
日本アクア	7,800	615.00	4,797,000	
ファーストコーポレーション	6,000	710.00	4,260,000	
ベステラ	3,400	1,905.00	6,477,000	
ＴＡＴＥＲＵ	36,900	179.00	6,605,100	
キャンディル	3,400	536.00	1,822,400	
スペースバリューホールディングス	24,000	701.00	16,824,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	762.00	2,895,600	
第一カッター興業	4,900	1,458.00	7,144,200	
安藤・間	117,100	747.00	87,473,700	
東急建設	57,600	522.00	30,067,200	
コムシスホールディングス	69,700	3,180.00	221,646,000	
ビーアールホールディングス	21,400	646.00	13,824,400	
高松コンストラクショングループ	12,200	2,073.00	25,290,600	
東建コーポレーション	6,100	8,010.00	48,861,000	
ソネック	2,000	852.00	1,704,000	
ヤマウラ	8,500	929.00	7,896,500	
大成建設	151,500	3,550.00	537,825,000	
大林組	454,200	912.00	414,230,400	
清水建設	460,900	761.00	350,744,900	
飛島建設	13,000	1,069.00	13,897,000	
長谷工コーポレーション	175,800	1,242.00	218,343,600	
松井建設	17,900	713.00	12,762,700	

錢高組	2,000	4,100.00	8,200,000	
鹿島建設	356,600	1,431.00	510,294,600	
不動テトラ	11,900	1,710.00	20,349,000	
大末建設	5,300	822.00	4,356,600	
鉄建建設	9,900	1,887.00	18,681,300	
西松建設	35,000	2,359.00	82,565,000	
三井住友建設	109,700	455.00	49,913,500	
大豊建設	10,800	3,650.00	39,420,000	
前田建設工業	113,800	906.00	103,102,800	
佐田建設	9,800	442.00	4,331,600	
ナカノフドー建設	12,400	394.00	4,885,600	
奥村組	21,400	2,656.00	56,838,400	
東鉄工業	19,500	2,746.00	53,547,000	
イチケン	3,300	1,885.00	6,220,500	
富士ピー・エス	6,700	590.00	3,953,000	
淺沼組	5,100	4,180.00	21,318,000	
戸田建設	188,600	734.00	138,432,400	
熊谷組	21,000	2,680.00	56,280,000	
北野建設	2,800	2,476.00	6,932,800	
植木組	2,000	2,712.00	5,424,000	
矢作建設工業	20,100	853.00	17,145,300	
ピーエス三菱	14,900	613.00	9,133,700	
日本ハウスホールディングス	31,000	330.00	10,230,000	
大東建託	49,600	9,440.00	468,224,000	
新日本建設	19,300	856.00	16,520,800	
ＮＩＰＰＯ	37,600	2,701.00	101,557,600	
東亜道路工業	2,800	3,845.00	10,766,000	
前田道路	40,100	1,762.00	70,656,200	
日本道路	4,400	7,690.00	33,836,000	
東亜建設工業	14,200	2,085.00	29,607,000	
日本国土開発	44,200	553.00	24,442,600	
若築建設	8,200	1,222.00	10,020,400	
東洋建設	50,900	494.00	25,144,600	
五洋建設	180,100	889.00	160,108,900	
世紀東急工業	21,800	824.00	17,963,200	
福田組	5,300	5,240.00	27,772,000	
住友林業	115,100	1,977.00	227,552,700	
日本基礎技術	15,300	465.00	7,114,500	
巴コーポレーション	20,200	410.00	8,282,000	
大和ハウス工業	449,400	3,026.00	1,359,884,400	
ライト工業	26,000	1,693.00	44,018,000	
積水ハウス	492,600	2,056.00	1,012,785,600	

日特建設	11,800	780.00	9,204,000	
北陸電気工事	7,900	1,249.00	9,867,100	
ユアテック	26,000	928.00	24,128,000	
日本リーテック	9,500	2,426.00	23,047,000	
四電工	2,500	2,604.00	6,510,000	
中電工	18,300	2,195.00	40,168,500	
関電工	64,600	917.00	59,238,200	
きんでん	107,900	1,717.00	185,264,300	
東京エネシス	15,100	1,032.00	15,583,200	
トーエネック	4,600	3,760.00	17,296,000	
住友電設	12,800	2,729.00	34,931,200	
日本電設工業	24,900	2,088.00	51,991,200	
協和エクシオ	68,900	2,826.00	194,711,400	
新日本空調	12,000	2,209.00	26,508,000	
九電工	31,900	3,195.00	101,920,500	
三機工業	32,200	1,250.00	40,250,000	
日揮ホールディングス	139,800	1,193.00	166,781,400	
中外炉工業	4,900	1,703.00	8,344,700	
ヤマト	14,500	733.00	10,628,500	
太平電業	11,000	2,560.00	28,160,000	
高砂熱学工業	34,700	1,614.00	56,005,800	
三晃金属工業	2,000	2,847.00	5,694,000	
朝日工業社	3,100	3,020.00	9,362,000	
明星工業	29,400	803.00	23,608,200	
大氣社	22,100	2,892.00	63,913,200	
ダイダン	10,900	2,896.00	31,566,400	
日比谷総合設備	14,600	1,858.00	27,126,800	
フィル・カンパニー	2,600	1,810.00	4,706,000	
ＯＳＪＢホールディングス	71,600	281.00	20,119,600	
東洋エンジニアリング	19,100	456.00	8,709,600	
レイズネクスト	24,400	1,215.00	29,646,000	
ニップン	42,500	1,641.00	69,742,500	
日清製粉グループ本社	164,200	1,657.00	272,079,400	
日東富士製粉	1,100	6,690.00	7,359,000	
昭和産業	13,300	3,045.00	40,498,500	
鳥越製粉	12,900	883.00	11,390,700	
中部飼料	17,800	1,425.00	25,365,000	
フィード・ワン	19,500	861.00	16,789,500	
東洋精糖	2,500	1,208.00	3,020,000	
日本甜菜製糖	7,600	1,626.00	12,357,600	
三井製糖	12,700	1,887.00	23,964,900	
塩水港精糖	15,700	224.00	3,516,800	

日新製糖	6,900	1,835.00	12,661,500	
森永製菓	34,100	3,860.00	131,626,000	
中村屋	3,800	3,885.00	14,763,000	
江崎グリコ	40,000	4,485.00	179,400,000	
名糖産業	7,000	1,401.00	9,807,000	
井村屋グループ	8,200	2,522.00	20,680,400	
不二家	9,300	2,225.00	20,692,500	
山崎製パン	109,000	1,720.00	187,480,000	
第一屋製パン	2,800	976.00	2,732,800	
モロゾフ	2,500	5,650.00	14,125,000	
亀田製菓	8,300	4,850.00	40,255,000	
寿スピリッツ	14,000	5,390.00	75,460,000	
カルビー	66,200	3,145.00	208,199,000	
森永乳業	26,900	5,040.00	135,576,000	
六甲バター	9,600	1,776.00	17,049,600	
ヤクルト本社	100,000	5,430.00	543,000,000	
明治ホールディングス	96,100	7,210.00	692,881,000	
雪印メグミルク	35,000	2,197.00	76,895,000	
プリマハム	22,700	3,205.00	72,753,500	
日本ハム	55,600	4,300.00	239,080,000	
林兼産業	4,800	590.00	2,832,000	
丸大食品	15,500	1,706.00	26,443,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	11,600	3,410.00	39,556,000	
柿安本店	5,000	2,690.00	13,450,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	93,600	686.00	64,209,600	
サッポロホールディングス	49,600	1,992.00	98,803,200	
アサヒグループホールディングス	317,600	4,253.00	1,350,752,800	
キリンホールディングス	616,500	2,269.00	1,398,838,500	
宝ホールディングス	107,800	1,250.00	134,750,000	
オエノンホールディングス	41,300	386.00	15,941,800	
養命酒製造	4,500	1,866.00	8,397,000	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	111,300	1,500.00	166,950,000	
サントリー食品インターナショナル	97,300	3,610.00	351,253,000	
ダイドーグループホールディングス	7,500	5,120.00	38,400,000	
伊藤園	44,100	6,430.00	283,563,000	
キーコーヒー	14,300	2,138.00	30,573,400	
ユニカフェ	4,400	995.00	4,378,000	
ジャパンフーズ	2,100	1,212.00	2,545,200	
日清オイリオグループ	18,700	3,070.00	57,409,000	
不二製油グループ本社	35,400	3,030.00	107,262,000	
かどや製油	1,600	3,970.00	6,352,000	
Ｊ－オイルミルズ	7,500	3,625.00	27,187,500	

キッコーマン	104,600	7,420.00	776,132,000	
味の素	321,000	2,472.50	793,672,500	
キユーピー	80,900	2,304.00	186,393,600	
ハウス食品グループ本社	54,400	3,715.00	202,096,000	
カゴメ	59,400	3,395.00	201,663,000	
焼津水産化学工業	7,000	998.00	6,986,000	
アリアケジャパン	13,300	6,650.00	88,445,000	
ピエトロ	1,900	1,744.00	3,313,600	
エバラ食品工業	3,500	2,487.00	8,704,500	
やまみ	1,300	2,126.00	2,763,800	
ニチレイ	69,200	2,849.00	197,150,800	
東洋水産	74,800	5,180.00	387,464,000	
イートアンドホールディングス	5,000	1,841.00	9,205,000	
大冷	1,900	1,917.00	3,642,300	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	800.00	6,480,000	
日清食品ホールディングス	61,800	9,230.00	570,414,000	
永谷園ホールディングス	7,100	2,283.00	16,209,300	
一正蒲鉾	5,600	1,145.00	6,412,000	
フジッコ	15,700	2,011.00	31,572,700	
ロック・フィールド	15,700	1,513.00	23,754,100	
日本たばこ産業	779,400	2,023.00	1,576,726,200	
ケンコーマヨネーズ	8,100	1,803.00	14,604,300	
わらべや日洋ホールディングス	9,500	1,639.00	15,570,500	
なとり	8,100	1,886.00	15,276,600	
イフジ産業	2,500	845.00	2,112,500	
ピックルスコーポレーション	3,200	3,920.00	12,544,000	
北の達人コーポレーション	50,700	521.00	26,414,700	
ユーグレナ	62,800	844.00	53,003,200	
ミヨシ油脂	5,100	1,153.00	5,880,300	
理研ビタミン	13,700	1,328.00	18,193,600	
片倉工業	19,300	1,374.00	26,518,200	
グンゼ	10,500	3,335.00	35,017,500	
東洋紡	56,400	1,342.00	75,688,800	
ユニチカ	42,600	400.00	17,040,000	
富士紡ホールディングス	7,000	4,310.00	30,170,000	
倉敷紡績	14,300	1,822.00	26,054,600	
シキボウ	7,400	1,037.00	7,673,800	
日本毛織	47,100	955.00	44,980,500	
トーア紡コーポレーション	5,600	467.00	2,615,200	
帝国繊維	16,200	2,313.00	37,470,600	
帝人	115,900	1,938.00	224,614,200	
東レ	1,027,700	704.90	724,425,730	

サカイオーベックス	4,000	2,023.00	8,092,000	
住江織物	3,100	2,040.00	6,324,000	
日本フエルト	9,000	425.00	3,825,000	
イチカワ	2,300	1,268.00	2,916,400	
日東製網	1,600	1,491.00	2,385,600	
アツギ	12,000	491.00	5,892,000	
ダイニック	5,400	780.00	4,212,000	
セーレン	35,100	1,569.00	55,071,900	
ソトー	5,900	820.00	4,838,000	
東海染工	2,100	1,118.00	2,347,800	
小松マテーレ	23,500	1,018.00	23,923,000	
ワコールホールディングス	35,500	2,095.00	74,372,500	
ホギメディカル	16,200	3,145.00	50,949,000	
ＴＳＩホールディングス	43,800	258.00	11,300,400	
マツオカコーポレーション	4,200	2,101.00	8,824,200	
ワールド	20,200	1,285.00	25,957,000	
三陽商会	7,400	659.00	4,876,600	
ナイガイ	5,700	335.00	1,909,500	
オンワードホールディングス	85,900	244.00	20,959,600	
ルックホールディングス	5,000	913.00	4,565,000	
ゴールドウイン	25,600	6,150.00	157,440,000	
デサント	27,800	1,804.00	50,151,200	
キング	7,000	600.00	4,200,000	
ヤマトインターナショナル	13,000	331.00	4,303,000	
特種東海製紙	8,700	4,715.00	41,020,500	
王子ホールディングス	593,000	640.00	379,520,000	
日本製紙	62,700	1,222.00	76,619,400	
三菱製紙	16,100	333.00	5,361,300	
北越コーポレーション	84,600	438.00	37,054,800	
中越パルプ工業	6,000	1,203.00	7,218,000	
巴川製紙所	4,200	779.00	3,271,800	
大王製紙	68,400	1,950.00	133,380,000	
阿波製紙	3,700	455.00	1,683,500	
レンゴー	134,100	867.00	116,264,700	
トーモク	8,700	1,812.00	15,764,400	
ザ・パック	10,700	2,624.00	28,076,800	
クラレ	223,400	1,080.00	241,272,000	
旭化成	940,200	1,136.50	1,068,537,300	
共和レザー	7,700	648.00	4,989,600	
昭和電工	107,700	2,443.00	263,111,100	
住友化学	1,042,200	466.00	485,665,200	
住友精化	6,300	4,440.00	27,972,000	

日産化学	78,200	5,990.00	468,418,000	
ラサ工業	5,000	2,570.00	12,850,000	
クレハ	12,200	6,860.00	83,692,000	
多木化学	5,500	5,980.00	32,890,000	
テイカ	10,400	1,511.00	15,714,400	
石原産業	25,400	720.00	18,288,000	
片倉コープアグリ	3,700	1,234.00	4,565,800	
日本曹達	19,800	3,015.00	59,697,000	
東ソー	219,300	1,752.00	384,213,600	
トクヤマ	40,900	2,494.00	102,004,600	
セントラル硝子	29,000	2,219.00	64,351,000	
東亞合成	89,000	1,184.00	105,376,000	
大阪ソーダ	14,400	2,603.00	37,483,200	
関東電化工業	33,600	824.00	27,686,400	
デンカ	51,800	4,225.00	218,855,000	
信越化学工業	243,600	19,095.00	4,651,542,000	
日本カーバイド工業	5,000	1,285.00	6,425,000	
堺化学工業	9,200	2,053.00	18,887,600	
第一稀元素化学工業	15,400	922.00	14,198,800	
エア・ウォーター	131,900	1,749.00	230,693,100	
日本酸素ホールディングス	136,300	1,978.00	269,601,400	
日本化学工業	4,400	3,265.00	14,366,000	
東邦アセチレン	2,100	1,490.00	3,129,000	
日本パーカライジング	71,600	1,042.00	74,607,200	
高圧ガス工業	22,500	786.00	17,685,000	
チタン工業	1,800	1,875.00	3,375,000	
四国化成工業	20,700	1,204.00	24,922,800	
戸田工業	3,300	2,338.00	7,715,400	
ステラ　ケミファ	7,700	3,630.00	27,951,000	
保土谷化学工業	5,300	5,410.00	28,673,000	
日本触媒	22,000	5,930.00	130,460,000	
大日精化工業	12,600	2,281.00	28,740,600	
カネカ	36,700	3,575.00	131,202,500	
三菱瓦斯化学	132,000	2,483.00	327,756,000	
三井化学	131,600	2,943.00	387,298,800	
ＪＳＲ	132,200	3,185.00	421,057,000	
東京応化工業	24,300	7,810.00	189,783,000	
大阪有機化学工業	13,100	3,810.00	49,911,000	
三菱ケミカルホールディングス	948,300	669.00	634,412,700	
ＫＨネオケム	23,400	2,548.00	59,623,200	
ダイセル	177,100	780.00	138,138,000	
住友ベークライト	22,300	3,755.00	83,736,500	

積水化学工業	300,000	1,968.00	590,400,000	
日本ゼオン	127,900	1,524.00	194,919,600	
アイカ工業	42,600	3,535.00	150,591,000	
宇部興産	71,600	1,935.00	138,546,000	
積水樹脂	25,500	2,086.00	53,193,000	
タキロンシーアイ	30,700	648.00	19,893,600	
旭有機材	8,000	1,517.00	12,136,000	
ニチバン	7,500	1,636.00	12,270,000	
リケンテクノス	34,600	459.00	15,881,400	
大倉工業	6,700	1,877.00	12,575,900	
積水化成品工業	19,000	539.00	10,241,000	
群栄化学工業	3,200	2,414.00	7,724,800	
タイガースポリマー	7,500	402.00	3,015,000	
ミライアル	5,000	1,254.00	6,270,000	
ダイキアクシス	5,000	1,132.00	5,660,000	
ダイキョーニシカワ	29,900	807.00	24,129,300	
竹本容器	5,100	919.00	4,686,900	
森六ホールディングス	7,600	2,048.00	15,564,800	
日本化薬	87,800	1,000.00	87,800,000	
カーリットホールディングス	15,100	770.00	11,627,000	
日本精化	11,400	1,360.00	15,504,000	
扶桑化学工業	14,400	4,150.00	59,760,000	
トリケミカル研究所	3,200	18,230.00	58,336,000	
ＡＤＥＫＡ	65,300	1,789.00	116,821,700	
日油	53,400	4,940.00	263,796,000	
新日本理化	23,500	300.00	7,050,000	
ハリマ化成グループ	11,700	968.00	11,325,600	
花王	346,800	7,635.00	2,647,818,000	
第一工業製薬	5,300	4,135.00	21,915,500	
石原ケミカル	3,900	2,119.00	8,264,100	
日華化学	4,800	903.00	4,334,400	
ニイタカ	2,900	2,832.00	8,212,800	
三洋化成工業	8,500	5,440.00	46,240,000	
有機合成薬品工業	10,900	316.00	3,444,400	
大日本塗料	16,000	930.00	14,880,000	
日本ペイントホールディングス	117,100	9,050.00	1,059,755,000	
関西ペイント	159,400	2,847.00	453,811,800	
神東塗料	11,200	214.00	2,396,800	
中国塗料	40,400	993.00	40,117,200	
日本特殊塗料	10,600	1,089.00	11,543,400	
藤倉化成	19,100	505.00	9,645,500	
太陽ホールディングス	10,400	6,540.00	68,016,000	

ＤＩＣ	59,900	2,571.00	154,002,900	
サカタインクス	31,000	1,057.00	32,767,000	
東洋インキＳＣホールディングス	30,000	1,860.00	55,800,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	11,000	809.00	8,899,000	
富士フイルムホールディングス	277,700	6,162.00	1,711,187,400	
資生堂	287,800	6,715.00	1,932,577,000	
ライオン	188,300	2,433.00	458,133,900	
高砂香料工業	9,100	2,545.00	23,159,500	
マンダム	32,600	1,600.00	52,160,000	
ミルボン	19,400	6,540.00	126,876,000	
ファンケル	58,600	3,860.00	226,196,000	
コーセー	27,200	16,280.00	442,816,000	
コタ	8,300	1,483.00	12,308,900	
シーボン	1,900	1,953.00	3,710,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	61,800	2,086.00	128,914,800	
ノエビアホールディングス	12,300	4,610.00	56,703,000	
アジュバンコスメジャパン	3,200	1,053.00	3,369,600	
エステー	9,300	1,954.00	18,172,200	
アグロ　カネショウ	5,400	1,587.00	8,569,800	
コニシ	23,800	1,543.00	36,723,400	
長谷川香料	25,000	2,032.00	50,800,000	
星光ＰＭＣ	8,300	763.00	6,332,900	
小林製薬	40,600	12,030.00	488,418,000	
荒川化学工業	13,000	1,201.00	15,613,000	
メック	9,900	2,393.00	23,690,700	
日本高純度化学	4,000	2,739.00	10,956,000	
タカラバイオ	37,900	2,808.00	106,423,200	
ＪＣＵ	17,500	3,895.00	68,162,500	
新田ゼラチン	9,100	659.00	5,996,900	
ＯＡＴアグリオ	2,700	1,286.00	3,472,200	
デクセリアルズ	37,500	1,383.00	51,862,500	
アース製薬	10,900	5,970.00	65,073,000	
北興化学工業	13,500	1,212.00	16,362,000	
大成ラミック	4,800	2,831.00	13,588,800	
クミアイ化学工業	59,900	869.00	52,053,100	
日本農薬	25,800	489.00	12,616,200	
アキレス	10,000	1,459.00	14,590,000	
有沢製作所	21,700	972.00	21,092,400	
日東電工	99,900	9,420.00	941,058,000	
レック	15,400	1,341.00	20,651,400	
三光合成	16,600	458.00	7,602,800	
きもと	24,600	177.00	4,354,200	

藤森工業	13,000	4,630.00	60,190,000	
前澤化成工業	9,200	980.00	9,016,000	
未来工業	7,800	1,603.00	12,503,400	
ウェーブロックホールディングス	5,000	852.00	4,260,000	
ＪＳＰ	8,500	1,724.00	14,654,000	
エフピコ	30,400	4,155.00	126,312,000	
天馬	9,600	2,145.00	20,592,000	
信越ポリマー	26,000	966.00	25,116,000	
東リ	36,100	244.00	8,808,400	
ニフコ	53,200	3,750.00	199,500,000	
バルカー	11,800	2,085.00	24,603,000	
ユニ・チャーム	307,100	4,960.00	1,523,216,000	
ショーエイコーポレーション	2,400	1,035.00	2,484,000	
協和キリン	145,700	2,841.00	413,933,700	
武田薬品工業	1,205,100	3,595.00	4,332,334,500	
アステラス製薬	1,255,800	1,678.00	2,107,232,400	
大日本住友製薬	107,400	1,506.00	161,744,400	
塩野義製薬	182,100	5,732.00	1,043,797,200	
わかもと製薬	17,200	243.00	4,179,600	
あすか製薬	16,500	1,534.00	25,311,000	
日本新薬	37,900	7,120.00	269,848,000	
ビオフェルミン製薬	2,500	2,510.00	6,275,000	
中外製薬	453,000	5,573.00	2,524,569,000	
科研製薬	24,800	4,020.00	99,696,000	
エーザイ	173,400	7,560.00	1,310,904,000	
ロート製薬	74,300	3,160.00	234,788,000	
小野薬品工業	332,600	3,107.00	1,033,388,200	
久光製薬	38,300	6,050.00	231,715,000	
持田製薬	20,100	3,895.00	78,289,500	
参天製薬	269,900	1,678.00	452,892,200	
扶桑薬品工業	5,100	2,600.00	13,260,000	
日本ケミファ	1,900	2,238.00	4,252,200	
ツムラ	44,900	3,405.00	152,884,500	
日医工	41,000	994.00	40,754,000	
キッセイ薬品工業	25,600	2,268.00	58,060,800	
生化学工業	28,100	1,008.00	28,324,800	
栄研化学	25,500	1,966.00	50,133,000	
日水製薬	6,100	1,002.00	6,112,200	
鳥居薬品	9,100	3,215.00	29,256,500	
ＪＣＲファーマ	40,800	2,388.00	97,430,400	
東和薬品	18,500	1,972.00	36,482,000	
富士製薬工業	9,800	1,225.00	12,005,000	

沢井製薬	29,700	4,785.00	142,114,500	
ゼリア新薬工業	26,300	1,916.00	50,390,800	
第一三共	1,243,400	3,601.00	4,477,483,400	
キョーリン製薬ホールディングス	32,000	1,962.00	62,784,000	
大幸薬品	17,800	1,531.00	27,251,800	
ダイト	9,300	3,555.00	33,061,500	
大塚ホールディングス	301,000	4,468.00	1,344,868,000	
大正製薬ホールディングス	30,600	7,170.00	219,402,000	
ペプチドリーム	73,600	5,990.00	440,864,000	
日本コークス工業	122,400	91.00	11,138,400	
ニチレキ	17,100	1,548.00	26,470,800	
ユシロ化学工業	8,100	1,082.00	8,764,200	
ビーピー・カストロール	5,200	1,245.00	6,474,000	
富士石油	38,700	191.00	7,391,700	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,200	1,118.00	5,813,600	
出光興産	160,700	2,477.00	398,053,900	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,178,900	422.90	921,456,810	
コスモエネルギーホールディングス	41,900	2,292.00	96,034,800	
横浜ゴム	83,900	1,693.00	142,042,700	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	76,200	1,688.00	128,625,600	
ブリヂストン	385,100	4,066.00	1,565,816,600	
住友ゴム工業	130,100	989.00	128,668,900	
藤倉コンポジット	12,700	392.00	4,978,400	
オカモト	8,800	3,980.00	35,024,000	
フコク	6,300	668.00	4,208,400	
ニッタ	16,300	2,244.00	36,577,200	
住友理工	28,100	586.00	16,466,600	
三ツ星ベルト	19,100	1,698.00	32,431,800	
バンドー化学	25,500	671.00	17,110,500	
日東紡績	21,600	4,710.00	101,736,000	
ＡＧＣ	133,000	3,920.00	521,360,000	
日本板硝子	69,300	491.00	34,026,300	
石塚硝子	2,700	1,872.00	5,054,400	
日本山村硝子	6,200	864.00	5,356,800	
日本電気硝子	53,800	2,249.00	120,996,200	
オハラ	5,800	1,874.00	10,869,200	
住友大阪セメント	26,100	3,030.00	79,083,000	
太平洋セメント	91,500	2,599.00	237,808,500	
日本ヒューム	14,700	779.00	11,451,300	
日本コンクリート工業	31,700	309.00	9,795,300	
三谷セキサン	6,800	4,795.00	32,606,000	
アジアパイルホールディングス	20,900	493.00	10,303,700	

東海カーボン	141,700	1,483.00	210,141,100	
日本カーボン	8,000	4,155.00	33,240,000	
東洋炭素	8,600	2,062.00	17,733,200	
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	3,140.00	25,434,000	
ＴＯＴＯ	103,500	5,910.00	611,685,000	
日本碍子	174,000	1,756.00	305,544,000	
日本特殊陶業	110,300	1,809.00	199,532,700	
ＭＡＲＵＷＡ	5,600	12,000.00	67,200,000	
品川リフラクトリーズ	3,900	2,650.00	10,335,000	
黒崎播磨	2,900	4,670.00	13,543,000	
ヨータイ	11,700	843.00	9,863,100	
イソライト工業	7,700	550.00	4,235,000	
東京窯業	18,900	349.00	6,596,100	
ニッカトー	6,700	805.00	5,393,500	
フジミインコーポレーテッド	12,900	4,415.00	56,953,500	
クニミネ工業	6,000	1,129.00	6,774,000	
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,068.00	2,563,200	
ニチアス	39,700	2,441.00	96,907,700	
ニチハ	20,200	3,175.00	64,135,000	
日本製鉄	641,100	1,353.50	867,728,850	
神戸製鋼所	262,300	549.00	144,002,700	
中山製鋼所	20,000	371.00	7,420,000	
合同製鐵	7,700	2,025.00	15,592,500	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	386,900	1,025.00	396,572,500	
東京製鐵	69,800	662.00	46,207,600	
共英製鋼	16,200	1,401.00	22,696,200	
大和工業	30,500	2,756.00	84,058,000	
東京鐵鋼	5,900	2,040.00	12,036,000	
大阪製鐵	7,700	1,289.00	9,925,300	
淀川製鋼所	19,400	2,191.00	42,505,400	
丸一鋼管	46,500	2,324.00	108,066,000	
モリ工業	4,300	2,256.00	9,700,800	
大同特殊鋼	23,500	4,415.00	103,752,500	
日本高周波鋼業	5,500	353.00	1,941,500	
日本冶金工業	11,900	1,769.00	21,051,100	
山陽特殊製鋼	9,800	1,506.00	14,758,800	
愛知製鋼	8,100	3,170.00	25,677,000	
日立金属	154,300	1,676.00	258,606,800	
日本金属	3,300	1,310.00	4,323,000	
大平洋金属	9,700	2,350.00	22,795,000	
新日本電工	92,600	284.00	26,298,400	
栗本鐵工所	7,100	1,623.00	11,523,300	

虹技	2,200	1,087.00	2,391,400	
三菱製鋼	10,700	650.00	6,955,000	
日亜鋼業	21,200	300.00	6,360,000	
日本精線	2,400	3,755.00	9,012,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,200	738.00	4,575,600	
シンニッタン	22,600	204.00	4,610,400	
新家工業	3,300	1,291.00	4,260,300	
大紀アルミニウム工業所	23,700	782.00	18,533,400	
日本軽金属ホールディングス	36,300	1,969.00	71,474,700	
三井金属鉱業	38,700	3,980.00	154,026,000	
東邦亜鉛	7,400	2,372.00	17,552,800	
三菱マテリアル	94,600	2,327.00	220,134,200	
住友金属鉱山	183,100	5,007.00	916,781,700	
ＤＯＷＡホールディングス	36,300	4,055.00	147,196,500	
古河機械金属	25,500	1,274.00	32,487,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,000	867.00	13,005,000	
東邦チタニウム	25,700	925.00	23,772,500	
ＵＡＣＪ	21,800	1,932.00	42,117,600	
ＣＫサンエツ	3,000	3,805.00	11,415,000	
古河電気工業	44,500	2,877.00	128,026,500	
住友電気工業	535,600	1,445.50	774,209,800	
フジクラ	173,000	494.00	85,462,000	
昭和電線ホールディングス	16,700	1,819.00	30,377,300	
東京特殊電線	2,200	2,414.00	5,310,800	
タツタ電線	28,500	783.00	22,315,500	
カナレ電気	2,400	1,707.00	4,096,800	
平河ヒューテック	7,200	1,339.00	9,640,800	
リョービ	17,700	1,272.00	22,514,400	
アーレスティ	19,000	357.00	6,783,000	
アサヒホールディングス	25,100	4,055.00	101,780,500	
稲葉製作所	8,100	1,406.00	11,388,600	
宮地エンジニアリンググループ	4,400	2,528.00	11,123,200	
トーカロ	39,800	1,557.00	61,968,600	
アルファＣｏ	5,000	1,011.00	5,055,000	
ＳＵＭＣＯ	183,300	2,419.00	443,402,700	
川田テクノロジーズ	2,900	4,300.00	12,470,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,700	7,270.00	34,169,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,730.00	3,730,000	
信和	8,200	699.00	5,731,800	
東洋製罐グループホールディングス	91,200	1,159.00	105,700,800	
ホッカンホールディングス	7,900	1,443.00	11,399,700	
コロナ	7,900	959.00	7,576,100	

横河ブリッジホールディングス	26,600	2,047.00	54,450,200	
駒井ハルテック	2,700	2,420.00	6,534,000	
高田機工	1,300	2,534.00	3,294,200	
三和ホールディングス	135,000	1,219.00	164,565,000	
文化シヤッター	42,200	938.00	39,583,600	
三協立山	18,400	844.00	15,529,600	
アルインコ	10,400	937.00	9,744,800	
東洋シヤッター	3,400	651.00	2,213,400	
ＬＩＸＩＬ	211,300	2,406.00	508,387,800	
日本フイルコン	10,000	499.00	4,990,000	
ノーリツ	29,700	1,545.00	45,886,500	
長府製作所	14,600	2,099.00	30,645,400	
リンナイ	27,900	11,290.00	314,991,000	
ダイニチ工業	7,700	903.00	6,953,100	
日東精工	18,000	452.00	8,136,000	
三洋工業	1,900	1,887.00	3,585,300	
岡部	29,000	776.00	22,504,000	
ジーテクト	17,800	1,467.00	26,112,600	
東プレ	26,700	1,457.00	38,901,900	
高周波熱錬	27,600	493.00	13,606,800	
東京製綱	10,200	1,099.00	11,209,800	
サンコール	10,700	463.00	4,954,100	
モリテック　スチール	11,200	434.00	4,860,800	
パイオラックス	21,200	1,549.00	32,838,800	
エイチワン	14,000	764.00	10,696,000	
日本発條	153,700	718.00	110,356,600	
中央発條	1,700	2,785.00	4,734,500	
アドバネクス	2,100	1,340.00	2,814,000	
立川ブラインド工業	6,300	1,318.00	8,303,400	
三益半導体工業	11,200	3,080.00	34,496,000	
日本ドライケミカル	3,600	1,524.00	5,486,400	
日本製鋼所	43,500	3,195.00	138,982,500	
三浦工業	62,000	6,170.00	382,540,000	
タクマ	48,600	2,064.00	100,310,400	
ツガミ	29,800	1,702.00	50,719,600	
オークマ	16,700	6,180.00	103,206,000	
芝浦機械	16,200	2,341.00	37,924,200	
アマダ	177,800	1,206.00	214,426,800	
アイダエンジニアリング	37,600	1,001.00	37,637,600	
滝澤鉄工所	4,500	1,001.00	4,504,500	
ＦＵＪＩ	61,600	2,797.00	172,295,200	
牧野フライス製作所	16,800	4,015.00	67,452,000	

オーエスジー	70,700	1,920.00	135,744,000	
ダイジェット工業	1,700	1,334.00	2,267,800	
旭ダイヤモンド工業	37,900	466.00	17,661,400	
DMG森精機	90,700	1,650.00	149,655,000	
ソディック	31,300	905.00	28,326,500	
ディスコ	19,400	37,650.00	730,410,000	
日東工器	7,900	1,751.00	13,832,900	
日進工具	5,700	2,811.00	16,022,700	
パンチ工業	13,100	445.00	5,829,500	
冨士ダイス	6,400	669.00	4,281,600	
豊和工業	8,100	941.00	7,622,100	
ＯＫＫ	5,900	421.00	2,483,900	
東洋機械金属	10,400	430.00	4,472,000	
津田駒工業	2,800	922.00	2,581,600	
エンシュウ	3,600	891.00	3,207,600	
島精機製作所	22,600	1,860.00	42,036,000	
オプトラン	18,000	2,165.00	38,970,000	
ＮＣホールディングス	4,500	584.00	2,628,000	
イワキポンプ	9,200	842.00	7,746,400	
フリュー	14,100	1,116.00	15,735,600	
ヤマシンフィルタ	32,100	1,057.00	33,929,700	
日阪製作所	17,800	870.00	15,486,000	
やまびこ	27,800	1,320.00	36,696,000	
平田機工	6,800	8,350.00	56,780,000	
ペガサスミシン製造	14,800	347.00	5,135,600	
マルマエ	5,300	1,400.00	7,420,000	
タツモ	6,100	1,547.00	9,436,700	
ナブテスコ	84,400	4,975.00	419,890,000	
三井海洋開発	15,300	2,079.00	31,808,700	
レオン自動機	14,100	1,169.00	16,482,900	
ＳＭＣ	45,400	66,880.00	3,036,352,000	
ホソカワミクロン	5,000	6,470.00	32,350,000	
ユニオンツール	5,400	3,230.00	17,442,000	
オイレス工業	18,600	1,664.00	30,950,400	
日精エー・エス・ビー機械	4,200	6,280.00	26,376,000	
サトーホールディングス	20,500	2,213.00	45,366,500	
技研製作所	12,600	4,950.00	62,370,000	
日本エアーテック	4,700	1,480.00	6,956,000	
カワタ	4,300	1,020.00	4,386,000	
日精樹脂工業	12,200	887.00	10,821,400	
オカダアイヨン	4,600	1,150.00	5,290,000	
ワイエイシイホールディングス	6,100	1,144.00	6,978,400	

小松製作所	656,100	3,035.00	1,991,263,500	
住友重機械工業	83,000	2,994.00	248,502,000	
日立建機	58,100	3,170.00	184,177,000	
日工	20,000	719.00	14,380,000	
巴工業	5,700	2,040.00	11,628,000	
井関農機	14,600	1,409.00	20,571,400	
ＴＯＷＡ	14,700	2,236.00	32,869,200	
丸山製作所	3,000	1,547.00	4,641,000	
北川鉄工所	6,600	1,361.00	8,982,600	
ローツェ	6,400	8,880.00	56,832,000	
タカキタ	5,100	716.00	3,651,600	
クボタ	760,900	2,380.00	1,810,942,000	
荏原実業	3,700	3,910.00	14,467,000	
三菱化工機	5,000	3,460.00	17,300,000	
月島機械	26,800	1,429.00	38,297,200	
帝国電機製作所	12,000	1,232.00	14,784,000	
新東工業	34,600	764.00	26,434,400	
澁谷工業	12,700	3,590.00	45,593,000	
アイチ　コーポレーション	25,200	924.00	23,284,800	
小森コーポレーション	36,900	713.00	26,309,700	
鶴見製作所	11,200	1,870.00	20,944,000	
住友精密工業	2,200	2,007.00	4,415,400	
日本ギア工業	6,100	296.00	1,805,600	
酒井重工業	2,800	2,187.00	6,123,600	
荏原製作所	60,100	3,700.00	222,370,000	
石井鐵工所	1,900	2,893.00	5,496,700	
酉島製作所	14,800	846.00	12,520,800	
北越工業	15,000	1,045.00	15,675,000	
ダイキン工業	184,500	22,810.00	4,208,445,000	
オルガノ	5,200	6,740.00	35,048,000	
トーヨーカネツ	6,400	2,512.00	16,076,800	
栗田工業	78,400	4,455.00	349,272,000	
椿本チエイン	20,700	2,727.00	56,448,900	
大同工業	7,100	719.00	5,104,900	
木村化工機	12,300	656.00	8,068,800	
アネスト岩田	22,600	1,102.00	24,905,200	
ダイフク	74,000	12,760.00	944,240,000	
サムコ	3,600	3,955.00	14,238,000	
加藤製作所	8,100	963.00	7,800,300	
油研工業	2,500	1,585.00	3,962,500	
タダノ	70,000	949.00	66,430,000	
フジテック	52,700	2,314.00	121,947,800	

ＣＫＤ	39,700	2,534.00	100,599,800	
キトー	11,000	1,588.00	17,468,000	
平和	40,500	1,459.00	59,089,500	
理想科学工業	12,900	1,356.00	17,492,400	
ＳＡＮＫＹＯ	32,300	2,862.00	92,442,600	
日本金銭機械	16,200	520.00	8,424,000	
マースグループホールディングス	9,200	1,533.00	14,103,600	
フクシマガリレイ	8,900	4,575.00	40,717,500	
オーイズミ	6,300	406.00	2,557,800	
ダイコク電機	6,700	888.00	5,949,600	
竹内製作所	24,300	2,487.00	60,434,100	
アマノ	38,000	2,361.00	89,718,000	
ＪＵＫＩ	20,200	534.00	10,786,800	
蛇の目ミシン工業	13,300	796.00	10,586,800	
マックス	22,200	1,428.00	31,701,600	
グローリー	37,200	2,061.00	76,669,200	
新晃工業	13,500	1,773.00	23,935,500	
大和冷機工業	23,300	1,011.00	23,556,300	
セガサミーホールディングス	143,700	1,669.00	239,835,300	
日本ピストンリング	5,400	942.00	5,086,800	
リケン	6,700	2,116.00	14,177,200	
ＴＰＲ	19,500	1,432.00	27,924,000	
ツバキ・ナカシマ	27,800	1,278.00	35,528,400	
ホシザキ	45,600	9,140.00	416,784,000	
大豊工業	11,900	747.00	8,889,300	
日本精工	272,800	928.00	253,158,400	
ＮＴＮ	335,200	277.00	92,850,400	
ジェイテクト	139,000	863.00	119,957,000	
不二越	13,500	4,545.00	61,357,500	
日本トムソン	43,100	464.00	19,998,400	
ＴＨＫ	90,300	3,510.00	316,953,000	
ユーシン精機	11,300	1,015.00	11,469,500	
前澤給装工業	5,300	2,265.00	12,004,500	
イーグル工業	18,000	979.00	17,622,000	
前澤工業	9,800	638.00	6,252,400	
日本ピラー工業	14,700	1,630.00	23,961,000	
キッツ	53,000	608.00	32,224,000	
マキタ	188,900	4,820.00	910,498,000	
日立造船	115,000	690.00	79,350,000	
三菱重工業	242,800	3,189.00	774,289,200	
ＩＨＩ	104,400	2,021.00	210,992,400	
スター精密	22,400	1,606.00	35,974,400	

日清紡ホールディングス	88,700	782.00	69,363,400	
イビデン	88,800	5,080.00	451,104,000	
コニカミノルタ	318,400	428.00	136,275,200	
ブラザー工業	177,200	2,364.00	418,900,800	
ミネベアミツミ	269,200	2,200.00	592,240,000	
日立製作所	696,000	4,359.00	3,033,864,000	
三菱電機	1,448,400	1,668.50	2,416,655,400	
富士電機	87,300	4,060.00	354,438,000	
東洋電機製造	5,300	1,175.00	6,227,500	
安川電機	155,900	5,680.00	885,512,000	
シンフォニアテクノロジー	18,800	1,464.00	27,523,200	
明電舎	26,700	2,431.00	64,907,700	
オリジン	4,000	1,338.00	5,352,000	
山洋電気	7,100	6,050.00	42,955,000	
デンヨー	12,400	2,082.00	25,816,800	
東芝テック	18,200	3,755.00	68,341,000	
芝浦メカトロニクス	2,700	5,680.00	15,336,000	
マブチモーター	40,300	4,210.00	169,663,000	
日本電産	348,600	14,100.00	4,915,260,000	
トレックス・セミコンダクター	8,900	1,402.00	12,477,800	
東光高岳	8,600	1,611.00	13,854,600	
ダイヘン	15,900	5,110.00	81,249,000	
ヤーマン	24,000	1,983.00	47,592,000	
ＪＶＣケンウッド	122,600	182.00	22,313,200	
ミマキエンジニアリング	14,700	489.00	7,188,300	
Ｉ－ＰＥＸ	7,100	2,028.00	14,398,800	
日新電機	34,000	1,346.00	45,764,000	
大崎電気工業	29,000	590.00	17,110,000	
オムロン	129,900	9,630.00	1,250,937,000	
日東工業	21,300	2,036.00	43,366,800	
ＩＤＥＣ	21,000	1,770.00	37,170,000	
正興電機製作所	3,800	2,132.00	8,101,600	
不二電機工業	3,000	1,309.00	3,927,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	48,600	3,180.00	154,548,000	
サクサホールディングス	3,400	1,369.00	4,654,600	
メルコホールディングス	5,200	3,435.00	17,862,000	
テクノメディカ	3,800	1,590.00	6,042,000	
日本電気	175,700	5,720.00	1,005,004,000	
富士通	139,600	15,950.00	2,226,620,000	
沖電気工業	58,900	1,068.00	62,905,200	
岩崎通信機	6,300	840.00	5,292,000	
電気興業	7,000	2,760.00	19,320,000	

サンケン電気	15,800	5,150.00	81,370,000	
ナカヨ	2,900	1,425.00	4,132,500	
アイホン	8,300	1,652.00	13,711,600	
ルネサスエレクトロニクス	622,800	1,306.00	813,376,800	
セイコーエプソン	179,800	1,666.00	299,546,800	
ワコム	98,200	964.00	94,664,800	
アルバック	26,700	5,140.00	137,238,000	
アクセル	7,100	782.00	5,552,200	
ＥＩＺＯ	11,300	3,710.00	41,923,000	
日本信号	37,000	935.00	34,595,000	
京三製作所	34,200	413.00	14,124,600	
能美防災	19,500	2,245.00	43,777,500	
ホーチキ	11,100	1,243.00	13,797,300	
星和電機	8,300	653.00	5,419,900	
エレコム	16,700	4,950.00	82,665,000	
パナソニック	1,654,800	1,337.50	2,213,295,000	
シャープ	167,600	2,035.00	341,066,000	
アンリツ	93,300	2,686.00	250,603,800	
富士通ゼネラル	39,400	2,640.00	104,016,000	
ソニー	907,300	10,590.00	9,608,307,000	
ＴＤＫ	70,000	17,540.00	1,227,800,000	
帝国通信工業	7,100	1,062.00	7,540,200	
タムラ製作所	48,600	575.00	27,945,000	
アルプスアルパイン	128,700	1,442.00	185,585,400	
池上通信機	4,600	879.00	4,043,400	
鈴木	7,800	1,188.00	9,266,400	
日本トリム	2,100	4,335.00	9,103,500	
ローランド　ディー．ジー．	9,000	1,804.00	16,236,000	
フォスター電機	15,300	1,456.00	22,276,800	
ＳＭＫ	3,700	3,055.00	11,303,500	
ヨコオ	9,600	3,260.00	31,296,000	
ホシデン	40,400	958.00	38,703,200	
ヒロセ電機	22,300	15,480.00	345,204,000	
日本航空電子工業	33,300	1,595.00	53,113,500	
ＴＯＡ	15,700	869.00	13,643,300	
マクセルホールディングス	31,800	1,342.00	42,675,600	
古野電気	19,300	1,131.00	21,828,300	
ユニデンホールディングス	4,000	2,223.00	8,892,000	
スミダコーポレーション	13,100	1,048.00	13,728,800	
アイコム	8,100	2,715.00	21,991,500	
リオン	6,300	3,435.00	21,640,500	
本多通信工業	14,000	477.00	6,678,000	

横河電機	132,900	2,322.00	308,593,800	
新電元工業	5,200	2,917.00	15,168,400	
アズビル	91,400	5,730.00	523,722,000	
東亜ディーケーケー	8,100	833.00	6,747,300	
日本光電工業	60,100	2,901.00	174,350,100	
チノー	5,100	1,411.00	7,196,100	
共和電業	15,400	386.00	5,944,400	
日本電子材料	5,800	2,390.00	13,862,000	
堀場製作所	28,700	6,830.00	196,021,000	
アドバンテスト	107,700	9,220.00	992,994,000	
小野測器	7,500	526.00	3,945,000	
エスペック	13,200	1,952.00	25,766,400	
キーエンス	131,200	56,470.00	7,408,864,000	
日置電機	7,100	4,135.00	29,358,500	
シスメックス	103,600	13,000.00	1,346,800,000	
日本マイクロニクス	25,700	1,541.00	39,603,700	
メガチップス	13,700	3,245.00	44,456,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,600	4,050.00	34,830,000	
澤藤電機	2,100	2,227.00	4,676,700	
原田工業	7,800	845.00	6,591,000	
コーセル	19,900	1,247.00	24,815,300	
イリソ電子工業	12,300	4,840.00	59,532,000	
オプテックスグループ	24,200	2,099.00	50,795,800	
千代田インテグレ	6,500	1,829.00	11,888,500	
アイ・オー・データ機器	5,500	1,003.00	5,516,500	
レーザーテック	63,700	15,130.00	963,781,000	
スタンレー電気	101,800	3,185.00	324,233,000	
岩崎電気	6,200	1,423.00	8,822,600	
ウシオ電機	80,500	1,392.00	112,056,000	
岡谷電機産業	13,400	361.00	4,837,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	15,900	314.00	4,992,600	
エノモト	4,800	1,627.00	7,809,600	
日本セラミック	15,000	2,854.00	42,810,000	
遠藤照明	8,800	513.00	4,514,400	
古河電池	10,800	1,684.00	18,187,200	
双信電機	8,700	451.00	3,923,700	
山一電機	11,000	1,784.00	19,624,000	
図研	9,700	2,694.00	26,131,800	
日本電子	28,700	4,660.00	133,742,000	
カシオ計算機	128,200	1,787.00	229,093,400	
ファナック	136,200	27,525.00	3,748,905,000	
日本シイエムケイ	36,000	427.00	15,372,000	

エンプラス	7,600	4,210.00	31,996,000	
大真空	5,600	2,615.00	14,644,000	
ローム	60,300	11,940.00	719,982,000	
浜松ホトニクス	104,000	6,460.00	671,840,000	
三井ハイテック	16,200	4,545.00	73,629,000	
新光電気工業	48,900	2,691.00	131,589,900	
京セラ	203,900	6,843.00	1,395,287,700	
太陽誘電	64,500	6,100.00	393,450,000	
村田製作所	425,500	10,370.00	4,412,435,000	
双葉電子工業	23,700	993.00	23,534,100	
北陸電気工業	6,700	928.00	6,217,600	
ニチコン	49,700	1,470.00	73,059,000	
日本ケミコン	11,900	1,970.00	23,443,000	
ＫＯＡ	22,400	1,550.00	34,720,000	
市光工業	22,900	664.00	15,205,600	
小糸製作所	86,900	6,980.00	606,562,000	
ミツバ	26,600	458.00	12,182,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	25,100	8,870.00	222,637,000	
キヤノン電子	13,800	1,616.00	22,300,800	
キヤノン	719,800	2,225.50	1,601,914,900	
リコー	368,600	741.00	273,132,600	
象印マホービン	39,600	1,749.00	69,260,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,300	1,513.00	3,479,900	
東京エレクトロン	91,900	44,530.00	4,092,307,000	
トヨタ紡織	42,200	1,701.00	71,782,200	
芦森工業	3,100	928.00	2,876,800	
ユニプレス	28,100	980.00	27,538,000	
豊田自動織機	117,200	8,380.00	982,136,000	
モリタホールディングス	25,400	1,741.00	44,221,400	
三櫻工業	18,400	955.00	17,572,000	
デンソー	318,900	5,993.00	1,911,167,700	
東海理化電機製作所	38,200	1,725.00	65,895,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	52,300	446.00	23,325,800	
川崎重工業	112,700	2,464.00	277,692,800	
名村造船所	46,600	178.00	8,294,800	
日本車輌製造	5,300	2,525.00	13,382,500	
三菱ロジスネクスト	19,200	1,227.00	23,558,400	
近畿車輛	2,200	1,218.00	2,679,600	
日産自動車	1,708,200	556.20	950,100,840	
いすゞ自動車	419,700	972.00	407,948,400	
トヨタ自動車	1,616,100	7,686.00	12,421,344,600	
日野自動車	180,900	929.00	168,056,100	

三菱自動車工業	536,100	234.00	125,447,400	
エフテック	10,200	618.00	6,303,600	
レシップホールディングス	5,700	504.00	2,872,800	
GMB	2,700	978.00	2,640,600	
ファルテック	2,600	670.00	1,742,000	
武蔵精密工業	32,300	1,585.00	51,195,500	
日産車体	28,300	871.00	24,649,300	
新明和工業	39,000	916.00	35,724,000	
極東開発工業	26,900	1,464.00	39,381,600	
トピー工業	12,000	1,304.00	15,648,000	
ティラド	5,300	1,330.00	7,049,000	
曙ブレーキ工業	79,500	128.00	10,176,000	
タチエス	23,800	1,097.00	26,108,600	
ＮＯＫ	77,900	1,216.00	94,726,400	
フタバ産業	40,400	509.00	20,563,600	
ＫＹＢ	16,200	2,356.00	38,167,200	
大同メタル工業	27,900	520.00	14,508,000	
プレス工業	72,000	308.00	22,176,000	
ミクニ	18,700	272.00	5,086,400	
太平洋工業	30,400	1,126.00	34,230,400	
河西工業	19,700	404.00	7,958,800	
アイシン精機	119,300	3,130.00	373,409,000	
マツダ	426,200	787.00	335,419,400	
今仙電機製作所	13,500	715.00	9,652,500	
本田技研工業	1,140,400	2,849.00	3,248,999,600	
スズキ	287,100	5,235.00	1,502,968,500	
ＳＵＢＡＲＵ	449,600	2,055.00	923,928,000	
安永	7,000	1,205.00	8,435,000	
ヤマハ発動機	204,700	2,165.00	443,175,500	
ＴＢＫ	17,400	445.00	7,743,000	
エクセディ	19,700	1,438.00	28,328,600	
豊田合成	46,800	2,861.00	133,894,800	
愛三工業	22,800	515.00	11,742,000	
盟和産業	2,300	879.00	2,021,700	
日本プラスト	11,500	492.00	5,658,000	
ヨロズ	13,600	1,200.00	16,320,000	
エフ・シー・シー	23,700	1,745.00	41,356,500	
シマノ	54,200	25,575.00	1,386,165,000	
テイ・エス　テック	33,700	3,015.00	101,605,500	
ジャムコ	7,200	662.00	4,766,400	
テルモ	409,900	4,053.00	1,661,324,700	
クリエートメディック	4,800	970.00	4,656,000	

日機装	46,800	1,048.00	49,046,400	
日本エム・ディ・エム	8,400	2,281.00	19,160,400	
島津製作所	173,100	4,095.00	708,844,500	
ＪＭＳ	12,300	942.00	11,586,600	
長野計器	10,500	977.00	10,258,500	
ブイ・テクノロジー	6,800	6,350.00	43,180,000	
東京計器	9,300	960.00	8,928,000	
愛知時計電機	1,900	4,300.00	8,170,000	
インターアクション	7,800	2,587.00	20,178,600	
オーバル	13,100	368.00	4,820,800	
東京精密	26,300	5,180.00	136,234,000	
マニー	57,700	2,797.00	161,386,900	
ニコン	221,200	807.00	178,508,400	
トプコン	73,000	1,350.00	98,550,000	
オリンパス	801,400	2,008.50	1,609,611,900	
理研計器	12,800	3,035.00	38,848,000	
タムロン	11,700	1,967.00	23,013,900	
ＨＯＹＡ	287,300	13,540.00	3,890,042,000	
シード	6,200	603.00	3,738,600	
ノーリツ鋼機	9,800	2,139.00	20,962,200	
エー・アンド・デイ	13,200	1,389.00	18,334,800	
朝日インテック	164,100	3,430.00	562,863,000	
シチズン時計	169,800	314.00	53,317,200	
リズム	4,600	687.00	3,160,200	
大研医器	10,100	562.00	5,676,200	
メニコン	20,500	6,750.00	138,375,000	
シンシア	1,600	659.00	1,054,400	
松風	6,500	1,790.00	11,635,000	
セイコーホールディングス	20,500	1,347.00	27,613,500	
ニプロ	100,300	1,224.00	122,767,200	
中本パックス	3,700	1,638.00	6,060,600	
スノーピーク	8,600	1,802.00	15,497,200	
パラマウントベッドホールディングス	15,300	4,725.00	72,292,500	
トランザクション	7,900	1,016.00	8,026,400	
粧美堂	4,200	397.00	1,667,400	
ニホンフラッシュ	13,500	1,335.00	18,022,500	
前田工繊	16,000	2,686.00	42,976,000	
永大産業	18,900	284.00	5,367,600	
アートネイチャー	15,500	646.00	10,013,000	
バンダイナムコホールディングス	149,700	9,344.00	1,398,796,800	
アイフィスジャパン	3,700	710.00	2,627,000	
共立印刷	24,200	117.00	2,831,400	

ＳＨＯＥＩ	12,700	4,060.00	51,562,000	
フランスベッドホールディングス	20,500	916.00	18,778,000	
パイロットコーポレーション	25,600	2,997.00	76,723,200	
萩原工業	8,000	1,478.00	11,824,000	
トッパン・フォームズ	31,000	1,050.00	32,550,000	
フジシールインターナショナル	32,500	1,913.00	62,172,500	
タカラトミー	64,900	901.00	58,474,900	
廣済堂	10,100	796.00	8,039,600	
エステールホールディングス	3,900	601.00	2,343,900	
タカノ	5,700	593.00	3,380,100	
プロネクサス	12,400	1,025.00	12,710,000	
ホクシン	8,900	112.00	996,800	
ウッドワン	4,900	1,072.00	5,252,800	
大建工業	9,700	1,673.00	16,228,100	
凸版印刷	204,400	1,494.00	305,373,600	
大日本印刷	189,500	1,848.00	350,196,000	
共同印刷	4,500	3,415.00	15,367,500	
ＮＩＳＳＨＡ	29,700	1,382.00	41,045,400	
光村印刷	1,300	1,747.00	2,271,100	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	7,000	1,726.00	12,082,000	
アシックス	128,100	1,794.00	229,811,400	
ツツミ	4,500	1,999.00	8,995,500	
小松ウオール工業	4,400	1,740.00	7,656,000	
ヤマハ	86,100	6,070.00	522,627,000	
河合楽器製作所	4,500	2,895.00	13,027,500	
クリナップ	13,500	468.00	6,318,000	
ピジョン	93,000	4,380.00	407,340,000	
オリバー	3,100	2,470.00	7,657,000	
兼松サステック	900	1,750.00	1,575,000	
キングジム	12,000	866.00	10,392,000	
リンテック	34,400	2,432.00	83,660,800	
イトーキ	28,700	333.00	9,557,100	
任天堂	88,800	64,720.00	5,747,136,000	
三菱鉛筆	23,800	1,315.00	31,297,000	
タカラスタンダード	29,900	1,516.00	45,328,400	
コクヨ	69,500	1,355.00	94,172,500	
ナカバヤシ	14,200	611.00	8,676,200	
グローブライド	6,500	4,415.00	28,697,500	
オカムラ	50,500	940.00	47,470,000	
美津濃	13,100	1,989.00	26,055,900	
東京電力ホールディングス	1,156,200	381.00	440,512,200	
中部電力	443,100	1,316.00	583,119,600	

関西電力	548,800	1,039.50	570,477,600	
中国電力	208,900	1,275.00	266,347,500	
北陸電力	132,400	715.00	94,666,000	
東北電力	361,800	905.00	327,429,000	
四国電力	130,400	733.00	95,583,200	
九州電力	298,500	994.00	296,709,000	
北海道電力	135,500	416.00	56,368,000	
沖縄電力	28,200	1,425.00	40,185,000	
電源開発	115,200	1,722.00	198,374,400	
エフオン	7,800	1,175.00	9,165,000	
イーレックス	21,500	1,712.00	36,808,000	
レノバ	24,300	4,310.00	104,733,000	
東京瓦斯	278,500	2,381.00	663,108,500	
大阪瓦斯	281,100	2,017.00	566,978,700	
東邦瓦斯	71,200	6,350.00	452,120,000	
北海道瓦斯	7,800	1,578.00	12,308,400	
広島ガス	29,800	376.00	11,204,800	
西部瓦斯	16,300	3,030.00	49,389,000	
静岡ガス	41,100	1,016.00	41,757,600	
メタウォーター	14,000	2,401.00	33,614,000	
ＳＢＳホールディングス	10,700	2,400.00	25,680,000	
東武鉄道	151,000	2,986.00	450,886,000	
相鉄ホールディングス	46,300	2,466.00	114,175,800	
東急	365,300	1,264.00	461,739,200	
京浜急行電鉄	186,000	1,723.00	320,478,000	
小田急電鉄	215,400	3,185.00	686,049,000	
京王電鉄	75,100	8,140.00	611,314,000	
京成電鉄	100,800	3,425.00	345,240,000	
富士急行	19,700	4,705.00	92,688,500	
新京成電鉄	3,700	2,220.00	8,214,000	
東日本旅客鉄道	254,900	6,778.00	1,727,712,200	
西日本旅客鉄道	129,100	5,396.00	696,623,600	
東海旅客鉄道	120,400	14,695.00	1,769,278,000	
西武ホールディングス	189,100	976.00	184,561,600	
鴻池運輸	23,000	1,014.00	23,322,000	
西日本鉄道	40,100	2,987.00	119,778,700	
ハマキョウレックス	11,100	2,948.00	32,722,800	
サカイ引越センター	7,600	5,120.00	38,912,000	
近鉄グループホールディングス	137,200	4,510.00	618,772,000	
阪急阪神ホールディングス	183,000	3,380.00	618,540,000	
南海電気鉄道	65,000	2,564.00	166,660,000	
京阪ホールディングス	61,100	4,965.00	303,361,500	

神戸電鉄	3,300	3,590.00	11,847,000	
名古屋鉄道	112,800	2,720.00	306,816,000	
山陽電気鉄道	9,800	1,982.00	19,423,600	
日本通運	47,500	7,060.00	335,350,000	
ヤマトホールディングス	227,200	2,550.00	579,360,000	
山九	38,100	3,930.00	149,733,000	
丸運	7,800	252.00	1,965,600	
丸全昭和運輸	11,100	3,465.00	38,461,500	
センコーグループホールディングス	75,600	972.00	73,483,200	
トナミホールディングス	3,300	5,620.00	18,546,000	
ニッコンホールディングス	49,100	2,105.00	103,355,500	
日本石油輸送	1,500	2,631.00	3,946,500	
福山通運	17,600	4,065.00	71,544,000	
セイノーホールディングス	102,700	1,407.00	144,498,900	
エスライン	4,100	885.00	3,628,500	
神奈川中央交通	3,400	3,860.00	13,124,000	
日立物流	25,100	3,060.00	76,806,000	
丸和運輸機関	28,900	2,188.00	63,233,200	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	13,900	2,044.00	28,411,600	
九州旅客鉄道	120,200	2,162.00	259,872,400	
ＳＧホールディングス	288,000	2,811.00	809,568,000	
日本郵船	115,100	2,542.00	292,584,200	
商船三井	87,200	2,961.00	258,199,200	
川崎汽船	42,200	2,016.00	85,075,200	
ＮＳユナイテッド海運	8,300	1,480.00	12,284,000	
飯野海運	66,200	433.00	28,664,600	
共栄タンカー	3,600	908.00	3,268,800	
乾汽船	7,900	913.00	7,212,700	
日本航空	308,000	1,888.00	581,504,000	
ＡＮＡホールディングス	341,600	2,232.50	762,622,000	
パスコ	2,700	1,382.00	3,731,400	
トランコム	3,800	8,460.00	32,148,000	
日新	11,900	1,248.00	14,851,200	
三菱倉庫	43,500	3,100.00	134,850,000	
三井倉庫ホールディングス	15,700	2,252.00	35,356,400	
住友倉庫	49,300	1,277.00	62,956,100	
澁澤倉庫	7,500	2,089.00	15,667,500	
東陽倉庫	24,800	313.00	7,762,400	
日本トランスシティ	30,200	521.00	15,734,200	
ケイヒン	2,600	1,302.00	3,385,200	
中央倉庫	8,400	1,130.00	9,492,000	
川西倉庫	2,500	1,133.00	2,832,500	

安田倉庫	11,300	965.00	10,904,500	
ファイズホールディングス	2,900	1,151.00	3,337,900	
東洋埠頭	4,200	1,409.00	5,917,800	
宇徳	11,700	454.00	5,311,800	
上組	76,500	1,865.00	142,672,500	
サンリツ	3,200	701.00	2,243,200	
キムラユニティー	3,700	1,103.00	4,081,100	
キユーソー流通システム	3,400	1,571.00	5,341,400	
近鉄エクスプレス	29,100	2,602.00	75,718,200	
東海運	7,800	313.00	2,441,400	
エーアイテイー	9,700	1,010.00	9,797,000	
内外トランスライン	4,800	1,184.00	5,683,200	
日本コンセプト	4,400	1,462.00	6,432,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	40,400	1,900.00	76,760,000	
クロスキャット	3,900	1,197.00	4,668,300	
システナ	50,800	2,068.00	105,054,400	
デジタルアーツ	7,000	10,020.00	70,140,000	
日鉄ソリューションズ	21,400	3,110.00	66,554,000	
キューブシステム	7,700	1,233.00	9,494,100	
エイジア	2,700	1,851.00	4,997,700	
コア	6,100	1,463.00	8,924,300	
ラクーンホールディングス	7,200	1,724.00	12,412,800	
ソリトンシステムズ	7,200	1,776.00	12,787,200	
ソフトクリエイトホールディングス	6,300	2,688.00	16,934,400	
ＴＩＳ	142,200	2,151.00	305,872,200	
ＪＮＳホールディングス	5,700	540.00	3,078,000	
電算システム	5,400	3,165.00	17,091,000	
グリー	87,500	587.00	51,362,500	
コーエーテクモホールディングス	29,100	5,890.00	171,399,000	
三菱総合研究所	6,100	4,200.00	25,620,000	
電算	1,700	2,475.00	4,207,500	
ＡＧＳ	8,300	830.00	6,889,000	
ファインデックス	12,100	1,099.00	13,297,900	
ブレインパッド	3,700	4,065.00	15,040,500	
ＫＬａｂ	25,900	887.00	22,973,300	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,300	1,195.00	20,673,500	
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	2,697.00	5,663,700	
ネクソン	358,900	3,145.00	1,128,740,500	
アイスタイル	40,300	399.00	16,079,700	
エムアップホールディングス	4,200	2,515.00	10,563,000	
エイチーム	10,000	1,127.00	11,270,000	
エニグモ	13,600	1,243.00	16,904,800	

テクノスジャパン	11,300	676.00	7,638,800	
コロプラ	46,800	924.00	43,243,200	
ブロードリーフ	70,800	622.00	44,037,600	
クロス・マーケティンググループ	6,800	361.00	2,454,800	
デジタルハーツホールディングス	7,700	1,363.00	10,495,100	
システム情報	10,800	1,202.00	12,981,600	
メディアドゥ	4,700	7,100.00	33,370,000	
じげん	35,700	397.00	14,172,900	
ブイキューブ	7,800	3,385.00	26,403,000	
エンカレッジ・テクノロジ	3,400	693.00	2,356,200	
サイバーリンクス	4,700	2,185.00	10,269,500	
フィックスターズ	15,300	980.00	14,994,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,900	1,267.00	7,475,300	
オプティム	7,500	3,210.00	24,075,000	
セレス	4,800	2,587.00	12,417,600	
ＳＨＩＦＴ	6,400	12,070.00	77,248,000	
ティーガイア	12,700	1,867.00	23,710,900	
セック	2,100	2,804.00	5,888,400	
日本アジアグループ	15,000	861.00	12,915,000	
テクマトリックス	20,100	1,904.00	38,270,400	
プロシップ	4,300	1,441.00	6,196,300	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,300	2,558.00	87,739,400	
GMOペイメントゲートウェイ	30,100	15,240.00	458,724,000	
ザッパラス	6,500	495.00	3,217,500	
システムリサーチ	3,900	1,777.00	6,930,300	
インターネットイニシアティブ	42,100	2,159.00	90,893,900	
さくらインターネット	15,500	707.00	10,958,500	
ヴィンクス	4,100	1,176.00	4,821,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,200	8,900.00	28,480,000	
ＳＲＡホールディングス	7,600	2,532.00	19,243,200	
システムインテグレータ	4,800	616.00	2,956,800	
朝日ネット	10,300	868.00	8,940,400	
ｅＢＡＳＥ	17,200	1,033.00	17,767,600	
アバント	13,700	1,142.00	15,645,400	
アドソル日進	5,100	3,095.00	15,784,500	
フリービット	7,600	955.00	7,258,000	
コムチュア	16,000	2,823.00	45,168,000	
サイバーコム	2,600	1,676.00	4,357,600	
アステリア	8,800	1,034.00	9,099,200	
アイル	8,000	1,423.00	11,384,000	
マークラインズ	6,000	2,432.00	14,592,000	
メディカル・データ・ビジョン	16,300	3,040.00	49,552,000	

ｇｕｍｉ	18,500	868.00	16,058,000	
ショーケース	3,300	1,014.00	3,346,200	
モバイルファクトリー	3,400	1,111.00	3,777,400	
テラスカイ	5,200	3,815.00	19,838,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,700	1,518.00	8,652,600	
ＰＣＩホールディングス	5,500	1,505.00	8,277,500	
パイプドＨＤ	1,900	1,602.00	3,043,800	
アイビーシー	2,500	1,090.00	2,725,000	
ネオジャパン	2,800	1,873.00	5,244,400	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,500	4,225.00	10,562,500	
ランドコンピュータ	2,300	1,112.00	2,557,600	
ダブルスタンダード	1,900	4,415.00	8,388,500	
オープンドア	7,200	1,521.00	10,951,200	
マイネット	4,600	897.00	4,126,200	
アカツキ	5,100	4,630.00	23,613,000	
ベネフィットジャパン	1,200	1,800.00	2,160,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,200	3,700.00	11,840,000	
カナミックネットワーク	13,300	699.00	9,296,700	
ノムラシステムコーポレーション	6,800	370.00	2,516,000	
チェンジ	19,900	3,480.00	69,252,000	
シンクロ・フード	6,600	338.00	2,230,800	
オークネット	7,700	1,330.00	10,241,000	
セグエグループ	3,800	1,338.00	5,084,400	
エイトレッド	2,400	2,644.00	6,345,600	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	14,800	441.00	6,526,800	
マクロミル	29,300	660.00	19,338,000	
ビーグリー	2,900	1,730.00	5,017,000	
オロ	4,500	4,160.00	18,720,000	
ユーザーローカル	1,500	4,120.00	6,180,000	
テモナ	3,200	1,005.00	3,216,000	
ニーズウェル	3,000	665.00	1,995,000	
サインポスト	3,400	958.00	3,257,200	
ソルクシーズ	5,600	993.00	5,560,800	
フェイス	5,200	826.00	4,295,200	
プロトコーポレーション	12,900	1,017.00	13,119,300	
ハイマックス	3,500	1,172.00	4,102,000	
野村総合研究所	201,500	3,845.00	774,767,500	
サイバネットシステム	10,300	983.00	10,124,900	
ＣＥホールディングス	7,800	612.00	4,773,600	
日本システム技術	2,400	1,557.00	3,736,800	
インテージホールディングス	17,900	1,146.00	20,513,400	
東邦システムサイエンス	4,000	931.00	3,724,000	

ソースネクスト	68,100	287.00	19,544,700	
インフォコム	15,600	3,290.00	51,324,000	
ＨＥＲＯＺ	2,100	2,686.00	5,640,600	
ラクスル	11,500	4,260.00	48,990,000	
ＦＩＧ	16,100	267.00	4,298,700	
システムサポート	3,400	1,548.00	5,263,200	
イーソル	7,900	1,200.00	9,480,000	
アルテリア・ネットワークス	15,900	1,602.00	25,471,800	
ＥｄｕＬａｂ	1,300	6,520.00	8,476,000	
東海ソフト	1,100	1,195.00	1,314,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,980.00	4,950,000	
東名	900	1,168.00	1,051,200	
ヴィッツ	600	2,110.00	1,266,000	
トビラシステムズ	1,500	1,325.00	1,987,500	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,100	1,236.00	1,359,600	
フォーカスシステムズ	9,000	959.00	8,631,000	
クレスコ	8,800	1,309.00	11,519,200	
フジ・メディア・ホールディングス	137,100	1,181.00	161,915,100	
オービック	49,300	20,690.00	1,020,017,000	
ジャストシステム	23,100	7,390.00	170,709,000	
ＴＤＣソフト	12,600	982.00	12,373,200	
Ｚホールディングス	1,952,100	682.30	1,331,917,830	
トレンドマイクロ	75,900	5,630.00	427,317,000	
ＩＤホールディングス	5,600	1,217.00	6,815,200	
日本オラクル	28,800	12,980.00	373,824,000	
アルファシステムズ	4,500	3,615.00	16,267,500	
フューチャー	17,300	1,747.00	30,223,100	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,400	1,377.00	12,943,800	
ＳＢテクノロジー	5,200	3,330.00	17,316,000	
トーセ	4,100	800.00	3,280,000	
オービックビジネスコンサルタント	14,500	6,840.00	99,180,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	64,800	3,640.00	235,872,000	
アイティフォー	17,400	930.00	16,182,000	
東計電算	2,200	3,970.00	8,734,000	
エックスネット	2,400	965.00	2,316,000	
大塚商会	76,900	4,995.00	384,115,500	
サイボウズ	16,700	2,799.00	46,743,300	
電通国際情報サービス	17,600	3,390.00	59,664,000	
ＡＣＣＥＳＳ	13,500	760.00	10,260,000	
デジタルガレージ	25,600	3,930.00	100,608,000	
ＥＭシステムズ	20,300	959.00	19,467,700	
ウェザーニューズ	4,800	4,965.00	23,832,000	

ＣＩＪ	9,900	873.00	8,642,700	
ビジネスエンジニアリング	1,700	3,170.00	5,389,000	
日本エンタープライズ	15,400	216.00	3,326,400	
WOWOW	6,900	2,848.00	19,651,200	
スカラ	9,700	806.00	7,818,200	
インテリジェント　ウェイブ	8,600	707.00	6,080,200	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	12,600	360.00	4,536,000	
ネットワンシステムズ	54,200	3,580.00	194,036,000	
システムソフト	32,700	93.00	3,041,100	
アルゴグラフィックス	12,100	3,050.00	36,905,000	
マーベラス	21,900	952.00	20,848,800	
エイベックス	24,600	1,278.00	31,438,800	
日本ユニシス	44,400	3,930.00	174,492,000	
兼松エレクトロニクス	7,800	4,035.00	31,473,000	
都築電気	4,600	1,671.00	7,686,600	
ＴＢＳホールディングス	86,500	1,945.00	168,242,500	
日本テレビホールディングス	118,800	1,141.00	135,550,800	
朝日放送グループホールディングス	14,400	699.00	10,065,600	
テレビ朝日ホールディングス	39,100	1,883.00	73,625,300	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	93,900	479.00	44,978,100	
テレビ東京ホールディングス	11,700	2,368.00	27,705,600	
日本ＢＳ放送	5,000	1,158.00	5,790,000	
ビジョン	17,800	975.00	17,355,000	
スマートバリュー	3,900	901.00	3,513,900	
ワイヤレスゲート	6,100	670.00	4,087,000	
コネクシオ	8,200	1,405.00	11,521,000	
クロップス	2,800	743.00	2,080,400	
日本電信電話	1,899,900	2,712.00	5,152,528,800	
ＫＤＤＩ	1,036,200	3,183.00	3,298,224,600	
ソフトバンク	1,291,700	1,355.00	1,750,253,500	
光通信	14,700	21,010.00	308,847,000	
エムティーアイ	14,000	809.00	11,326,000	
GMOインターネット	51,000	3,130.00	159,630,000	
ファイバーゲート	4,700	2,245.00	10,551,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,700	427.00	2,006,900	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	38,300	3,370.00	129,071,000	
学研ホールディングス	19,200	1,664.00	31,948,800	
ゼンリン	28,500	1,180.00	33,630,000	
昭文社ホールディングス	7,000	451.00	3,157,000	
インプレスホールディングス	11,800	180.00	2,124,000	
アイネット	7,400	1,566.00	11,588,400	
松竹	9,400	14,430.00	135,642,000	

東宝	83,900	3,890.00	326,371,000	
東映	5,300	17,480.00	92,644,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	378,500	1,492.00	564,722,000	
ピー・シー・エー	2,500	4,445.00	11,112,500	
ビジネスブレイン太田昭和	5,000	1,623.00	8,115,000	
ＤＴＳ	31,900	2,073.00	66,128,700	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,600	6,050.00	366,630,000	
シーイーシー	15,400	1,459.00	22,468,600	
カプコン	67,000	6,930.00	464,310,000	
アイ・エス・ビー	6,700	1,359.00	9,105,300	
ジャステック	9,200	1,250.00	11,500,000	
ＳＣＳＫ	32,800	5,510.00	180,728,000	
日本システムウエア	4,800	2,149.00	10,315,200	
アイネス	14,100	1,406.00	19,824,600	
ＴＫＣ	12,000	7,210.00	86,520,000	
富士ソフト	15,200	5,140.00	78,128,000	
ＮＳＤ	45,800	2,019.00	92,470,200	
コナミホールディングス	51,700	6,700.00	346,390,000	
福井コンピュータホールディングス	5,600	3,850.00	21,560,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,700	1,458.00	14,142,600	
ミロク情報サービス	12,600	2,064.00	26,006,400	
ソフトバンクグループ	1,127,700	8,694.00	9,804,223,800	
ホウスイ	1,200	995.00	1,194,000	
高千穂交易	5,500	1,210.00	6,655,000	
オルバヘルスケアホールディングス	1,700	1,485.00	2,524,500	
伊藤忠食品	3,500	5,400.00	18,900,000	
エレマテック	13,400	1,009.00	13,520,600	
ＪＡＬＵＸ	4,100	1,394.00	5,715,400	
あらた	11,400	4,670.00	53,238,000	
トーメンデバイス	2,200	3,470.00	7,634,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,200	3,455.00	17,966,000	
フィールズ	10,900	505.00	5,504,500	
双日	787,900	247.00	194,611,300	
アルフレッサ　ホールディングス	158,500	2,021.00	320,328,500	
横浜冷凍	37,400	878.00	32,837,200	
ラサ商事	7,600	902.00	6,855,200	
アルコニックス	15,200	1,681.00	25,551,200	
神戸物産	98,400	2,851.00	280,538,400	
ハイパー	2,200	536.00	1,179,200	
あい　ホールディングス	20,400	2,024.00	41,289,600	
ディーブイエックス	5,100	1,025.00	5,227,500	
ダイワボウホールディングス	12,100	9,150.00	110,715,000	

マクニカ・富士エレホールディングス	34,000	2,124.00	72,216,000	
ラクト・ジャパン	6,200	2,676.00	16,591,200	
グリムス	3,200	1,537.00	4,918,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,900	798.00	21,466,200	
八洲電機	11,100	963.00	10,689,300	
メディアスホールディングス	8,100	785.00	6,358,500	
レスターホールディングス	14,900	2,196.00	32,720,400	
ジューテックホールディングス	3,300	1,012.00	3,339,600	
大光	6,100	666.00	4,062,600	
ＯＣＨＩホールディングス	4,200	1,328.00	5,577,600	
ＴＯＫＡＩホールディングス	75,400	993.00	74,872,200	
黒谷	3,900	770.00	3,003,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,500	757.00	1,892,500	
三洋貿易	14,400	993.00	14,299,200	
ビューティガレージ	2,300	2,410.00	5,543,000	
ウイン・パートナーズ	10,300	1,136.00	11,700,800	
ミタチ産業	4,300	592.00	2,545,600	
シップヘルスケアホールディングス	22,900	5,900.00	135,110,000	
明治電機工業	4,500	1,590.00	7,155,000	
デリカフーズホールディングス	5,100	631.00	3,218,100	
スターティアホールディングス	3,300	1,038.00	3,425,400	
コメダホールディングス	31,100	1,890.00	58,779,000	
ピーバンドットコム	1,500	1,148.00	1,722,000	
アセンテック	3,100	1,836.00	5,691,600	
富士興産	4,400	1,024.00	4,505,600	
協栄産業	1,600	1,375.00	2,200,000	
小野建	12,800	1,252.00	16,025,600	
南陽	3,100	1,634.00	5,065,400	
佐鳥電機	9,700	760.00	7,372,000	
エコートレーディング	3,300	668.00	2,204,400	
伯東	8,700	1,170.00	10,179,000	
コンドーテック	11,100	1,066.00	11,832,600	
中山福	8,300	559.00	4,639,700	
ナガイレーベン	18,900	3,025.00	57,172,500	
三菱食品	15,700	2,849.00	44,729,300	
松田産業	10,400	1,856.00	19,302,400	
第一興商	21,200	3,510.00	74,412,000	
メディパルホールディングス	154,000	2,055.00	316,470,000	
ＳＰＫ	6,100	1,255.00	7,655,500	
萩原電気ホールディングス	5,300	2,611.00	13,838,300	
アズワン	9,300	15,980.00	148,614,000	
スズデン	5,000	1,235.00	6,175,000	

尾家産業	4,200	1,281.00	5,380,200	
シモジマ	8,800	1,379.00	12,135,200	
ドウシシャ	13,500	1,921.00	25,933,500	
小津産業	3,200	1,910.00	6,112,000	
高速	8,500	1,553.00	13,200,500	
たけびし	5,000	1,571.00	7,855,000	
リックス	3,200	1,511.00	4,835,200	
丸文	12,700	555.00	7,048,500	
ハピネット	11,900	1,641.00	19,527,900	
橋本総業ホールディングス	2,900	2,530.00	7,337,000	
日本ライフライン	42,300	1,524.00	64,465,200	
タカショー	9,300	780.00	7,254,000	
マルカ	4,600	1,920.00	8,832,000	
ＩＤＯＭ	38,500	599.00	23,061,500	
進和	8,400	2,115.00	17,766,000	
エスケイジャパン	3,200	442.00	1,414,400	
ダイトロン	6,000	1,663.00	9,978,000	
シークス	18,200	1,572.00	28,610,400	
田中商事	4,400	694.00	3,053,600	
オーハシテクニカ	7,300	1,435.00	10,475,500	
白銅	5,100	1,451.00	7,400,100	
ダイコー通産	900	1,591.00	1,431,900	
伊藤忠商事	997,800	3,113.00	3,106,151,400	
丸紅	1,484,900	724.90	1,076,404,010	
高島	2,300	1,655.00	3,806,500	
長瀬産業	80,200	1,557.00	124,871,400	
蝶理	9,100	1,551.00	14,114,100	
豊田通商	159,200	4,385.00	698,092,000	
三共生興	21,700	464.00	10,068,800	
兼松	53,200	1,317.00	70,064,400	
ツカモトコーポレーション	2,600	1,537.00	3,996,200	
三井物産	1,235,100	2,028.50	2,505,400,350	
日本紙パルプ商事	8,100	3,520.00	28,512,000	
カメイ	18,600	1,200.00	22,320,000	
東都水産	1,800	3,555.00	6,399,000	
ＯＵＧホールディングス	2,300	2,794.00	6,426,200	
スターゼン	5,300	4,255.00	22,551,500	
山善	55,800	1,011.00	56,413,800	
椿本興業	2,600	3,600.00	9,360,000	
住友商事	900,000	1,404.00	1,263,600,000	
内田洋行	5,600	4,150.00	23,240,000	
三菱商事	935,300	2,678.00	2,504,733,400	

第一実業	7,000	4,090.00	28,630,000	
キヤノンマーケティングジャパン	35,400	2,291.00	81,101,400	
西華産業	8,100	1,362.00	11,032,200	
佐藤商事	11,800	904.00	10,667,200	
菱洋エレクトロ	14,500	3,400.00	49,300,000	
東京産業	13,000	611.00	7,943,000	
ユアサ商事	13,500	3,225.00	43,537,500	
神鋼商事	3,600	1,836.00	6,609,600	
トルク	8,700	245.00	2,131,500	
阪和興業	26,700	2,763.00	73,772,100	
正栄食品工業	9,200	3,705.00	34,086,000	
カナデン	11,600	1,290.00	14,964,000	
菱電商事	10,300	1,575.00	16,222,500	
フルサト工業	7,900	1,296.00	10,238,400	
岩谷産業	36,900	6,980.00	257,562,000	
ナイス	6,100	1,508.00	9,198,800	
昭光通商	4,600	626.00	2,879,600	
ニチモウ	2,200	1,883.00	4,142,600	
極東貿易	4,100	1,420.00	5,822,000	
イワキ	18,800	666.00	12,520,800	
三愛石油	35,200	1,120.00	39,424,000	
稲畑産業	31,400	1,479.00	46,440,600	
ＧＳＩクレオス	3,500	1,879.00	6,576,500	
明和産業	13,200	448.00	5,913,600	
クワザワホールディングス	5,100	621.00	3,167,100	
ヤマエ久野	10,400	1,097.00	11,408,800	
ワキタ	30,500	994.00	30,317,000	
東邦ホールディングス	45,800	2,016.00	92,332,800	
サンゲツ	38,500	1,549.00	59,636,500	
ミツウロコグループホールディングス	21,100	1,378.00	29,075,800	
シナネンホールディングス	5,900	2,951.00	17,410,900	
伊藤忠エネクス	31,600	1,012.00	31,979,200	
サンリオ	40,100	1,549.00	62,114,900	
サンワテクノス	10,100	1,041.00	10,514,100	
リョーサン	15,800	1,994.00	31,505,200	
新光商事	21,400	753.00	16,114,200	
トーホー	6,500	1,864.00	12,116,000	
三信電気	7,700	1,887.00	14,529,900	
東陽テクニカ	15,300	1,204.00	18,421,200	
モスフードサービス	18,700	3,135.00	58,624,500	
加賀電子	14,200	2,375.00	33,725,000	
ソーダニッカ	14,800	525.00	7,770,000	

立花エレテック	10,600	1,611.00	17,076,600	
フォーバル	6,300	782.00	4,926,600	
ＰＡＬＴＡＣ	22,900	5,620.00	128,698,000	
三谷産業	18,800	439.00	8,253,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,200	2,419.00	7,740,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,508.00	1,960,400	
コーア商事ホールディングス	2,700	1,349.00	3,642,300	
国際紙パルプ商事	33,900	239.00	8,102,100	
ヤマタネ	7,200	1,352.00	9,734,400	
丸紅建材リース	1,400	1,701.00	2,381,400	
日鉄物産	10,200	3,730.00	38,046,000	
泉州電業	4,000	3,330.00	13,320,000	
トラスコ中山	32,700	2,685.00	87,799,500	
オートバックスセブン	52,900	1,407.00	74,430,300	
モリト	10,500	610.00	6,405,000	
加藤産業	20,600	3,500.00	72,100,000	
北恵	3,700	892.00	3,300,400	
イノテック	7,400	1,154.00	8,539,600	
イエローハット	27,000	1,677.00	45,279,000	
ＪＫホールディングス	12,900	777.00	10,023,300	
日伝	12,900	2,215.00	28,573,500	
北沢産業	10,900	269.00	2,932,100	
杉本商事	7,700	2,377.00	18,302,900	
因幡電機産業	40,600	2,496.00	101,337,600	
東テク	4,700	2,731.00	12,835,700	
ミスミグループ本社	178,800	3,050.00	545,340,000	
アルテック	10,600	283.00	2,999,800	
タキヒヨー	4,300	1,906.00	8,195,800	
蔵王産業	2,800	1,370.00	3,836,000	
スズケン	60,400	4,040.00	244,016,000	
ジェコス	9,900	957.00	9,474,300	
グローセル	14,400	461.00	6,638,400	
ローソン	36,100	4,935.00	178,153,500	
サンエー	11,900	4,140.00	49,266,000	
カワチ薬品	11,200	3,010.00	33,712,000	
エービーシー・マート	22,300	5,700.00	127,110,000	
ハードオフコーポレーション	6,000	768.00	4,608,000	
アスクル	15,000	3,755.00	56,325,000	
ゲオホールディングス	25,900	1,197.00	31,002,300	
アダストリア	19,900	1,951.00	38,824,900	
くら寿司	8,400	6,240.00	52,416,000	
キャンドゥ	6,900	1,885.00	13,006,500	

パルグループホールディングス	14,800	1,447.00	21,415,600	
エディオン	65,800	1,010.00	66,458,000	
サーラコーポレーション	29,500	580.00	17,110,000	
ワッツ	6,600	906.00	5,979,600	
ハローズ	5,400	3,345.00	18,063,000	
フジオフードグループ本社	12,000	1,214.00	14,568,000	
あみやき亭	3,200	2,852.00	9,126,400	
大黒天物産	3,500	5,950.00	20,825,000	
ハニーズホールディングス	12,800	1,010.00	12,928,000	
ファーマライズホールディングス	3,800	772.00	2,933,600	
アルペン	11,100	2,288.00	25,396,800	
ハブ	4,500	610.00	2,745,000	
クオールホールディングス	21,200	1,158.00	24,549,600	
ジンズホールディングス	7,600	6,610.00	50,236,000	
ビックカメラ	84,900	1,119.00	95,003,100	
ＤＣＭホールディングス	87,600	1,088.00	95,308,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	101,500	5,190.00	526,785,000	
東京一番フーズ	4,100	575.00	2,357,500	
きちりホールディングス	4,300	591.00	2,541,300	
アークランドサービスホールディングス	12,000	2,080.00	24,960,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	170,700	875.00	149,362,500	
ドトール・日レスホールディングス	20,700	1,604.00	33,202,800	
マツモトキヨシホールディングス	59,000	4,130.00	243,670,000	
ブロンコビリー	7,600	2,231.00	16,955,600	
ＺＯＺＯ	98,200	2,739.00	268,969,800	
トレジャー・ファクトリー	4,600	730.00	3,358,000	
物語コーポレーション	3,800	11,170.00	42,446,000	
ココカラファイン	14,900	7,000.00	104,300,000	
三越伊勢丹ホールディングス	250,000	629.00	157,250,000	
Ｈａｍｅｅ	5,300	1,721.00	9,121,300	
ウエルシアホールディングス	84,900	3,500.00	297,150,000	
クリエイトＳＤホールディングス	24,100	3,440.00	82,904,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	16,600	371.00	6,158,600	
ティーライフ	2,300	1,156.00	2,658,800	
チムニー	4,600	1,202.00	5,529,200	
シュッピン	10,000	911.00	9,110,000	
オイシックス・ラ・大地	14,200	3,180.00	45,156,000	
ネクステージ	24,600	1,339.00	32,939,400	
ジョイフル本田	42,000	1,420.00	59,640,000	
鳥貴族	4,400	1,514.00	6,661,600	
ホットランド	10,900	1,232.00	13,428,800	
すかいらーくホールディングス	160,000	1,633.00	261,280,000	

ＳＦＰホールディングス	8,300	1,339.00	11,113,700	
綿半ホールディングス	10,900	1,381.00	15,052,900	
ヨシックス	2,500	1,912.00	4,780,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,700	1,097.00	45,744,900	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,700	821.00	6,321,700	
ＢＥＥＮＯＳ	6,700	2,478.00	16,602,600	
あさひ	10,800	1,640.00	17,712,000	
日本調剤	8,800	1,507.00	13,261,600	
コスモス薬品	12,600	15,880.00	200,088,000	
トーエル	7,200	816.00	5,875,200	
オンリー	3,000	445.00	1,335,000	
セブン&アイ・ホールディングス	558,100	3,930.00	2,193,333,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	76,700	723.00	55,454,100	
ツルハホールディングス	31,100	14,140.00	439,754,000	
サンマルクホールディングス	11,500	1,491.00	17,146,500	
フェリシモ	3,400	1,334.00	4,535,600	
トリドールホールディングス	35,500	1,476.00	52,398,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13,500	463.00	6,250,500	
ウイルプラスホールディングス	2,200	773.00	1,700,600	
ＪＭホールディングス	10,900	2,086.00	22,737,400	
サツドラホールディングス	2,300	2,021.00	4,648,300	
アレンザホールディングス	7,400	1,239.00	9,168,600	
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,580.00	6,320,000	
バロックジャパンリミテッド	10,300	763.00	7,858,900	
クスリのアオキホールディングス	12,800	8,660.00	110,848,000	
力の源ホールディングス	6,500	587.00	3,815,500	
スシローグローバルホールディングス	78,400	3,860.00	302,624,000	
メディカルシステムネットワーク	14,200	611.00	8,676,200	
はるやまホールディングス	7,100	681.00	4,835,100	
ノジマ	25,500	2,820.00	71,910,000	
カッパ・クリエイト	20,000	1,520.00	30,400,000	
ライトオン	10,700	606.00	6,484,200	
良品計画	189,500	2,360.00	447,220,000	
三城ホールディングス	16,100	311.00	5,007,100	
アドヴァン	22,000	1,129.00	24,838,000	
アルビス	5,500	2,413.00	13,271,500	
コナカ	16,800	311.00	5,224,800	
ハウス　オブ　ローゼ	1,900	1,670.00	3,173,000	
Ｇ－７ホールディングス	8,500	2,442.00	20,757,000	
イオン北海道	19,000	980.00	18,620,000	
コジマ	25,000	638.00	15,950,000	

ヒマラヤ	5,300	930.00	4,929,000	
コーナン商事	20,400	2,869.00	58,527,600	
エコス	5,400	1,892.00	10,216,800	
ワタミ	17,200	944.00	16,236,800	
マルシェ	4,300	493.00	2,119,900	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	313,700	2,277.00	714,294,900	
西松屋チェーン	31,500	1,498.00	47,187,000	
ゼンショーホールディングス	68,400	2,846.00	194,666,400	
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,671.00	15,206,100	
ハークスレイ	3,300	883.00	2,913,900	
サイゼリヤ	21,300	2,110.00	44,943,000	
ＶＴホールディングス	59,700	432.00	25,790,400	
魚力	4,100	1,851.00	7,589,100	
フジ・コーポレーション	3,900	2,147.00	8,373,300	
ユナイテッドアローズ	15,100	1,548.00	23,374,800	
ハイデイ日高	20,800	1,749.00	36,379,200	
京都きもの友禅	10,400	207.00	2,152,800	
コロワイド	47,400	1,760.00	83,424,000	
ピーシーデポコーポレーション	19,400	563.00	10,922,200	
壱番屋	10,100	5,190.00	52,419,000	
ＰＬＡＮＴ	4,000	733.00	2,932,000	
スギホールディングス	28,500	7,000.00	199,500,000	
薬王堂ホールディングス	6,300	2,591.00	16,323,300	
スクロール	22,200	858.00	19,047,600	
ヨンドシーホールディングス	14,700	1,955.00	28,738,500	
木曽路	18,800	2,481.00	46,642,800	
ＳＲＳホールディングス	17,200	837.00	14,396,400	
リテールパートナーズ	19,100	1,308.00	24,982,800	
ケーヨー	29,500	753.00	22,213,500	
上新電機	16,900	2,718.00	45,934,200	
日本瓦斯	21,700	5,170.00	112,189,000	
ロイヤルホールディングス	24,900	1,797.00	44,745,300	
いなげや	17,800	1,768.00	31,470,400	
島忠	26,900	5,490.00	147,681,000	
チヨダ	15,300	895.00	13,693,500	
ライフコーポレーション	10,900	3,265.00	35,588,500	
リンガーハット	17,600	2,372.00	41,747,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	20,000	727.00	14,540,000	
ＡＯＫＩホールディングス	29,100	541.00	15,743,100	
オークワ	22,500	1,268.00	28,530,000	
コメリ	22,100	2,866.00	63,338,600	
青山商事	29,900	630.00	18,837,000	

しまむら	16,600	11,780.00	195,548,000	
はせがわ	8,500	291.00	2,473,500	
高島屋	104,100	942.00	98,062,200	
松屋	29,000	820.00	23,780,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	67,800	718.00	48,680,400	
近鉄百貨店	5,600	3,090.00	17,304,000	
丸井グループ	130,800	1,791.00	234,262,800	
アクシアル　リテイリング	11,900	4,995.00	59,440,500	
イオン	549,000	3,265.00	1,792,485,000	
イズミ	29,000	3,615.00	104,835,000	
平和堂	29,000	2,136.00	61,944,000	
フジ	17,300	2,002.00	34,634,600	
ヤオコー	16,200	6,650.00	107,730,000	
ゼビオホールディングス	17,600	865.00	15,224,000	
ケーズホールディングス	137,900	1,378.00	190,026,200	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,700	885.00	6,814,500	
日産東京販売ホールディングス	22,100	259.00	5,723,900	
シルバーライフ	2,100	2,034.00	4,271,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,300	4,005.00	25,231,500	
ナルミヤ・インターナショナル	3,500	992.00	3,472,000	
ブックオフグループホールディングス	8,300	834.00	6,922,200	
ギフト	1,500	1,913.00	2,869,500	
アインホールディングス	17,600	6,490.00	114,224,000	
元気寿司	3,700	2,347.00	8,683,900	
ヤマダホールディングス	435,200	535.00	232,832,000	
アークランドサカモト	22,500	1,572.00	35,370,000	
ニトリホールディングス	61,800	21,680.00	1,339,824,000	
グルメ杵屋	10,500	972.00	10,206,000	
愛眼	11,400	226.00	2,576,400	
ケーユーホールディングス	7,800	805.00	6,279,000	
吉野家ホールディングス	47,000	2,129.00	100,063,000	
松屋フーズホールディングス	6,900	3,485.00	24,046,500	
サガミホールディングス	19,300	1,198.00	23,121,400	
関西スーパーマーケット	12,100	1,151.00	13,927,100	
王将フードサービス	10,500	5,750.00	60,375,000	
プレナス	16,100	1,934.00	31,137,400	
ミニストップ	10,700	1,402.00	15,001,400	
アークス	29,300	2,300.00	67,390,000	
バローホールディングス	31,700	2,461.00	78,013,700	
ベルク	7,100	5,780.00	41,038,000	
大庄	7,900	987.00	7,797,300	
ファーストリテイリング	19,100	91,110.00	1,740,201,000	

サンドラッグ	53,700	4,040.00	216,948,000	
サックスバー　ホールディングス	12,600	564.00	7,106,400	
ヤマザワ	3,500	1,715.00	6,002,500	
やまや	2,900	2,184.00	6,333,600	
ベルーナ	30,900	1,135.00	35,071,500	
島根銀行	3,800	664.00	2,523,200	
じもとホールディングス	9,700	824.00	7,992,800	
めぶきフィナンシャルグループ	742,300	210.00	155,883,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,300	1,126.00	21,731,800	
九州フィナンシャルグループ	312,600	430.00	134,418,000	
ゆうちょ銀行	404,700	893.00	361,397,100	
富山第一銀行	34,100	288.00	9,820,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	815,900	391.00	319,016,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	95,100	674.00	64,097,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	83,800	532.00	44,581,600	
三十三フィナンシャルグループ	13,200	1,268.00	16,737,600	
第四北越フィナンシャルグループ	24,800	2,241.00	55,576,800	
ひろぎんホールディングス	210,700	623.00	131,266,100	
新生銀行	104,800	1,358.00	142,318,400	
あおぞら銀行	85,100	1,968.00	167,476,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,772,000	489.70	4,785,348,400	
りそなホールディングス	1,553,100	379.10	588,780,210	
三井住友トラスト・ホールディングス	270,000	3,213.00	867,510,000	
三井住友フィナンシャルグループ	988,000	3,383.00	3,342,404,000	
千葉銀行	476,700	590.00	281,253,000	
群馬銀行	274,400	327.00	89,728,800	
武蔵野銀行	21,300	1,567.00	33,377,100	
千葉興業銀行	39,200	242.00	9,486,400	
筑波銀行	59,400	186.00	11,048,400	
七十七銀行	48,300	1,382.00	66,750,600	
青森銀行	11,100	2,424.00	26,906,400	
秋田銀行	9,200	1,397.00	12,852,400	
山形銀行	16,100	1,022.00	16,454,200	
岩手銀行	9,400	1,982.00	18,630,800	
東邦銀行	127,700	209.00	26,689,300	
東北銀行	6,800	1,098.00	7,466,400	
みちのく銀行	9,200	1,017.00	9,356,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	120,300	1,939.00	233,261,700	
静岡銀行	347,900	782.00	272,057,800	
十六銀行	17,900	1,905.00	34,099,500	
スルガ銀行	146,100	321.00	46,898,100	
八十二銀行	344,700	349.00	120,300,300	

山梨中央銀行	16,600	801.00	13,296,600	
大垣共立銀行	28,200	2,040.00	57,528,000	
福井銀行	12,200	1,883.00	22,972,600	
北國銀行	14,200	2,528.00	35,897,600	
清水銀行	5,900	1,701.00	10,035,900	
富山銀行	2,800	2,830.00	7,924,000	
滋賀銀行	28,600	2,002.00	57,257,200	
南都銀行	23,800	1,729.00	41,150,200	
百五銀行	128,600	295.00	37,937,000	
京都銀行	51,200	5,770.00	295,424,000	
紀陽銀行	50,600	1,403.00	70,991,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	95,100	959.00	91,200,900	
山陰合同銀行	84,700	494.00	41,841,800	
中国銀行	122,900	827.00	101,638,300	
鳥取銀行	4,900	1,116.00	5,468,400	
伊予銀行	203,800	624.00	127,171,200	
百十四銀行	15,200	1,490.00	22,648,000	
四国銀行	21,700	658.00	14,278,600	
阿波銀行	23,300	2,241.00	52,215,300	
大分銀行	8,200	2,117.00	17,359,400	
宮崎銀行	9,500	2,193.00	20,833,500	
佐賀銀行	8,700	1,314.00	11,431,800	
沖縄銀行	13,100	2,764.00	36,208,400	
琉球銀行	33,000	749.00	24,717,000	
セブン銀行	477,300	222.00	105,960,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,941,100	1,411.00	2,738,892,100	
高知銀行	5,200	706.00	3,671,200	
山口フィナンシャルグループ	178,300	608.00	108,406,400	
長野銀行	4,700	1,265.00	5,945,500	
名古屋銀行	10,700	2,693.00	28,815,100	
北洋銀行	215,300	215.00	46,289,500	
愛知銀行	5,200	2,862.00	14,882,400	
中京銀行	5,900	1,924.00	11,351,600	
大光銀行	4,900	1,293.00	6,335,700	
愛媛銀行	19,900	975.00	19,402,500	
トマト銀行	5,500	1,055.00	5,802,500	
京葉銀行	60,900	412.00	25,090,800	
栃木銀行	69,000	173.00	11,937,000	
北日本銀行	4,400	1,930.00	8,492,000	
東和銀行	25,100	672.00	16,867,200	
福島銀行	13,400	211.00	2,827,400	
大東銀行	7,400	640.00	4,736,000	

トモニホールディングス	110,400	307.00	33,892,800	
フィデアホールディングス	138,700	108.00	14,979,600	
池田泉州ホールディングス	164,300	152.00	24,973,600	
ＦＰＧ	44,400	500.00	22,200,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	7,400	1,169.00	8,650,600	
マーキュリアインベストメント	5,800	724.00	4,199,200	
ＳＢＩホールディングス	164,100	2,710.00	444,711,000	
ジャフコ　グループ	22,000	5,350.00	117,700,000	
大和証券グループ本社	1,146,600	501.60	575,134,560	
野村ホールディングス	2,513,900	568.00	1,427,895,200	
岡三証券グループ	122,200	419.00	51,201,800	
丸三証券	42,800	530.00	22,684,000	
東洋証券	52,400	142.00	7,440,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	164,600	325.00	53,495,000	
光世証券	3,700	709.00	2,623,300	
水戸証券	42,000	268.00	11,256,000	
いちよし証券	27,100	507.00	13,739,700	
松井証券	81,800	817.00	66,830,600	
マネックスグループ	105,200	516.00	54,283,200	
極東証券	19,400	763.00	14,802,200	
岩井コスモホールディングス	13,600	1,424.00	19,366,400	
藍澤證券	25,900	780.00	20,202,000	
マネーパートナーズグループ	16,100	217.00	3,493,700	
スパークス・グループ	66,700	284.00	18,942,800	
かんぽ生命保険	50,600	2,236.00	113,141,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	268,600	4,180.00	1,122,748,000	
アニコム　ホールディングス	47,500	1,162.00	55,195,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	373,500	3,210.00	1,198,935,000	
第一生命ホールディングス	808,400	1,710.50	1,382,768,200	
東京海上ホールディングス	505,100	5,524.00	2,790,172,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	427,000	1,314.00	561,078,000	
アドバンスクリエイト	3,000	1,888.00	5,664,000	
全国保証	40,300	4,405.00	177,521,500	
イントラスト	5,200	799.00	4,154,800	
日本モーゲージサービス	6,000	1,227.00	7,362,000	
Ｃａｓａ	5,100	1,002.00	5,110,200	
アルヒ	22,800	1,686.00	38,440,800	
プレミアグループ	7,800	2,425.00	18,915,000	
クレディセゾン	100,200	1,229.00	123,145,800	
芙蓉総合リース	15,000	7,190.00	107,850,000	
みずほリース	22,100	3,225.00	71,272,500	
東京センチュリー	28,800	8,680.00	249,984,000	

日本証券金融	63,100	521.00	32,875,100	
アイフル	218,300	256.00	55,884,800	
リコーリース	11,300	3,100.00	35,030,000	
イオンフィナンシャルサービス	87,500	1,313.00	114,887,500	
アコム	287,300	458.00	131,583,400	
ジャックス	15,800	1,916.00	30,272,800	
オリエントコーポレーション	387,200	123.00	47,625,600	
日立キャピタル	33,700	2,578.00	86,878,600	
オリックス	886,300	1,788.00	1,584,704,400	
三菱ＵＦＪリース	362,700	514.00	186,427,800	
九州リースサービス	7,200	617.00	4,442,400	
日本取引所グループ	410,100	2,634.50	1,080,408,450	
イー・ギャランティ	16,400	2,390.00	39,196,000	
アサックス	7,600	736.00	5,593,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,900	1,949.00	11,499,100	
いちご	188,800	279.00	52,675,200	
日本駐車場開発	155,200	139.00	21,572,800	
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	1,092.00	9,718,800	
ＡＤワークスグループ	27,000	154.00	4,158,000	
ヒューリック	304,800	1,123.00	342,290,400	
三栄建築設計	6,800	1,782.00	12,117,600	
野村不動産ホールディングス	87,700	2,241.00	196,535,700	
三重交通グループホールディングス	33,000	480.00	15,840,000	
サムティ	21,500	1,642.00	35,303,000	
ディア・ライフ	24,800	431.00	10,688,800	
日本商業開発	10,200	1,690.00	17,238,000	
ハウスコム	3,900	1,325.00	5,167,500	
日本管理センター	9,300	1,227.00	11,411,100	
サンセイランディック	6,900	734.00	5,064,600	
フージャースホールディングス	28,500	677.00	19,294,500	
オープンハウス	45,500	4,140.00	188,370,000	
東急不動産ホールディングス	392,000	562.00	220,304,000	
飯田グループホールディングス	120,100	2,178.00	261,577,800	
イーグランド	4,700	800.00	3,760,000	
ムゲンエステート	13,100	455.00	5,960,500	
ハウスドゥ	7,000	1,253.00	8,771,000	
シーアールイー	5,200	1,300.00	6,760,000	
グッドコムアセット	8,400	1,279.00	10,743,600	
ジェイ・エス・ビー	3,200	3,465.00	11,088,000	
テンポイノベーション	5,400	900.00	4,860,000	
パーク２４	77,700	2,056.00	159,751,200	
パラカ	4,900	1,603.00	7,854,700	

三井不動産	695,400	2,044.00	1,421,397,600	
三菱地所	1,002,100	1,645.50	1,648,955,550	
平和不動産	26,700	3,735.00	99,724,500	
東京建物	142,400	1,455.00	207,192,000	
ダイビル	38,400	1,242.00	47,692,800	
京阪神ビルディング	24,000	1,699.00	40,776,000	
住友不動産	321,800	3,065.00	986,317,000	
テーオーシー	30,700	724.00	22,226,800	
東京楽天地	2,800	4,360.00	12,208,000	
スターツコーポレーション	20,100	2,728.00	54,832,800	
フジ住宅	19,700	642.00	12,647,400	
空港施設	18,400	482.00	8,868,800	
明和地所	11,200	587.00	6,574,400	
ゴールドクレスト	12,400	1,702.00	21,104,800	
エスリード	6,900	1,514.00	10,446,600	
日神グループホールディングス	25,800	419.00	10,810,200	
日本エスコン	25,900	772.00	19,994,800	
タカラレーベン	65,300	311.00	20,308,300	
ＡＶＡＮＴＩＡ	10,300	870.00	8,961,000	
イオンモール	72,800	1,674.00	121,867,200	
毎日コムネット	6,500	678.00	4,407,000	
ファースト住建	8,000	1,084.00	8,672,000	
カチタス	36,000	3,215.00	115,740,000	
トーセイ	21,600	996.00	21,513,600	
穴吹興産	4,300	1,622.00	6,974,600	
サンフロンティア不動産	21,900	889.00	19,469,100	
エフ・ジェー・ネクスト	14,400	1,019.00	14,673,600	
インテリックス	4,000	568.00	2,272,000	
ランドビジネス	4,800	334.00	1,603,200	
サンネクスタグループ	6,600	950.00	6,270,000	
グランディハウス	15,800	421.00	6,651,800	
日本空港ビルデング	45,900	5,900.00	270,810,000	
明豊ファシリティワークス	6,700	639.00	4,281,300	
日本工営	9,400	2,718.00	25,549,200	
ＬＩＦＵＬＬ	49,000	359.00	17,591,000	
ミクシィ	26,500	2,466.00	65,349,000	
ジェイエイシーリクルートメント	9,400	1,928.00	18,123,200	
日本M&Aセンター	105,900	5,380.00	569,742,000	
メンバーズ	4,200	2,546.00	10,693,200	
中広	2,700	322.00	869,400	
ＵＴグループ	21,900	3,085.00	67,561,500	
アイティメディア	5,700	2,163.00	12,329,100	

タケエイ	15,300	1,447.00	22,139,100	
Ｅ・Ｊホールディングス	5,600	1,004.00	5,622,400	
ビーネックスグループ	17,600	1,180.00	20,768,000	
コシダカホールディングス	33,900	419.00	14,204,100	
アルトナー	3,600	893.00	3,214,800	
パソナグループ	15,100	1,897.00	28,644,700	
ＣＤＳ	3,600	1,371.00	4,935,600	
リンクアンドモチベーション	25,400	538.00	13,665,200	
ＧＣＡ	18,500	684.00	12,654,000	
エス・エム・エス	43,200	3,980.00	171,936,000	
サニーサイドアップグループ	5,200	624.00	3,244,800	
パーソルホールディングス	138,500	1,900.00	263,150,000	
リニカル	7,000	753.00	5,271,000	
クックパッド	44,300	310.00	13,733,000	
アイ・ケイ・ケイ	7,200	613.00	4,413,600	
学情	5,100	1,289.00	6,573,900	
スタジオアリス	7,100	2,073.00	14,718,300	
シミックホールディングス	7,000	1,446.00	10,122,000	
エプコ	3,600	957.00	3,445,200	
ＮＪＳ	3,500	1,992.00	6,972,000	
綜合警備保障	55,100	5,240.00	288,724,000	
カカクコム	102,300	2,848.00	291,350,400	
アイロムグループ	5,000	1,768.00	8,840,000	
セントケア・ホールディング	9,300	957.00	8,900,100	
サイネックス	2,700	675.00	1,822,500	
ルネサンス	8,000	944.00	7,552,000	
ディップ	19,000	2,395.00	45,505,000	
デジタルホールディングス	9,800	1,785.00	17,493,000	
ツクイホールディングス	33,100	601.00	19,893,100	
キャリアデザインセンター	3,500	929.00	3,251,500	
ベネフィット・ワン	50,400	3,040.00	153,216,000	
エムスリー	305,200	10,120.00	3,088,624,000	
ツカダ・グローバルホールディング	11,000	254.00	2,794,000	
アウトソーシング	79,500	1,325.00	105,337,500	
ウェルネット	14,500	450.00	6,525,000	
ワールドホールディングス	4,900	1,905.00	9,334,500	
ディー・エヌ・エー	58,700	1,863.00	109,358,100	
博報堂ＤＹホールディングス	192,600	1,494.00	287,744,400	
ぐるなび	24,600	531.00	13,062,600	
タカミヤ	15,100	571.00	8,622,100	
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	834.00	9,090,600	
ファンコミュニケーションズ	38,700	404.00	15,634,800	

ライク	4,700	1,825.00	8,577,500	
ビジネス・ブレークスルー	6,300	450.00	2,835,000	
エスプール	35,800	929.00	33,258,200	
ＷＤＢホールディングス	6,400	2,606.00	16,678,400	
手間いらず	900	4,870.00	4,383,000	
ティア	8,700	415.00	3,610,500	
ＣＤＧ	1,600	1,500.00	2,400,000	
バリューコマース	9,400	3,165.00	29,751,000	
インフォマート	140,300	892.00	125,147,600	
ＪＰホールディングス	44,400	282.00	12,520,800	
エコナックホールディングス	27,800	92.00	2,557,600	
ＥＰＳホールディングス	19,000	993.00	18,867,000	
レッグス	3,600	1,625.00	5,850,000	
プレステージ・インターナショナル	52,100	888.00	46,264,800	
アミューズ	7,600	2,527.00	19,205,200	
ドリームインキュベータ	4,400	1,316.00	5,790,400	
クイック	8,800	1,056.00	9,292,800	
ＴＡＣ	9,400	250.00	2,350,000	
電通グループ	155,700	3,040.00	473,328,000	
イオンファンタジー	5,500	2,194.00	12,067,000	
シーティーエス	15,900	917.00	14,580,300	
ネクシィーズグループ	4,500	878.00	3,951,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	38,800	3,010.00	116,788,000	
アルプス技研	12,400	2,054.00	25,469,600	
ダイオーズ	3,000	950.00	2,850,000	
日本空調サービス	14,800	739.00	10,937,200	
オリエンタルランド	147,200	15,840.00	2,331,648,000	
ダスキン	34,500	2,801.00	96,634,500	
明光ネットワークジャパン	18,000	583.00	10,494,000	
ファルコホールディングス	7,800	1,613.00	12,581,400	
ラウンドワン	38,900	861.00	33,492,900	
リゾートトラスト	63,600	1,482.00	94,255,200	
ビー・エム・エル	17,900	3,410.00	61,039,000	
りらいあコミュニケーションズ	24,200	1,324.00	32,040,800	
リソー教育	64,100	300.00	19,230,000	
早稲田アカデミー	6,300	988.00	6,224,400	
ユー・エス・エス	155,100	2,063.00	319,971,300	
東京個別指導学院	5,300	620.00	3,286,000	
サイバーエージェント	85,300	7,470.00	637,191,000	
楽天	645,400	966.00	623,456,400	
クリーク・アンド・リバー社	7,500	1,100.00	8,250,000	
モーニングスター	15,700	466.00	7,316,200	

テー・オー・ダブリュー	23,000	268.00	6,164,000	
山田コンサルティンググループ	9,200	955.00	8,786,000	
セントラルスポーツ	5,300	2,144.00	11,363,200	
フルキャストホールディングス	12,300	1,567.00	19,274,100	
エン・ジャパン	24,700	3,170.00	78,299,000	
リソルホールディングス	1,600	3,810.00	6,096,000	
テクノプロ・ホールディングス	27,700	8,380.00	232,126,000	
アトラ	3,200	331.00	1,059,200	
インターワークス	3,400	353.00	1,200,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,600	18,220.00	102,032,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	10,300	2,144.00	22,083,200	
ファーストロジック	3,000	794.00	2,382,000	
三機サービス	2,900	1,006.00	2,917,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,900	748.00	6,657,200	
デザインワン・ジャパン	5,300	215.00	1,139,500	
イー・ガーディアン	6,200	2,982.00	18,488,400	
リブセンス	8,700	239.00	2,079,300	
ジャパンマテリアル	42,700	1,657.00	70,753,900	
ベクトル	17,500	1,300.00	22,750,000	
ウチヤマホールディングス	7,600	338.00	2,568,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	1,328.00	15,936,000	
キャリアリンク	4,600	2,728.00	12,548,800	
ＩＢＪ	11,700	815.00	9,535,500	
アサンテ	5,700	1,625.00	9,262,500	
Ｎ・フィールド	9,800	862.00	8,447,600	
バリューＨＲ	5,600	1,749.00	9,794,400	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	11,300	4,955.00	55,991,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	2,038.00	11,005,200	
ＥＲＩホールディングス	4,300	621.00	2,670,300	
アビスト	2,200	3,000.00	6,600,000	
シグマクシス	9,600	1,731.00	16,617,600	
ウィルグループ	9,300	1,003.00	9,327,900	
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,400	290.00	6,206,000	
メドピア	6,600	7,740.00	51,084,000	
レアジョブ	1,400	2,390.00	3,346,000	
リクルートホールディングス	991,500	4,566.00	4,527,189,000	
エラン	19,200	1,475.00	28,320,000	
土木管理総合試験所	7,500	346.00	2,595,000	
ネットマーケティング	5,700	650.00	3,705,000	
日本郵政	1,134,700	847.30	961,431,310	
ベルシステム２４ホールディングス	23,300	1,722.00	40,122,600	
鎌倉新書	10,800	888.00	9,590,400	

ＳＭＮ	3,300	776.00	2,560,800	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,800	3,865.00	18,552,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,800	873.00	2,444,400	
エアトリ	7,500	1,370.00	10,275,000	
アトラエ	4,300	2,716.00	11,678,800	
ストライク	5,300	4,550.00	24,115,000	
ソラスト	38,300	1,571.00	60,169,300	
セラク	4,500	1,709.00	7,690,500	
インソース	11,600	1,799.00	20,868,400	
ベイカレント・コンサルティング	8,400	18,680.00	156,912,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,000	1,965.00	5,895,000	
アイモバイル	5,100	1,304.00	6,650,400	
キャリアインデックス	6,100	545.00	3,324,500	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,700	1,085.00	5,099,500	
船場	3,000	865.00	2,595,000	
グレイステクノロジー	6,400	6,360.00	40,704,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	31,900	2,509.00	80,037,100	
フルテック	2,100	1,385.00	2,908,500	
グリーンズ	3,500	456.00	1,596,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	4,600	581.00	2,672,600	
ソウルドアウト	3,500	1,504.00	5,264,000	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,000	544.00	1,632,000	
エル・ティー・エス	1,100	3,895.00	4,284,500	
ミダック	1,900	3,035.00	5,766,500	
日総工産	9,600	815.00	7,824,000	
キュービーネットホールディングス	5,900	1,411.00	8,324,900	
ＲＰＡホールディングス	11,000	607.00	6,677,000	
スプリックス	4,300	777.00	3,341,100	
マネジメントソリューションズ	6,900	1,972.00	13,606,800	
プロレド・パートナーズ	2,000	3,610.00	7,220,000	
テノ．ホールディングス	1,300	1,247.00	1,621,100	
フロンティア・マネジメント	2,400	2,150.00	5,160,000	
ピアラ	800	2,002.00	1,601,600	
コプロ・ホールディングス	900	3,705.00	3,334,500	
ギークス	1,600	1,344.00	2,150,400	
カーブスホールディングス	38,300	758.00	29,031,400	
フォーラムエンジニアリング	7,500	923.00	6,922,500	
ダイレクトマーケティングミックス	5,500	3,100.00	17,050,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,400	628.00	4,647,200	
リログループ	75,800	2,511.00	190,333,800	
東祥	8,800	1,537.00	13,525,600	
エイチ・アイ・エス	20,100	1,782.00	35,818,200	

ラックランド	4,000	2,378.00	9,512,000	
共立メンテナンス	23,000	3,415.00	78,545,000	
イチネンホールディングス	15,700	1,242.00	19,499,400	
建設技術研究所	9,000	2,398.00	21,582,000	
スペース	9,300	810.00	7,533,000	
長大	5,700	1,590.00	9,063,000	
燦ホールディングス	6,200	1,146.00	7,105,200	
スバル興業	900	9,100.00	8,190,000	
東京テアトル	5,600	1,265.00	7,084,000	
タナベ経営	2,900	1,340.00	3,886,000	
ナガワ	4,400	9,610.00	42,284,000	
東京都競馬	9,100	4,305.00	39,175,500	
カナモト	24,500	2,316.00	56,742,000	
西尾レントオール	12,900	2,202.00	28,405,800	
トランス・コスモス	13,300	2,526.00	33,595,800	
乃村工藝社	59,600	838.00	49,944,800	
藤田観光	5,500	1,453.00	7,991,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,600	929.00	7,989,400	
日本管財	14,900	2,033.00	30,291,700	
トーカイ	13,500	2,024.00	27,324,000	
セコム	146,900	9,542.00	1,401,719,800	
セントラル警備保障	6,700	3,490.00	23,383,000	
丹青社	26,400	836.00	22,070,400	
メイテック	17,000	5,110.00	86,870,000	
応用地質	16,300	1,333.00	21,727,900	
船井総研ホールディングス	28,400	2,280.00	64,752,000	
進学会ホールディングス	6,000	472.00	2,832,000	
オオバ	10,100	742.00	7,494,200	
いであ	3,500	1,774.00	6,209,000	
学究社	4,200	1,336.00	5,611,200	
ベネッセホールディングス	46,200	1,990.00	91,938,000	
イオンディライト	17,100	2,655.00	45,400,500	
ナック	7,900	930.00	7,347,000	
ダイセキ	23,300	3,190.00	74,327,000	
ステップ	5,200	1,500.00	7,800,000	
合　計	151,417,600		370,896,226,800	

(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。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	110,898,740
金銭信託	155,211
コール・ローン	3,031,317,396
国債証券	277,712,788,182
派生商品評価勘定	6,931,631
未収入金	132,508
未収利息	1,789,721,168
前払金	3,548,189
前払費用	48,488,786
差入委託証拠金	481,030,468
流動資産合計	283,185,012,279
資産合計	283,185,012,279
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,582,766
未払金	526,907
未払解約金	229,319,107
未払利息	2,059
流動負債合計	239,430,839
負債合計	239,430,839
純資産の部	
元本等	
元本	94,925,048,586
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	188,020,532,854
元本等合計	282,945,581,440
純資産合計	282,945,581,440
負債純資産合計	283,185,012,279

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2021年 1月20日現在
	移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
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 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	94,925,048,586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 2.9807円 (1万口当たり純資産額) (29,807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

	2021年 1月20日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 1月20日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	141,679,824,519円
期中追加設定元本額	14,849,798,334円
期中一部解約元本額	61,604,574,267円
期末元本額	94,925,048,586円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,500,223,211円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	610,426,540円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,028,498,942円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,351,531円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,768,826,444円
世界経済インデックスファンド	7,995,940,591円
ＤＣマイセレクション２５	1,780,880,906円
ＤＣマイセレクション５０	1,511,585,087円
ＤＣマイセレクション７５	888,075,363円

区分	2021年 1月20日現在
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,099,179,869円
ＤＣマイセレクションＳ２５	806,052,108円
ＤＣマイセレクションＳ５０	652,534,388円
ＤＣマイセレクションＳ７５	288,760,461円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	40,101,678円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	72,755,348円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	35,685,929円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,258,551,164円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	687,748,406円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	8,378,767円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,345,183円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,584,618円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	36,047,112円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	74,244,377円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	111,242,865円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	111,547,647円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	131,876,590円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,661,409,117円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	501,420,198円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,868,211,535円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	701,489,725円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	62,050,768円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	522,889,523円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	201,384,458円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	242,341,497円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	832,589,391円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	932,040,597円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	797,530,803円
外国債券ファンド・シリーズ１	591,164,700円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,005,426,797円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,530,527,298円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,090,641,754円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,217,866,231円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	384,859,624円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,320,640,417円
コア投資戦略ファンド（切替型）	824,670,942円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	209,234,971円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	98,435,250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）	1,167,487,537円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	185,501,748円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	20,374,211,261円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	146,048,388円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	142,671,388円

区分	2021年 1月20日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	233,452,784円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,584,186円
グローバル経済コア	764,374,964円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,868,614円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	338,330円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	240,627,943円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	22,210,575円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	494,434円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	563,735円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	298,765円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	466,328円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	571,148,489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）	10,407,754,303円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	340,350,121円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	362,144,537円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	137,147,138円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	286,562,535円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△1,037,733,972
合計	△1,037,733,972

(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

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,091,037,968	－	3,087,489,779	△3,548,189
合計		3,091,037,968	－	3,087,489,779	△3,548,189

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,035,251,246	－	3,036,148,300	897,054
	アメリカドル	1,302,474,016	－	1,304,858,400	2,384,384
	カナダドル	163,968,023	－	164,136,600	168,577
	ユーロ	1,332,220,626	－	1,330,464,200	△1,756,426
	イギリスポンド	236,588,581	－	236,689,100	100,519
合計		3,035,251,246	－	3,036,148,300	897,054

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,496,191.42	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,051,184.37	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,990,000.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,244,160.17	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,174,582.08	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,019,062.48	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	994,296.88	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,936,718.80	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,443,164.10	

		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	8,006,875.04	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,304,804.73	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,815,625.04	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,991,093.75	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,830,096.13	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,266,817.22	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,912,092.96	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,462,949.21	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	7,018,738.29	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,378,710.97	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,567,945.38	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	15,303,277.42	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,477,929.70	
		T 0.875% 11/15/30	4,000,000.00	3,920,937.52	
		T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,394,420.35	
		T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	8,508,046.86	
		T 1.25% 05/15/50	10,150,000.00	8,795,609.37	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,675,658.21	
		T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,379,687.50	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,149,218.75	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,855,859.37	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,579,199.22	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,130,468.76	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,107,910.15	
		T 1.375% 11/15/40	2,500,000.00	2,389,843.75	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,564,775.38	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,742,447.68	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,023,335.91	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,118,906.24	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,216,992.20	
		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,842,312.50	
		T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,715,419.91	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,881,503.88	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,573,660.13	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,617,441.41	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,758,769.90	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,034,726.56	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,559,277.35	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	7,122,304.68	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,120,605.45	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,601,074.22	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,736,574.23	

		T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,299,201.59	
		T 1.625% 11/15/50	2,900,000.00	2,762,023.45	
		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,305,771.07	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,797,439.47	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,545,556.65	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,737,269.57	
		T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,615,048.83	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,881,789.07	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,827,077.74	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,761,890.62	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,165,019.54	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,524,218.74	
		T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,521,500.00	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,292,027.36	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,196,640.64	
		T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,127,968.75	
		T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,549,121.10	
		T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,615,908.21	
		T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,550,385.72	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,241,699.23	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,570,126.96	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,112,812.52	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,347,578.14	
		T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,738,760.95	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,681,066.44	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,403,011.70	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,849,492.20	
		T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,890,449.81	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,582,062.51	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,908,671.88	
		T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,173,789.04	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,116,312.51	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,543,125.04	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,829,598.43	
		T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,566,787.10	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,525,422.64	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,248,593.76	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,824,373.02	
		T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,105,703.12	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,462,382.83	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,404,332.07	
		T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	8,017,860.93	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	6,045,273.46	

		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,764,625.00	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,906,095.72	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,784,312.50	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,419,183.63	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,772,988.27	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,040,171.89	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,226,757.80	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,146,775.01	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,855,429.69	
		T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,899,326.14	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,936,782.07	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,377,734.40	
		T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	8,462,695.35	
		T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,653,486.32	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,711,408.97	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,437,695.30	
		T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,999,875.00	
		T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,075,289.86	
		T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,607,187.52	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,259,302.74	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,495,585.97	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,816,574.24	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,824,599.59	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,197,289.44	
		T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,330,845.31	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,473,226.56	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,939,599.62	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,196,105.48	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,750,605.46	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,441,330.45	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,235,429.68	
		T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,544,375.00	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,813,046.88	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,117,498.44	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,076,425.79	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,065,507.81	
		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,559,289.06	
		T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,979,445.31	
		T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	8,005,664.10	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,640,402.36	
		T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,565,134.40	
		T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,379,373.45	

		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,686,449.23	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,428,437.52	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,328,014.09	
		T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,298,289.06	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,918,114.06	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,235,574.20	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,070,410.96	
		T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,252,425.00	
		T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,280,601.58	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,095,673.84	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,687,207.02	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,329,194.52	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,380,664.10	
		T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,550,781.25	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,192,578.15	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,034,354.72	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,208,203.15	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,591,388.65	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,505,626.16	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,831,503.92	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,086,250.00	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,393,562.12	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,332,031.30	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,051,572.68	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,069,492.18	
		T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,239,316.39	
		T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,983,949.23	
		T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,444,179.70	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,668,694.55	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,277,206.24	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,832,593.79	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,217,167.97	
		T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	5,965,179.68	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	7,173,218.75	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,016,279.68	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,289,312.51	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,734,687.50	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,756,406.26	
		T 3.75% 11/15/43	4,500,000.00	6,270,468.75	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,017,878.91	
		T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,531,281.26	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,628,207.05	
		T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,886,171.91	

	T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,018,039.07	
	T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,385,390.62	
	T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,207,982.81	
	T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,902,339.87	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,705,968.75	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,610,351.55	
	T 3% 11/15/44	4,050,000.00	5,064,714.86	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,299,093.75	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,428,062.50	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,447,265.63	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,801,015.62	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,901,996.10	
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,852,298.44	
	T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,278,544.53	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	808,500.00	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,529,281.25	
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,604,770.32	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,164,082.03	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,680,507.81	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,676,269.53	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,733,875.00	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,759,554.68	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,612,593.75	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,172,480.47	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,973,246.10	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,544,156.25	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,908,779.30	
	アメリカドル 小計	1,063,230,000.00	1,144,694,685.75 (118,968,118,689)	
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	1,210,000.00	1,211,887.60	
	CAN 0.25% 03/01/26	1,200,000.00	1,186,176.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	700,000.00	699,944.00	
	CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	911,901.90	
	CAN 0.25% 11/01/22	160,000.00	160,300.80	
	CAN 0.5% 03/01/22	3,600,000.00	3,615,840.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	4,005,361.50	
	CAN 0.5% 12/01/30	1,360,000.00	1,314,548.80	
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,847,385.20	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,227,424.00	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,103,972.50	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,436,799.20	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	625,998.00	

		CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,739,930.60	
		CAN 1% 06/01/27	2,320,000.00	2,391,224.00	
		CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,536,475.00	
		CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,443,474.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,948,068.00	
		CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,420,171.20	
		CAN 2.5% 06/01/24	3,300,000.00	3,549,876.00	
		CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,802,633.80	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,462,988.00	
		CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	800,156.00	
		CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,442,886.40	
		CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,512,354.50	
		CAN 2% 12/01/51	3,170,000.00	3,608,791.40	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,700,000.00	2,471,086.00	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,569,697.50	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,649,922.30	
		CAN 5.75% 06/01/33	1,410,000.00	2,192,394.90	
		CAN 5% 06/01/37	1,130,000.00	1,787,761.70	
	カナダドル 小計		61,450,000.00	67,677,430.80 (5,528,569,322)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,880,396.00	
		MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	35,468,614.40	
		MBONO 5.75% 03/05/26	40,580,000.00	42,445,868.40	
		MBONO 6.5% 06/09/22	33,580,000.00	34,642,807.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,118,470.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	34,220,000.00	38,936,884.80	
		MBONO 7.75% 05/29/31	19,180,000.00	22,463,616.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	27,491,451.20	
		MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	16,518,855.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	45,873,019.20	
		MBONO 8.5% 11/18/38	25,020,000.00	30,693,285.00	
		MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,547,111.60	
		MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	24,983,388.00	
		MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,648,011.80	
	メキシコペソ 小計		384,820,000.00	436,711,778.40 (2,310,205,307)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,429,115.50	
		BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	1,004,186.40	
		BGB 0.4% 06/22/40	570,000.00	598,004.10	
		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,692,171.00	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,322,157.80	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,839,243.90	
		BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,712,365.20	

		BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,626,609.20	
		BGB 0% 10/22/27	1,520,000.00	1,574,644.00	
		BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,003,229.50	
		BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	889,020.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,320,000.00	1,743,218.40	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,368,090.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,386,000.00	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,481,825.60	
		BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,249,537.40	
		BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,434,638.70	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,983,644.00	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,234,610.30	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,383,446.40	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,187,660.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,466,998.10	
		BGB 4.25% 03/28/41	2,190,000.00	3,967,623.00	
		BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,276,610.00	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,447,503.60	
		BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,287,758.80	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,603,897.20	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,005,841.00	
		BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,666,746.50	
		BKO 0% 03/11/22	6,580,000.00	6,630,008.00	
		BKO 0% 06/10/22	600,000.00	605,718.00	
		BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,046,118.20	
		BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,878,693.50	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	591,182.40	
		BTPS 0.5% 02/01/26	1,560,000.00	1,597,564.80	
		BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,226,420.00	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,344,860.00	
		BTPS 0.9% 04/01/31	700,000.00	722,029.00	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,242,137.20	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,054,680.00	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,652,240.00	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,320,671.80	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,492,812.00	
		BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,048,471.40	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,080,747.50	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,091,727.40	
		BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,962,176.00	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,250,000.00	1,339,675.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,451,593.00	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,049,918.90	

		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,547,048.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,575,542.90	
		BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,445,689.00	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,326,802.50	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,806,547.60	
		BTPS 1.7% 09/01/51	620,000.00	654,062.80	
		BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,413,824.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	1,340,000.00	1,476,412.00	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,136,320.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,929,446.00	
		BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,204,884.80	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,068,635.60	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,555,840.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,571,338.40	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,648,651.20	
		BTPS 2.45% 09/01/33	1,790,000.00	2,145,995.20	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,470,000.00	1,821,153.60	
		BTPS 2.45% 10/01/23	910,000.00	977,531.10	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,309,369.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,250,133.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,237,096.80	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,755,837.60	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,248,854.30	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,663,585.50	
		BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	3,015,463.10	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,295,844.10	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,888,486.40	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,745,561.00	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,941,877.40	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	3,102,026.40	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	5,028,447.60	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,453,537.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,386,685.60	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,085,793.60	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,155,487.50	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,555,737.60	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,976,807.20	
		BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,590,579.50	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,830,949.20	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,736,722.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	5,114,201.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,452,359.00	

		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	5,035,264.00	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,532,202.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,809,179.50	
		BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,856,728.80	
		BTPS 5% 03/01/22	650,000.00	689,162.50	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,432,186.80	
		BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	5,237,456.40	
		BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,318,910.30	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	5,111,640.00	
		BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	6,061,020.20	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,978,382.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,007,568.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	4,830,000.00	5,120,959.20	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,177,276.50	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,334,976.20	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,156,000.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,192,600.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,595,396.60	
		DBR 0.5% 08/15/27	4,690,000.00	5,070,359.00	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,765,100.50	
		DBR 0% 05/15/35	2,010,000.00	2,116,932.00	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,531,003.50	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,688,335.00	
		DBR 0% 08/15/30	4,260,000.00	4,493,448.00	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	709,208.40	
		DBR 0% 08/15/50	2,290,000.00	2,371,249.20	
		DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,262,751.20	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,270,000.00	4,556,483.40	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,099,149.60	
		DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,179,305.00	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,464,154.50	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,901,864.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,779,013.50	
		DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,164,717.50	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,127,560.00	
		DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,941,217.60	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,886,701.40	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,800,000.00	6,490,324.00	
		DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,384,678.00	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,064,661.60	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,602,307.20	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,046,632.00	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,550,000.00	4,783,009.50	

		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,615,109.50	
		DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,422,840.40	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,719,005.50	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,615,198.80	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,430,991.60	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,910,141.10	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,046,812.50	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,450,517.60	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,907,401.20	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,870,450.30	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,393,516.70	
		FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,312,040.00	
		FRTR 0.5% 05/25/40	1,310,000.00	1,401,883.40	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,503,414.00	
		FRTR 0.75% 05/25/52	2,280,000.00	2,509,436.40	
		FRTR 0.75% 11/25/28	4,500,000.00	4,932,720.00	
		FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,013,360.00	
		FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,079,233.00	
		FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,204,668.40	
		FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,369,138.40	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,077,806.00	
		FRTR 0% 03/25/25	8,090,000.00	8,308,187.30	
		FRTR 0% 05/25/22	2,800,000.00	2,824,248.00	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,439,681.60	
		FRTR 0% 11/25/30	3,590,000.00	3,699,818.10	
		FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	6,053,765.90	
		FRTR 1.25% 05/25/36	4,830,000.00	5,782,765.80	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,441,236.40	
		FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	5,390,251.90	
		FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,854,567.60	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,530,000.00	2,293,959.60	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,540,350.40	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,549,168.00	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,112,721.50	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,702,030.40	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,505,449.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,038,193.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	8,120,655.40	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,318,026.00	
		FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,993,472.00	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,742,905.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,748,079.50	

		FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	8,878,757.10	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,713,412.60	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000.00	8,892,102.40	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,271,897.60	
		FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	5,151,864.00	
		FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,948,076.80	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,763,609.90	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,764,771.30	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,455,338.80	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,512,940.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,209,620.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	760,000.00	794,595.20	
		IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	870,877.50	
		IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	512,486.40	
		IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	834,079.40	
		IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,177,716.90	
		IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,227.50	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,351,692.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	792,154.40	
		IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	1,005,701.20	
		IRISH 1.5% 05/15/50	720,000.00	956,174.40	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	1,047,582.80	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,540,771.00	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,370,000.00	1,726,871.30	
		IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,555,430.00	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,095,207.60	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,111,030.30	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,891,863.90	
		NETHER 0.25% 07/15/25	1,930,000.00	2,014,495.40	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,826,057.70	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,100,000.00	1,252,328.00	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,471,844.00	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,303,107.20	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,786,131.00	
		NETHER 0% 01/15/22	1,490,000.00	1,499,983.00	
		NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,890,829.50	
		NETHER 0% 01/15/27	1,340,000.00	1,391,643.60	
		NETHER 0% 01/15/52	710,000.00	722,261.70	
		NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	2,006,745.60	
		NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,250,913.40	
		NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	689,231.40	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,640,000.00	2,225,020.80	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,100,000.00	3,712,632.00	

		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,182,035.00	
		NETHER 3.75% 01/15/23	2,330,000.00	2,538,768.00	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,813,142.40	
		NETHER 4% 01/15/37	1,980,000.00	3,376,236.60	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,485,248.80	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	233,008.00	
		OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,970,963.00	
		OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,672,207.00	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,870,225.00	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,257,407.00	
		OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,211,750.40	
		OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,493,722.80	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,541,574.10	
		OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,416,763.50	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,264,044.60	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	952,326.70	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,771,243.20	
		RAGB 0.75% 03/20/51	460,000.00	544,051.20	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,246,337.60	
		RAGB 0.85% 06/30/20	350,000.00	447,517.00	
		RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,172,250.70	
		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,525,620.00	
		RAGB 0% 07/15/24	1,240,000.00	1,269,164.80	
		RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	323,731.20	
		RAGB 0% 10/20/40	290,000.00	290,669.90	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,558,943.10	
		RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,274,704.50	
		RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	546,133.50	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,077,991.20	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,420,094.20	
		RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,660,334.00	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,260,000.00	1,709,177.40	
		RAGB 3.15% 06/20/44	960,000.00	1,671,475.20	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,538,699.20	
		RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,222,825.60	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,131,299.40	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,101,862.40	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,689,310.50	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,715,023.80	
		RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	561,767.40	
		RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	422,328.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	658,260.20	

		RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,406,193.30	
		RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	723,633.50	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	824,372.00	
		RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	559,670.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	740,721.90	
		RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	393,326.70	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	550,373.40	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	430,995.60	
		RFGB 0% 09/15/30	250,000.00	259,670.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	755,814.40	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	664,420.40	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	682,506.50	
		RFGB 1.625% 09/15/22	1,130,000.00	1,173,911.80	
		RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	932,388.80	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	525,478.80	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	794,911.60	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	1,006,557.60	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,348,257.60	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,464,071.50	
		SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,418,895.10	
		SPGB 0.45% 10/31/22	2,360,000.00	2,402,834.00	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	3,030,355.00	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,934,345.60	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,134,480.00	
		SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,391,195.50	
		SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,408,345.80	
		SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,876,630.00	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,401,817.50	
		SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,775,956.00	
		SPGB 1.4% 04/30/28	2,120,000.00	2,362,803.60	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,685,440.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,221,246.60	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,382,851.20	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,330,000.00	2,592,218.20	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,318,064.50	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,110,000.00	2,546,242.50	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,156,163.90	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,477,020.40	
		SPGB 1% 10/31/50	1,600,000.00	1,646,400.00	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,155,152.30	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	3,068,178.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,703,312.50	
		SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,040,820.00	

	SPGB 2.9% 10/31/46	2,250,000.00	3,356,032.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	3,492,756.60	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,877,084.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	4,012,402.90	
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	3,060,843.40	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,497,261.20	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,711,000.80	
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,788,248.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,350,000.00	4,231,598.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	6,056,536.20	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,639,505.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,354,289.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,272,846.60	
	SPGB 5.85% 01/31/22	3,260,000.00	3,474,931.80	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,689,056.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,566,463.50	
ユーロ 小計		753,650,000.00	916,480,511.80 (115,659,840,589)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	3,000,000.00	3,017,100.00	
	UKT 0.125% 01/31/23	3,130,000.00	3,142,895.60	
	UKT 0.125% 01/31/24	540,000.00	542,565.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,250,000.00	1,249,412.50	
	UKT 0.25% 07/31/31	1,200,000.00	1,184,976.00	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,435,705.80	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,179,547.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,210,596.20	
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,500,164.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,450,000.00	1,449,869.50	
	UKT 0.625% 10/22/50	2,550,000.00	2,394,552.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,972,012.10	
	UKT 0.875% 10/22/29	2,550,000.00	2,692,188.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,217,748.30	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,390,000.00	2,596,974.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,164,880.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,947,494.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,452,010.00	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,600,000.00	1,969,504.00	
	UKT 1.625% 10/22/71	800,000.00	1,119,480.00	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,593,904.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,180,000.00	2,832,147.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,215,659.20	
	UKT 1.75% 09/07/37	3,100,000.00	3,616,894.00	

		UKT 1% 04/22/24	2,620,000.00	2,712,695.60	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,654,175.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	3,169,574.40	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,786,309.20	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,948,886.40	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,389,356.70	
		UKT 3.5% 01/22/45	2,800,000.00	4,424,952.00	
		UKT 3.5% 07/22/68	2,000,000.00	4,180,440.00	
		UKT 3.75% 07/22/52	1,850,000.00	3,344,393.00	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,490,000.00	3,804,570.60	
		UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,785,887.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,619,702.00	
		UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,762,107.70	
		UKT 4.25% 12/07/40	2,070,000.00	3,406,826.70	
		UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,910,178.80	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,490,000.00	2,793,228.50	
		UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,508,621.00	
		UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,699,338.50	
		UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	4,084,633.80	
		UKT 4.75% 12/07/30	2,600,000.00	3,728,322.00	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,783,896.50	
		UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	3,199,966.00	
		UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,040,753.00	
		UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,395,087.20	
		UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,819,375.00	
	イギリスポンド 小計		103,580,000.00	133,651,554.80 (18,946,444,408)	
	スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,570,000.00	3,587,207.40	
		SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,537,511.50	
		SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,938,360.60	
		SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,157,625.00	
		SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,638,627.70	
		SGB 2.5% 05/12/25	10,050,000.00	11,265,547.50	
		SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	9,099,642.40	
		SGB 3.5% 06/01/22	12,650,000.00	13,317,161.00	
	スウェーデンクローナ 小計		67,220,000.00	74,541,683.10 (928,789,371)	
	ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,340,000.00	4,482,699.20	
		NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,101,686.40	
		NGB 1.75% 02/17/27	4,490,000.00	4,739,195.00	
		NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,991,137.20	
		NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	8,131,022.80	
		NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,282,886.00	

	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,686,979.20	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,938,128.00	
ノルウェークローネ 小計		49,670,000.00	52,353,733.80 (637,668,477)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	7,670,000.00	7,790,725.80	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,110,000.00	3,344,960.50	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,488,181.80	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,458,553.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,871,803.80	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,030,000.00	8,945,580.60	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,260,000.00	30,856,276.80	
デンマーククローネ 小計		67,480,000.00	85,756,082.30 (1,454,423,155)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	1,520,000.00	1,545,490.40	
	POLGB 1.25% 10/25/30	210,000.00	211,745.10	
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,630,106.90	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,230,173.40	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,152,648.40	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,050,000.00	6,520,992.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,721,327.80	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,218,971.40	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,849,175.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,464,813.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	5,210,000.00	5,884,851.30	
	POLGB 4% 10/25/23	3,430,000.00	3,805,070.50	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	834,924.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,454,762.50	
ポーランドズロチ 小計		57,820,000.00	63,525,052.90 (1,762,820,217)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,380,007.30	
	ACGB 0.25% 11/21/25	3,590,000.00	3,572,229.50	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,410,000.00	3,412,762.10	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,955,345.40	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,319,322.60	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	1,940,899.40	
	ACGB 1% 11/21/31	3,750,000.00	3,698,250.00	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,300,344.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	4,160,000.00	4,611,360.00	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,286,178.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,303,128.10	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,559,814.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,883,970.30	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,443,454.20	

	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,796,666.20	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,548,337.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,369,773.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,919,489.20	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,885,109.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,218,159.60	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,129,716.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,031,170.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,270,000.00	5,121,822.30	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,625,562.40	
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,120,000.00	5,181,559.20	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,200,000.00	4,709,208.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,633,276.00	
オーストラリアドル 小計		86,480,000.00	95,836,915.50 (7,676,536,931)	
シンガポールドル	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	823,880.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	295,205.50	
	SIGB 1.875% 03/01/50	80,000.00	90,935.20	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	800,887.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	834,119.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	531,115.90	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	506,419.60	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,184,515.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,599,525.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	771,491.40	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,134,060.90	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	684,954.60	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	892,984.80	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	430,614.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,411,884.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,388,783.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,027,285.60	
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,334,399.40	
シンガポールドル 小計		13,840,000.00	15,743,062.90 (1,232,366,963)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,540,725.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	737,268.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,416,163.40	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,611,834.40	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,103,642.10	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,138,156.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	561,814.00	

		MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,552,335.00	
		MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,743,713.80	
		MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,478,427.50	
		MGS 3.882% 03/10/22	960,000.00	983,673.60	
		MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,105,911.00	
		MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	799,269.70	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,229,620.80	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,149,880.70	
		MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,577,088.00	
		MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	652,596.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	2,220,000.00	2,413,339.80	
		MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,043,640.00	
		MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	775,960.00	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,377,881.60	
		MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,250,920.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	1,130,000.00	1,246,356.10	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,110,000.00	2,343,260.50	
		MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,721,696.60	
		MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,205,088.20	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,675,848.40	
		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,641,836.00	
		MGS 4.893% 06/08/38	1,610,000.00	1,874,184.90	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,400,000.00	1,635,998.00	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,814,342.40	
	マレーシアリンギット 小計		47,920,000.00	52,402,471.70 (1,345,695,473)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	280,000.00	280,486.92	
		ILGOV 0.5% 04/30/25	1,910,000.00	1,933,244.50	
		ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,825,905.10	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	1,450,000.00	1,459,038.72	
		ILGOV 1.5% 11/30/23	540,000.00	561,953.21	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,157,103.14	
		ILGOV 1% 03/31/30	1,770,000.00	1,805,874.00	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	2,880,000.00	3,243,876.18	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,551,206.54	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	2,590,000.00	3,565,372.74	
		ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,230,706.34	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,396,079.54	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,516,238.01	
	イスラエルシェケル 小計		33,640,000.00	39,527,084.94 (1,261,309,280)	
合計				277,712,788,182 (277,712,788,182)	

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　206銘柄	100.0%	42.8%
カナダドル	国債証券　31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　321銘柄	100.0%	41.6%
イギリスポンド	国債証券　49銘柄	100.0%	6.8%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券　27銘柄	100.0%	2.8%
シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　31銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　13銘柄	100.0%	0.5%

(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。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,299,890,755
金銭信託	39,161
コール・ローン	764,815,621
株式	453,301,958,176

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	287,508,812
投資証券	9,632,206,145
派生商品評価勘定	188,934,978
未収入金	1
未収配当金	342,427,175
差入委託証拠金	4,873,282,283
流動資産合計	471,691,063,107
資産合計	471,691,063,107
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,633,399
前受金	186,302,019
未払解約金	720,240,590
未払利息	519
流動負債合計	909,176,527
負債合計	909,176,527
純資産の部	
元本等	
元本	146,425,163,104
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	324,356,723,476
元本等合計	470,781,886,580
純資産合計	470,781,886,580
負債純資産合計	471,691,063,107

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。

	2021年 1月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 1月20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	146,425,163,104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 3.2152円 (1万口当たり純資産額) (32,152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

	2021年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 1月20日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	141,149,497,764円
期中追加設定元本額	37,481,916,113円
期中一部解約元本額	32,206,250,773円
期末元本額	146,425,163,104円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,156,944,255円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,547,093円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	26,782,550,586円
世界経済インデックスファンド	7,977,519,035円
外国株式インデックス・オープン	809,421,038円
ＤＣマイセレクション２５	999,966,840円
ＤＣマイセレクション５０	4,474,533,401円
ＤＣマイセレクション７５	4,977,762,434円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	10,183,507,261円

区分	2021年 1月20日現在
ＤＣマイセレクションＳ２５	372,884,325円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,911,022,928円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,520,713,172円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	83,976,129円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	190,001,810円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	130,410,781円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,160,358,713円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,988,260,711円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,962,856円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,576,295円
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	31,817,267円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	32,637,613円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	114,000,710円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	22,118,223円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	78,476,616円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	501,080,040円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	275,357,716円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,905,628,627円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,343,689,462円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	50,932,284円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	267,446,094円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	79,851,944円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,573,648,640円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,670,419,511円
外国株式ファンド・シリーズ１	976,806,740円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,660,911,949円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,365,375,756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	10,615,329,847円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,210,061,402円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,152,976,112円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,264,165,010円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	678,099,567円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,146,110円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	189,655,943円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	922,726,017円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	30,603,779,981円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	146,907,039円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	465,938,928円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	81,413,486円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,863,499円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	86,097,219円
グローバル経済コア	797,272,014円

区分	2021年 1月20日現在
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,789,072円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,585,586円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	743,907,864円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	70,789,277円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	1,654,894円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	1,617,206円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	781,425円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,122,801円
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）	788,994,344円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,507,613,597円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,718,525,801円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	423,849,523円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	115,349,202円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	321,937,393円
ＳＭＴＡＭバランスファンド２００２（適格機関投資家専用）	527,559,511円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	348,459,009円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	336,222,094円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	335,075,728円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	87,419,895,055
投資信託受益証券	△25,614,815
投資証券	418,976,510
合計	87,813,256,750

(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

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,270,936,672	－	7,457,238,691	186,302,019
合計		7,270,936,672	－	7,457,238,691	186,302,019

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	35,938,760	－	35,939,200	△440
	カナダドル	35,938,760	－	35,939,200	△440
合計		35,938,760	－	35,939,200	△440

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	22.87	1,326,002.60	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	18.61	667,708.19	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	67.63	1,486,236.88	
	CHEVRON CORP	177,065	94.51	16,734,413.15	
	CONOCOPHILLIPS	128,145	46.00	5,894,670.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	20.00	1,140,000.00	
	EOG RESOURCES INC	55,405	60.48	3,350,894.40	
	EXXON MOBIL	389,225	48.84	19,009,749.00	
	HALLIBURTON CO	77,539	20.54	1,592,651.06	
	HESS CORP	24,844	62.14	1,543,806.16	
	KINDER MORGAN INC	193,367	15.55	3,006,856.85	
	MARATHON PETROLEUM CORP	61,979	46.09	2,856,612.11	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	86,319	23.07	1,991,379.33	
ONEOK INC	41,832	44.11	1,845,209.52	
PHILLIPS 66	40,703	74.78	3,043,770.34	
PIONEER NATURAL RESOURCES	19,944	132.04	2,633,405.76	
SCHLUMBERGER	131,946	25.42	3,354,067.32	
VALERO ENERGY CORP	38,903	60.54	2,355,187.62	
WILLIAMS COS	114,214	22.45	2,564,104.30	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	20,129	285.66	5,750,050.14	
ALBEMARLE CORP	10,180	185.25	1,885,845.00	
AMCOR PLC	151,315	10.95	1,656,899.25	
AVERY DENNISON CORP	7,457	159.77	1,191,404.89	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	28.87	508,285.22	
BALL CORP	29,987	90.42	2,711,424.54	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	132.54	1,464,964.62	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	44.99	858,004.29	
CORTEVA INC	70,180	43.53	3,054,935.40	
CROWN HOLDINGS INC	12,992	93.78	1,218,389.76	
DOW INC	70,527	57.55	4,058,828.85	
DUPONT DE NEMOURS INC	66,759	84.46	5,638,465.14	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,641	104.87	1,325,661.67	
ECOLAB INC	24,220	215.91	5,229,340.20	
FMC CORP	12,118	116.57	1,412,595.26	
FREEPORT-MCMORAN INC	131,437	31.71	4,167,867.27	
INT'L PAPER CO	33,803	50.38	1,702,995.14	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,504	120.34	903,031.36	
LINDE PLC	48,902	259.04	12,667,574.08	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	93.82	2,393,629.66	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	307.00	1,836,167.00	
MOSAIC CO/THE	31,911	28.71	916,164.81	
NEWMONT CORPORATION	76,214	61.85	4,713,835.90	
NUCOR CORP	29,015	55.88	1,621,358.20	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	139.68	1,241,755.20	
PPG INDUSTRIES INC	22,118	145.04	3,207,994.72	
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	86.93	1,080,539.90	
SEALED AIR CORP	14,689	43.22	634,858.58	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,457	725.61	5,410,873.77	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	39.73	725,986.29	
VULCAN MATERIALS CO	12,657	158.86	2,010,691.02	
WESTROCK CO	24,734	44.66	1,104,620.44	
3 M COMPANY	52,789	169.12	8,927,675.68	
ALLEGION PLC	8,963	114.71	1,028,145.73	
AMETEK INC	21,397	118.95	2,545,173.15	

BOEING CO	49,192	210.71	10,365,246.32	
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	40.37	3,049,993.87	
CATERPILLAR	49,638	194.06	9,632,750.28	
CUMMINS INC	13,804	238.36	3,290,321.44	
DEERE&CO	27,240	294.99	8,035,527.60	
DOVER CORP	13,872	125.51	1,741,074.72	
EATON CORP	37,842	125.50	4,749,171.00	
EMERSON ELECTRIC CO	56,530	83.43	4,716,297.90	
FASTENAL CO	51,828	50.42	2,613,167.76	
FORTIVE CORP	28,503	70.38	2,006,041.14	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	88.52	1,133,941.20	
GENERAC HOLDINGS INC	5,800	267.46	1,551,268.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,742	153.13	3,482,482.46	
GENERAL ELECTRIC CO	802,115	11.43	9,168,174.45	
GRAINGER (WW) INC	4,351	394.49	1,716,425.99	
HEICO CORP	3,640	136.01	495,076.40	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	119.25	769,043.25	
HONEYWELL INTL INC	64,514	206.76	13,338,914.64	
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	27.75	1,014,262.50	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	170.57	600,747.54	
IDEX CORP	6,916	193.43	1,337,761.88	
ILLINOIS TOOL WORKS	29,811	204.81	6,105,590.91	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	46.29	1,461,004.98	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	111.69	1,343,183.94	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	56.00	1,125,600.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	26.60	545,300.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	69,045	51.63	3,564,793.35	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	20,431	190.10	3,883,933.10	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	281.80	862,871.60	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,532	341.50	8,036,178.00	
MASCO CORP	23,467	56.40	1,323,538.80	
NORDSON CORP	4,880	189.50	924,760.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,956	298.02	4,457,187.12	
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	65.37	2,452,617.03	
OWENS CORNING	10,458	84.45	883,178.10	
PACCAR INC	32,395	89.21	2,889,957.95	
PARKER HANNIFIN CORP	11,994	288.80	3,463,867.20	
PENTAIR PLC	14,533	58.46	849,599.18	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	142,554	69.36	9,887,545.44	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,811	261.00	2,821,671.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,876	414.43	4,092,910.68	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	55.33	765,103.24	

SMITH (A.O.) CORP	12,146	57.20	694,751.20	
SNAP-ON INC	4,900	172.47	845,103.00	
STANLEY BLACK&DECKER	14,654	176.56	2,587,310.24	
SUNRUN INC	11,100	85.62	950,382.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	387.22	1,355,657.22	
TEXTRON	21,534	49.37	1,063,133.58	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,896	153.49	3,360,817.04	
TRANSDIGM GROUP INC	4,801	573.41	2,752,941.41	
UNITED RENTALS INC	6,643	260.83	1,732,693.69	
WABTEC CORP	17,764	81.63	1,450,075.32	
XYLEM INC	16,718	104.26	1,743,018.68	
CINTAS CORP	8,272	322.04	2,663,914.88	
COPART INC	19,784	116.09	2,296,724.56	
COSTAR GROUP INC	3,673	871.97	3,202,745.81	
EQUIFAX INC	11,579	176.02	2,038,135.58	
IHS MARKIT LTD	35,672	87.49	3,120,943.28	
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	94.67	1,894,062.69	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	64.20	614,137.20	
ROLLINS INC	21,849	36.86	805,354.14	
TRANSUNION	17,091	91.37	1,561,604.67	
VERISK ANALYTICS INC	14,560	191.37	2,786,347.20	
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	102.50	2,524,472.50	
WASTE MANAGEMENT INC	39,877	115.01	4,586,253.77	
AMERCO	1,000	470.08	470,080.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	96.44	1,271,657.84	
CSX CORP	69,822	92.66	6,469,706.52	
DELTA AIR LINES INC	14,609	40.31	588,888.79	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	93.06	1,476,676.08	
FEDEX CORP	23,427	249.52	5,845,505.04	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	148.52	1,235,537.88	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,711	211.66	1,843,770.26	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	43.69	467,483.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,841	249.84	5,956,435.44	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,013	207.51	1,870,287.63	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	46.91	634,833.03	
UBER TECHNOLOGIES INC	90,030	56.30	5,068,689.00	
UNION PACIFIC CORP	62,386	215.28	13,430,458.08	
UNITED PARCEL SERVICE B	64,871	156.28	10,138,039.88	
XPO LOGISTICS INC	8,001	121.07	968,681.07	
APTIV PLC	25,180	142.57	3,589,912.60	
AUTOLIV INC	6,776	88.89	602,318.64	
BORGWARNER INC	23,790	39.30	934,947.00	

FORD MOTOR COMPANY	370,912	10.02	3,716,538.24	
GENERAL MOTORS CO	119,364	54.84	6,545,921.76	
LEAR CORP	5,287	163.05	862,045.35	
TESLA INC	68,987	844.55	58,262,970.85	
DR HORTON INC	32,171	71.31	2,294,114.01	
GARMIN LTD	12,854	122.69	1,577,057.26	
HASBRO INC	12,468	96.29	1,200,543.72	
LENNAR CORP-CL A	24,928	78.24	1,950,366.72	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,527	342.25	3,945,115.75	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	148.90	753,731.80	
NEWELL BRANDS INC	37,563	24.21	909,400.23	
NIKE B	114,558	139.27	15,954,492.66	
NVR INC	337	4,160.00	1,401,920.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	18,478	150.14	2,774,286.92	
PULTE GROUP INC	24,818	44.01	1,092,240.18	
VF CORP	31,438	81.95	2,576,344.10	
WHIRLPOOL CORP	6,079	198.71	1,207,958.09	
ARAMARK	20,955	36.19	758,361.45	
CARNIVAL CORPORATION	48,520	20.87	1,012,612.40	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,444	1,429.48	3,493,649.12	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,063	124.12	1,497,259.56	
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	372.65	1,386,630.65	
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	51.29	803,919.46	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,491	107.93	2,751,243.63	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	54.45	1,802,295.00	
MARRIOTT INTL A	26,161	126.86	3,318,784.46	
MCDONALD'S CORP	68,423	209.09	14,306,565.07	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	16.25	287,007.50	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,847	30.53	1,247,058.91	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,923	73.48	1,243,502.04	
STARBUCKS CORP	107,310	102.54	11,003,567.40	
VAIL RESORTS INC	3,574	272.00	972,128.00	
WYNN RESORTS LTD	9,302	107.17	996,895.34	
YUM BRANDS INC	28,107	107.39	3,018,410.73	
ACTIVISION BLIZZARD INC	72,713	93.15	6,773,215.95	
ALPHABET INC-CL A	27,749	1,784.47	49,517,258.03	
ALPHABET INC-CL C	27,824	1,790.86	49,828,888.64	
ALTICE USA INC- A	22,505	36.61	823,908.05	
CABLE ONE INC	445	2,000.10	890,044.50	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,415	633.27	8,495,317.05	
COMCAST CORP-CL A	420,027	48.84	20,516,218.81	
DISCOVERY INC - A	12,804	36.15	462,864.60	

DISCOVERY INC-C	28,190	31.85	897,851.50	
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	32.69	787,927.07	
ELECTRONIC ARTS INC	26,822	141.43	3,793,435.46	
FACEBOOK INC-A	222,710	261.10	58,149,581.00	
FOX CORP - CLASS A	33,968	30.01	1,019,379.68	
FOX CORP- CLASS B	15,092	29.17	440,233.64	
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	199.21	1,558,021.41	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	24.93	843,481.62	
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	150.52	388,191.08	
LIBERTY BROADBAND-C	15,001	151.37	2,270,701.37	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	40.36	754,449.48	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	40.75	703,508.00	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	40.94	261,360.96	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	76.54	1,064,518.32	
MATCH GROUP INC	23,371	146.14	3,415,437.94	
NETFLIX INC	40,623	501.77	20,383,402.71	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	18.75	627,731.25	
OMNICOM GROUP	20,835	63.10	1,314,688.50	
PINTEREST INC- CLASS A	43,140	71.01	3,063,371.40	
ROKU INC	9,741	434.14	4,228,957.74	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	5.95	592,310.60	
SNAP INC - A	84,912	50.39	4,278,715.68	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	10,751	198.73	2,136,546.23	
THE WALT DISNEY CO	166,695	172.26	28,714,880.70	
TWITTER INC	73,800	45.93	3,389,634.00	
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	43.75	2,361,450.00	
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	149.98	824,440.06	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	143.97	1,933,085.19	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	165.93	1,026,442.98	
AMAZON.COM	39,459	3,120.76	123,142,068.84	
AUTOZONE INC	2,216	1,238.29	2,744,050.64	
BEST BUY COMPANY INC	21,659	111.62	2,417,577.58	
BOOKING HOLDINGS INC	3,749	2,163.04	8,109,236.96	
BURLINGTON STORES INC	5,808	252.06	1,463,964.48	
CARMAX INC	15,563	116.43	1,812,000.09	
CARVANA CO	5,700	275.00	1,567,500.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	107.32	738,146.96	
DOLLAR GENERAL CORP	23,266	206.06	4,794,191.96	
DOLLAR TREE INC	22,651	108.05	2,447,440.55	
EBAY	66,540	56.98	3,791,449.20	
ETSY INC	11,000	221.31	2,434,410.00	
EXPEDIA GROUP INC	13,028	142.82	1,860,658.96	

GENUINE PARTS CO	13,937	99.55	1,387,428.35	
HOME DEPOT	99,257	273.19	27,116,019.83	
LKQ CORP	26,705	37.15	992,090.75	
LOWES COMPANIES	69,373	170.76	11,846,133.48	
MERCADOLIBRE INC	4,182	1,913.21	8,001,044.22	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,031	463.94	3,261,962.14	
POOL CORP	3,700	360.63	1,334,331.00	
ROSS STORES INC	33,683	113.98	3,839,188.34	
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,844	188.16	8,626,007.04	
TJX COMPANIES INC	109,668	67.18	7,367,496.24	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	157.45	1,765,329.40	
ULTA BEAUTY INC	5,150	293.17	1,509,825.50	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	299.85	1,799,100.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	40,605	354.47	14,393,254.35	
KROGER CO	71,185	33.62	2,393,239.70	
SYSCO CORP	45,437	74.87	3,401,868.19	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,566	48.15	3,253,302.90	
WALMART INC	130,402	143.39	18,698,342.78	
ALTRIA GROUP INC	169,814	41.23	7,001,431.22	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	53.10	2,771,235.90	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	74.23	2,153,412.30	
BUNGE LIMITED	13,606	70.65	961,263.90	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	46.38	736,004.22	
COCA-COLA CO	375,807	48.51	18,230,397.57	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	19,221	48.06	923,761.26	
CONAGRA BRANDS INC	45,992	33.63	1,546,710.96	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,911	222.91	3,546,721.01	
GENERAL MILLS INC	57,002	55.67	3,173,301.34	
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	148.75	2,067,030.00	
HORMEL FOODS CORP	27,157	44.75	1,215,275.75	
JM SMUCKER CO	10,802	115.65	1,249,251.30	
KELLOGG CO	24,092	58.46	1,408,418.32	
KEURIG DR PEPPER INC	52,280	31.82	1,663,549.60	
KRAFT HEINZ CO/THE	62,572	32.36	2,024,829.92	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	77.09	996,311.16	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	23,514	93.01	2,187,037.14	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	52.03	947,102.09	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	130,630	57.14	7,464,198.20	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,118	90.08	3,343,589.44	
PEPSICO INC	127,491	142.06	18,111,371.46	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	143,013	81.90	11,712,764.70	
TYSON FOODS INC	28,214	63.90	1,802,874.60	

CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	85.16	1,997,342.64	
CLOROX COMPANY	11,960	196.51	2,350,259.60	
COLGATE-PALMOLIVE CO	76,780	80.85	6,207,663.00	
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,239	248.44	5,276,617.16	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,173	131.65	4,235,575.45	
PROCTER & GAMBLE CO	229,708	133.60	30,688,988.80	
ABBOTT LABORATORIES	163,008	112.57	18,349,810.56	
ABIOMED INC	4,421	336.30	1,486,782.30	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	557.41	3,964,857.33	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	103.50	1,511,514.00	
ANTHEM INC	23,516	323.69	7,611,894.04	
BAXTER INTERNATIONAL	47,484	78.83	3,743,163.72	
BECTON DICKINSON & CO	26,472	260.77	6,903,103.44	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	134,860	36.27	4,891,372.20	
CARDINAL HEALTH	27,968	54.81	1,532,926.08	
CENTENE CORP	54,883	62.79	3,446,103.57	
CERNER CORP	27,382	79.51	2,177,142.82	
CIGNA CORP	34,332	220.80	7,580,505.60	
CVS HEALTH CORP	119,869	75.40	9,038,122.60	
DANAHER CORP	58,694	236.11	13,858,240.34	
DAVITA INC	7,259	118.10	857,287.90	
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	58.32	1,177,364.16	
DEXCOM INC	8,925	357.64	3,191,937.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	58,536	87.91	5,145,899.76	
HCA HEALTHCARE INC	25,577	166.10	4,248,339.70	
HENRY SCHEIN INC	14,096	70.43	992,781.28	
HOLOGIC INC	24,459	75.99	1,858,639.41	
HUMANA INC	12,486	407.31	5,085,672.66	
IDEXX LABORATORIES INC	7,938	484.93	3,849,374.34	
INSULET CORP	5,923	284.46	1,684,856.58	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,710	778.41	8,336,771.10	
LABORATORY CRP OF AMER	9,014	225.74	2,034,820.36	
MASIMO CORP	4,835	261.00	1,261,935.00	
MCKESSON CORP	15,393	182.47	2,808,760.71	
MEDTRONIC PLC	123,534	118.31	14,615,307.54	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,724	219.10	1,254,128.40	
NOVOCURE LTD	7,933	168.28	1,334,965.24	
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	125.99	1,624,515.06	
RESMED INC	13,491	214.90	2,899,215.90	
STERIS PLC	8,111	188.71	1,530,626.81	
STRYKER CORP	30,913	242.07	7,483,109.91	
TELADOC HEALTH INC	11,015	232.72	2,563,410.80	

TELEFLEX INC	4,427	385.83	1,708,069.41	
THE COOPER COS INC	5,096	387.42	1,974,292.32	
UNITEDHEALTH GROUP INC	87,674	352.19	30,877,906.06	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	130.40	945,139.20	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	175.75	1,447,652.75	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,595	278.05	3,502,039.75	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,017	300.12	2,105,942.04	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,627	159.93	3,138,946.11	
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	182.22	1,030,454.10	
ABBVIE INC	162,450	112.18	18,223,641.00	
AGILENT TECHNOLOGIES	29,371	127.35	3,740,396.85	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	158.71	3,289,423.46	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	168.41	1,796,092.65	
AMGEN	53,803	248.27	13,357,670.81	
AVANTOR INC	47,985	29.69	1,424,674.65	
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	608.97	1,303,804.77	
BIOGEN INC	14,678	273.84	4,019,423.52	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	85.77	1,472,756.67	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	207,110	66.74	13,822,521.40	
CATALENT INC	15,232	119.83	1,825,250.56	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	31.16	1,123,660.76	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	148.83	2,196,135.48	
GILEAD SCIENCES INC	114,575	67.07	7,684,545.25	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	20,300	81.20	1,648,360.00	
ILLUMINA INC	13,485	390.21	5,261,981.85	
INCYTE CORP	17,504	93.96	1,644,675.84	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	61.03	782,221.51	
IQVIA HOLDINGS INC	17,736	188.97	3,351,571.92	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	167.00	830,157.00	
JOHNSON & JOHNSON	243,037	162.78	39,561,562.86	
LILLY (ELI) & CO	79,105	198.48	15,700,760.40	
MERCK & CO	232,937	83.19	19,378,029.03	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	1,231.16	2,783,652.76	
MODERNA INC	25,034	125.01	3,129,500.34	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	108.78	921,801.72	
PERKINELMER INC	10,645	149.29	1,589,192.05	
PERRIGO CO PLC	13,392	43.47	582,150.24	
PFIZER	511,745	36.73	18,796,393.85	
PPD INC	11,027	35.94	396,365.51	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,766	533.89	5,213,969.74	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	10,323	51.85	535,247.55	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	96.80	691,829.60	

SEAGEN INC	11,471	188.78	2,165,495.38	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	12.55	1,361,474.20	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	36,418	507.38	18,477,764.84	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,454	231.91	5,671,127.14	
VIATRIS INC	114,289	17.44	1,993,200.16	
WATERS CORP	5,957	271.82	1,619,231.74	
ZOETIS INC	43,425	162.57	7,059,602.25	
BANK OF AMERICA CORP	718,715	32.77	23,552,290.55	
CITIGROUP	191,267	63.69	12,181,795.23	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	40.83	1,633,608.30	
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	32.07	2,178,867.87	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	155.00	2,460,160.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	14.88	1,473,298.56	
JPMORGAN CHASE & CO	281,291	138.04	38,829,409.64	
KEY CORP	94,322	18.55	1,749,673.10	
M & T BANK CORP	11,721	146.20	1,713,610.20	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,092	156.00	6,254,352.00	
REGIONS FINL CORP	92,434	18.42	1,702,634.28	
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	470.66	2,326,472.38	
TRUIST FINANCIAL CORP	122,915	52.15	6,410,017.25	
US BANCORP	123,631	48.07	5,942,942.17	
WELLS FARGO & CO	359,439	32.63	11,728,494.57	
ALLY FINANCIAL INC	36,028	41.28	1,487,235.84	
AMERICAN EXPRESS	62,596	126.75	7,934,043.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,195	212.99	2,384,423.05	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	48.19	730,223.07	
BANK NEW YORK CO	73,913	45.82	3,386,693.66	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	129,273	234.55	30,320,982.15	
BLACKROCK INC	13,986	733.65	10,260,828.90	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,438	64.41	4,021,631.58	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,052	112.86	4,745,988.72	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	34.28	431,756.60	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	97.45	1,034,139.40	
CME GROUP INC	32,725	192.20	6,289,745.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	99.07	2,744,635.28	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	27.71	1,114,357.65	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	319.35	1,160,198.55	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	27.14	707,539.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,929	294.20	8,805,111.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	50,736	114.88	5,828,551.68	
INVESCO LTD	35,765	20.25	724,241.25	
KKR & CO INC	47,403	40.97	1,942,100.91	

MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	515.89	1,853,592.77	
MOODY'S CORP	15,637	269.29	4,210,887.73	
MORGAN STANLEY	127,048	74.99	9,527,329.52	
MSCI INC	7,815	411.48	3,215,716.20	
NASDAQ INC	10,979	142.26	1,561,872.54	
NORTHERN TRUST CORP	17,625	97.36	1,715,970.00	
PRICE T ROWE GROUP INC	21,597	158.48	3,422,692.56	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	103.86	1,242,996.48	
S&P GLOBAL INC	22,021	313.14	6,895,655.94	
SCHWAB (CHARLES) CORP	143,656	59.23	8,508,744.88	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	60.22	738,357.42	
STATE STREET CORP	31,754	78.40	2,489,513.60	
SYNCHRONY FINANCIAL	46,378	39.70	1,841,206.60	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	65.65	594,854.65	
VOYA FINANCIAL INC	12,505	59.92	749,299.60	
AFLAC	62,907	47.05	2,959,774.35	
ALLEGHANY CORP	1,276	601.21	767,143.96	
ALLSTATE CORP	29,185	110.27	3,218,229.95	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	87.82	554,934.58	
AMERICAN INT'L GROUP	80,357	42.25	3,395,083.25	
AON PLC	21,468	209.16	4,490,246.88	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	34.18	1,326,047.28	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	117.40	2,093,594.20	
ASSURANT INC	5,819	142.98	832,000.62	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	44.66	455,844.62	
BROWN & BROWN INC	22,945	46.73	1,072,219.85	
CHUBB LTD	41,192	155.36	6,399,589.12	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	93.77	1,392,578.27	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	242.41	525,060.06	
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	232.74	913,737.24	
FNF GROUP	24,961	39.34	981,965.74	
GLOBE LIFE INC	9,867	96.88	955,914.96	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	52.66	1,815,769.46	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	52.61	860,910.04	
LOEWS CORP	23,338	47.56	1,109,955.28	
MARKEL CORP	1,312	1,002.10	1,314,755.20	
MARSH & MCLENNAN COS	47,332	112.22	5,311,597.04	
METLIFE INC	73,194	52.12	3,814,871.28	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	54.32	1,445,726.80	
PROGRESSIVE CORP	55,260	96.19	5,315,459.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,511	84.86	3,183,183.46	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	112.87	750,811.24	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	159.25	774,592.00	
TRAVELERS COS INC/THE	23,997	143.51	3,443,809.47	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	208.50	2,505,336.00	
WR BERKLEY CORP	14,085	65.62	924,257.70	
CBRE GROUP INC-A	30,111	63.61	1,915,360.71	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.62	455,994.00	
WEYERHAEUSER CO	69,607	32.70	2,276,148.90	
ACCENTURE PLC-CL A	58,521	255.84	14,972,012.64	
ADOBE INC	44,184	456.50	20,169,996.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	15,447	110.01	1,699,324.47	
ANSYS INC	8,044	369.51	2,972,338.44	
AUTODESK INC	19,987	310.97	6,215,357.39	
AUTOMATIC DATA PROCESS	39,257	161.98	6,358,848.86	
AVALARA INC	7,698	161.52	1,243,380.96	
BLACK KNIGHT INC	14,413	85.79	1,236,491.27	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	93.90	1,261,828.20	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	151.56	1,662,764.76	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,500	137.62	3,646,930.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	101.96	1,253,700.16	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	127.63	1,338,328.18	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	135.36	1,413,699.84	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,249	81.44	1,160,438.56	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	51,182	79.76	4,082,276.32	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	333.92	2,023,221.28	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,367	221.92	2,966,404.64	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	164.07	508,617.00	
DATADOG INC - CLASS A	14,078	99.09	1,394,989.02	
DOCUSIGN INC	16,480	256.57	4,228,273.60	
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	21.77	627,955.65	
DYNATRACE INC	17,890	43.80	783,582.00	
EPAM SYSTEMS INC	5,266	351.41	1,850,525.06	
FAIR ISAAC CORP	2,615	483.72	1,264,927.80	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	58,208	128.06	7,454,116.48	
FISERV INC	53,732	107.67	5,785,324.44	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,994	266.78	2,132,639.32	
FORTINET INC	12,295	148.21	1,822,241.95	
GARTNER INC	8,569	159.44	1,366,241.36	
GLOBAL PAYMENTS INC	27,817	187.75	5,222,641.75	
GODADDY INC - CLASS A	15,914	80.41	1,279,644.74	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	126.15	999,486.45	
HUBSPOT INC	4,000	388.48	1,553,920.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	81,713	129.02	10,542,611.26	

INTUIT INC	23,876	384.95	9,191,066.20	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	155.81	1,146,761.60	
LEIDOS HOLDINGS	12,829	109.09	1,399,515.61	
MASTERCARD INC-CLASS A	82,388	325.94	26,853,544.72	
MICROSOFT CORP	666,040	216.44	144,157,697.60	
MONGODB INC	4,623	368.00	1,701,264.00	
NORTONLIFELOCK INC	50,376	20.78	1,046,813.28	
OKTA INC	11,056	260.84	2,883,847.04	
ORACLE CORP	183,141	61.29	11,224,711.89	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,991	364.05	3,273,173.55	
PAYCHEX INC	30,214	88.34	2,669,104.76	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	397.33	1,889,304.15	
PAYPAL HOLDINGS INC	102,806	247.25	25,418,783.50	
PTC INC	9,984	125.55	1,253,491.20	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,982	372.94	2,603,867.08	
SALESFORCE.COM INC	83,779	216.76	18,159,936.04	
SERVICENOW INC	17,969	519.42	9,333,457.98	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	37,111	42.07	1,561,259.77	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,750	286.21	787,077.50	
SPLUNK INC	14,752	172.96	2,551,505.92	
SQUARE INC - A	34,717	227.26	7,889,785.42	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	67.00	1,458,925.00	
SYNOPSYS INC	14,302	268.20	3,835,796.40	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,893	780.62	3,038,953.66	
TWILIO INC - A	12,183	382.25	4,656,951.75	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	423.61	1,572,863.93	
VERISIGN INC	9,910	197.08	1,953,062.80	
VISA INC-CLASS A SHARES	155,572	201.66	31,372,649.52	
VMWARE INC-CLASS A	7,867	132.30	1,040,804.10	
WESTERN UNION CO	38,757	22.37	866,994.09	
WIX.COM LTD	5,010	249.84	1,251,698.40	
WORKDAY INC-CLASS A	16,479	221.04	3,642,518.16	
ZENDESK INC	10,500	145.73	1,530,165.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,175	393.87	6,370,847.25	
ZSCALER INC	6,234	212.00	1,321,608.00	
AMPHENOL CORPORATION	27,456	132.35	3,633,801.60	
APPLE INC	1,584,657	127.83	202,566,704.31	
ARISTA NETWORKS INC	5,179	317.96	1,646,714.84	
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	105.38	826,073.82	
CDW CORP/DE	13,742	132.97	1,827,273.74	
CISCO SYSTEMS	388,672	45.19	17,564,087.68	
COGNEX CORP	16,230	85.39	1,385,879.70	

CORNING	72,399	38.53	2,789,533.47	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	74.86	1,611,735.80	
F5 NETWORKS INC	5,350	196.80	1,052,880.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	12.31	1,523,719.49	
HP INC	135,773	25.14	3,413,333.22	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	258.58	829,266.06	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	24.51	767,261.04	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	147.07	2,591,961.68	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,158	171.77	2,775,459.66	
NETAPP INC	20,586	64.28	1,323,268.08	
SEAGATE TECHNOLOGY	21,474	61.22	1,314,638.28	
TE CONNECTIVITY LTD	31,267	129.52	4,049,701.84	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	69.19	1,652,533.96	
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	51.99	1,479,323.46	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	405.84	2,094,946.08	
AT&T INC	656,261	28.95	18,998,755.95	
CENTURYLINK INC	86,131	11.06	952,608.86	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	24.76	384,176.16	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	24.41	822,128.80	
T-MOBILE US INC	52,073	129.85	6,761,679.05	
VERIZON COMMUNICATIONS	381,375	57.05	21,757,443.75	
AES CORP	61,761	28.06	1,733,013.66	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	49.63	1,198,862.28	
AMEREN CORPORATION	23,120	72.99	1,687,528.80	
AMERICAN ELECTRIC POWER	46,898	80.71	3,785,137.58	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	159.27	2,695,166.94	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	90.08	1,028,623.52	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	21.69	1,044,633.78	
CMS ENERGY CORP	26,742	58.25	1,557,721.50	
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	69.48	2,205,642.60	
DOMINION ENERGY INC	79,161	70.96	5,617,264.56	
DTE ENERGY COMPANY	18,360	120.88	2,219,356.80	
DUKE ENERGY CORP	69,344	90.38	6,267,310.72	
EDISON INTL	35,217	60.87	2,143,658.79	
ENTERGY CORP	18,696	95.12	1,778,363.52	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	46.80	975,031.20	
EVERGY INC	21,330	53.38	1,138,595.40	
EVERSOURCE ENERGY	31,946	87.14	2,783,774.44	
EXELON CORP	92,303	42.82	3,952,414.46	
FIRSTENERGY CORP	50,559	31.11	1,572,890.49	
NEXTERA ENERGY INC	180,088	82.81	14,913,087.28	
NISOURCE INC	35,781	22.46	803,641.26	

	NRG ENERGY INC	23,078	41.23	951,505.94	
	OGE ENERGY CORP	19,225	31.09	597,705.25	
	PG&E CORP	135,327	12.03	1,627,983.81	
	PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	78.00	840,216.00	
	PPL CORPORATION	69,904	28.14	1,967,098.56	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	58.18	2,751,332.20	
	SEMPRA ENERGY	27,061	121.48	3,287,370.28	
	SOUTHERN CO	99,701	61.06	6,087,743.06	
	UGI CORP	18,019	37.29	671,928.51	
	VISTRA CORP	37,797	21.71	820,572.87	
	WEC ENERGY GROUP INC	29,921	87.87	2,629,158.27	
	XCEL ENERGY INC	49,733	64.71	3,218,222.43	
	ADVANCED MICRO DEVICES	107,648	89.45	9,629,113.60	
	ANALOG DEVICES	34,849	160.54	5,594,658.46	
	APPLIED MATERIALS	85,384	109.22	9,325,640.48	
	BROADCOM INC	36,996	459.27	16,991,152.92	
	ENPHASE ENERGY INC	11,000	201.28	2,214,080.00	
	INTEL CORP	391,768	57.99	22,718,626.32	
	KLA CORP	14,509	314.08	4,556,986.72	
	LAM RESEARCH CORP	13,726	580.02	7,961,354.52	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	61,408	53.81	3,304,364.48	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,481	96.90	2,469,108.90	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,545	153.25	3,608,271.25	
	MICRON TECHNOLOGY	101,644	85.50	8,690,562.00	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,953	391.32	1,546,887.96	
	NVIDIA CORP	56,906	521.01	29,648,595.06	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,742	175.00	4,504,850.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	38.52	1,386,565.92	
	QORVO INC	10,609	185.67	1,969,773.03	
	QUALCOMM	103,805	163.77	17,000,144.85	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,879	161.39	2,562,711.81	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	295.05	1,357,230.00	
	TERADYNE INC	16,048	140.63	2,256,830.24	
	TEXAS INSTRUMENTS	84,205	174.19	14,667,668.95	
	XILINX INC	22,786	139.36	3,175,456.96	
アメリカドル 小計		28,992,814		3,117,905,899.07 (324,043,960,090)	
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	16.46	675,880.52	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	110,776	31.58	3,498,306.08	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	7.89	762,694.74	
	ENBRIDGE	189,816	44.75	8,494,266.00	
	IMPERIAL OIL	24,763	26.95	667,362.85	

INTER PIPELINE LTD	35,455	13.47	477,578.85	
KEYERA CORP	18,607	26.70	496,806.90	
PARKLAND CORP	14,075	41.01	577,215.75	
PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	36.04	1,939,528.64	
SUNCOR ENERGY	143,061	23.24	3,324,737.64	
TC ENERGY CORP	86,686	56.57	4,903,827.02	
AGNICO EAGLE MINES	23,423	87.23	2,043,188.29	
B2GOLD CORP	90,243	6.43	580,262.49	
BARRICK GOLD CORP	160,886	29.81	4,796,011.66	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	61.08	802,530.12	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	24.19	1,330,450.00	
FRANCO-NEVADA CORP	16,953	154.49	2,619,068.97	
KINROSS GOLD CORP	125,340	8.90	1,115,526.00	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	51.21	1,199,747.88	
LUNDIN MINING CORP	62,243	11.96	744,426.28	
NUTRIEN LTD	53,796	68.04	3,660,279.84	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	37.60	692,253.60	
SSR MINING INC	21,000	21.66	454,860.00	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	26.68	1,218,662.36	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	51.32	2,028,576.96	
YAMANA GOLD INC	81,672	6.52	532,501.44	
CAE INC	25,999	32.12	835,087.88	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	88.88	684,820.40	
WSP GLOBAL INC	10,656	120.95	1,288,843.20	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	17,694	40.12	709,883.28	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	79.18	811,199.10	
THOMSON REUTERS CORP	16,323	102.50	1,673,107.50	
AIR CANADA	13,805	23.05	318,205.25	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,531	139.84	9,303,695.04	
CP RAILWAY LIMITED	12,707	447.27	5,683,459.89	
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,630	92.27	2,457,150.10	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,923	34.95	731,258.85	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	27,031	78.68	2,126,799.08	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.18	458,736.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	22.29	1,004,989.23	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	173.73	939,705.57	
DOLLARAMA INC	26,700	51.24	1,368,108.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	80,583	37.50	3,021,862.50	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	35.83	546,514.99	
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	63.66	1,139,959.62	
METRO INC	24,937	58.05	1,447,592.85	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	95.42	656,775.86	

	SAPUTO INC	24,489	35.81	876,951.09	
	BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	34.89	969,942.00	
	CANOPY GROWTH CORP	20,989	42.73	896,859.97	
	BANK MONTREAL	60,260	100.50	6,056,130.00	
	BANK NOVA SCOTIA	112,518	70.76	7,961,773.68	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	41,820	113.48	4,745,733.60	
	NATIONAL BANK OF CANADA	31,503	73.37	2,311,375.11	
	ROYAL BANK OF CANADA	130,610	107.80	14,079,758.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	165,297	74.98	12,393,969.06	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	120,428	48.75	5,870,865.00	
	CI FINANCIAL CORP	18,671	16.37	305,644.27	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	35.04	269,282.40	
	ONEX CORP	6,603	71.40	471,454.20	
	TMX GROUP LTD	4,685	123.20	577,192.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	484.88	1,291,235.44	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.22	742,661.36	
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	58.86	594,427.14	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	143.35	1,869,714.05	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	178,574	24.59	4,391,134.66	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	31.12	1,604,267.12	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	54,852	61.34	3,364,621.68	
	FIRSTSERVICE CORP	3,690	176.87	652,650.30	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	15.69	618,186.00	
	CGI INC - CL A	21,626	100.20	2,166,925.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,845	1,639.15	3,024,231.75	
	OPEN TEXT CORP	24,643	59.42	1,464,287.06	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,924	1,494.39	14,830,326.36	
	BCE INC	15,355	55.27	848,670.85	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	33,271	60.26	2,004,910.46	
	TELUS CORP	32,908	26.52	872,720.16	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	21.47	1,112,532.46	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	20.21	493,022.95	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	37.86	198,424.26	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	75.91	857,403.45	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.34	333,878.16	
	EMERA INC	23,704	53.13	1,259,393.52	
	FORTIS INC	42,633	52.24	2,227,147.92	
	HYDRO ONE LTD	32,299	29.17	942,161.83	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	47.04	839,852.16	
カナダドル 小計		3,649,883		193,236,021.75 (15,785,450,616)	
ユーロ	ENI	238,629	8.82	2,106,378.18	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	9.22	453,863.84	
NESTE OIL OYJ	37,233	60.86	2,266,000.38	
OMV AG	14,984	37.14	556,505.76	
REPSOL SA	140,401	8.63	1,211,941.43	
REPSOL SA-RTS	140,401	0.30	43,383.90	
TENARIS SA	40,648	6.75	274,374.00	
TOTAL SE	230,788	37.15	8,573,774.20	
VOPAK	6,360	42.08	267,628.80	
AIR LIQUIDE	43,107	132.35	5,705,211.45	
AKZO NOBEL	18,109	87.34	1,581,640.06	
ARCELORMITTAL	66,229	19.20	1,271,861.71	
ARKEMA	5,949	95.56	568,486.44	
BASF SE	85,260	66.59	5,677,463.40	
COVESTRO AG	17,254	54.90	947,244.60	
CRH PLC	72,257	36.79	2,658,335.03	
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	26.77	528,814.58	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	48.16	277,497.92	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	65.68	856,532.88	
KONINKLIJKE DSM NV	16,167	143.60	2,321,581.20	
LANXESS	7,293	64.12	467,627.16	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	23,039	40.22	926,628.58	
SOLVAY SA	6,906	99.10	684,384.60	
STORA ENSO OYJ R	54,792	15.97	875,302.20	
SYMRISE AG	11,456	101.00	1,157,056.00	
UMICORE	17,605	46.00	809,830.00	
UPM KYMMENE OYJ	50,623	30.61	1,549,570.03	
VOESTALPINE AG	12,422	31.30	388,808.60	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,394	28.95	677,256.30	
AIRBUS SE	55,117	91.30	5,032,182.10	
ALSTOM	24,388	48.46	1,181,842.48	
BOUYGUES ORD	21,446	35.09	752,540.14	
BRENNTAG AG	15,254	66.98	1,021,712.92	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	11.24	1,045,612.24	
DASSAULT AVIATION SA	213	905.00	192,765.00	
EIFFAGE	7,964	80.68	642,535.52	
FERROVIAL SA	47,178	20.98	989,794.44	
GEA GROUP AG	13,382	29.58	395,839.56	
HOCHTIEF AG	2,222	86.80	192,869.60	
KINGSPAN GROUP PLC	14,482	63.90	925,399.80	
KION GROUP AG	5,887	73.06	430,104.22	
KNORR-BREMSE AG	6,822	113.12	771,704.64	
KONE OYJ-B	31,881	64.86	2,067,801.66	

LEGRAND SA	24,584	79.66	1,958,361.44	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	213.30	1,013,814.90	
PRYSMIAN SPA	21,155	28.39	600,590.45	
RATIONAL AG	483	790.00	381,570.00	
SAFRAN SA	30,040	113.25	3,402,030.00	
SAINT-GOBAIN	48,543	42.71	2,073,271.53	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,078	122.65	6,019,416.70	
SIEMENS	70,353	121.22	8,528,190.66	
SIEMENS ENERGY AG	36,181	31.50	1,139,701.50	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	34.98	784,776.30	
THALES SA	9,665	75.60	730,674.00	
VINCI S.A.	46,981	84.84	3,985,868.04	
WARTSILA OYJ	41,917	9.00	377,504.50	
BUREAU VERITAS SA	25,073	22.76	570,661.48	
RANDSTAD NV	11,218	54.76	614,297.68	
TELEPERFORMANCE	5,513	285.60	1,574,512.80	
WOLTERS KLUWER	25,709	70.02	1,800,144.18	
ADP	2,382	95.00	226,290.00	
AENA SME SA	6,542	135.90	889,057.80	
ATLANTIA SPA	46,597	13.73	639,776.81	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	10.43	242,843.32	
DEUTSCHE POST AG-REG	92,734	42.91	3,979,215.94	
GETLINK	44,101	13.56	598,009.56	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,054	68.34	2,122,230.36	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	51.60	257,535.60	
CONTINENTAL AG	9,928	117.75	1,169,022.00	
DAIMLER AG	80,223	55.60	4,460,398.80	
FAURECIA	7,825	42.22	330,371.50	
FERRARI NV	11,824	172.90	2,044,369.60	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	103,437	13.87	1,435,084.93	
MICHELIN	15,924	107.60	1,713,422.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	57.12	801,279.36	
RENAULT SA	17,362	34.18	593,433.16	
STELLANTIS NV	92,122	13.86	1,276,810.92	
VALEO SA	21,538	30.42	655,185.96	
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,404	152.80	2,659,331.20	
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	166.00	539,666.00	
ADIDAS AG	17,675	286.20	5,058,585.00	
ESSILORLUXOTTICA	26,667	123.10	3,282,707.70	
HERMES INTERNATIONAL	2,971	862.40	2,562,190.40	
KERING	7,103	547.90	3,891,733.70	
LVMH	25,522	491.05	12,532,578.10	

MONCLER SPA	18,219	47.65	868,135.35	
PUMA SE	9,220	86.22	794,948.40	
SEB SA	2,075	154.60	320,795.00	
ACCOR	17,931	30.37	544,564.47	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	161.45	2,343,931.10	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	38.06	308,590.48	
SODEXO	8,135	77.90	633,716.50	
BOLLORE	83,646	3.47	290,418.91	
PUBLICIS GROUPE	21,469	43.01	923,381.69	
SCOUT24 AG	9,470	64.65	612,235.50	
SES	31,369	7.51	235,581.19	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	84.30	784,917.30	
VIVENDI	77,307	26.15	2,021,578.05	
DELIVERY HERO SE	12,154	129.85	1,578,196.90	
HELLOFRESH SE	13,805	64.40	889,042.00	
INDITEX	101,980	25.96	2,647,400.80	
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	88.48	1,006,194.56	
PROSUS	45,138	96.46	4,354,011.48	
ZALANDO SE	13,985	93.70	1,310,394.50	
CARREFOUR	59,235	15.00	888,525.00	
COLRUYT SA	5,424	49.86	270,440.64	
JERONIMO MARTINS	24,901	14.52	361,687.02	
KESKO OYJ-B SHS	25,583	21.44	548,499.52	
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	23.88	2,465,944.32	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	69,138	56.35	3,895,926.30	
DANONE (GROUPE)	57,943	56.18	3,255,237.74	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	8.79	431,583.13	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	76.90	822,906.90	
HEINEKEN NV	24,387	89.26	2,176,783.62	
JDE PEET'S BV	7,000	32.47	227,290.00	
KERRY GROUP PLC-A	14,641	112.50	1,647,112.50	
PERNOD-RICARD	19,514	156.30	3,050,038.20	
REMY COINTREAU	2,382	142.20	338,720.40	
BEIERSDORF AG	9,190	91.96	845,112.40	
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	78.00	794,820.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	16,722	89.38	1,494,612.36	
LOREAL	22,985	297.10	6,828,843.50	
AMPLIFON SPA	11,650	34.35	400,177.50	
BIOMERIEUX	4,175	119.90	500,582.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	127.00	435,610.00	
DIASORIN SPA	2,070	171.20	354,384.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	68.36	1,366,174.60	

FRESENIUS SE&CO KGAA	39,241	38.73	1,519,803.93	
KONINKLIJKE PHILIPS	84,867	44.93	3,813,498.64	
ORPEA	4,336	115.05	498,856.80	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	372.60	1,209,459.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	43.83	1,075,973.91	
ARGENX SE	4,178	234.20	978,487.60	
BAYER	92,086	53.01	4,881,478.86	
EUROFINS SCIENTIFIC	12,420	77.41	961,432.20	
GALAPAGOS NV	4,368	87.66	382,898.88	
GRIFOLS SA	27,685	25.53	706,798.05	
IPSEN	3,532	73.65	260,131.80	
MERCK KGAA	12,078	148.85	1,797,810.30	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	39.27	386,966.58	
QIAGEN N.V.	21,801	44.92	979,300.92	
RECORDATI SPA	9,859	43.52	429,063.68	
SANOFI	103,681	83.23	8,629,369.63	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	315.00	761,985.00	
UCB (GROUPE)	11,875	86.36	1,025,525.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	8.53	340,685.81	
BANCO BILBAO VIZCAYA	625,362	4.02	2,515,205.96	
BANCO SANTANDER SA	1,575,545	2.68	4,228,762.78	
BNP PARIBAS	104,161	44.11	4,594,541.71	
CAIXABANK	328,697	2.19	721,489.91	
COMMERZBANK AG	94,388	5.78	546,317.74	
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	10.05	1,080,003.15	
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	26.60	733,096.00	
FINECOBANK SPA	53,120	13.49	716,588.80	
ING GROEP NV-CVA	365,729	7.76	2,838,788.49	
INTESA SANPAOLO	1,550,535	1.91	2,962,142.06	
KBC GROEP NV	24,002	59.46	1,427,158.92	
MEDIOBANCA	53,990	7.38	398,446.20	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	17.51	218,699.90	
SOCIETE GENERALE	79,076	16.98	1,343,026.78	
UNICREDIT SPA	199,401	7.78	1,551,937.98	
AMUNDI SA	6,226	67.45	419,943.70	
DEUTSCHE BANK NAMEN	184,224	9.29	1,712,177.85	
DEUTSCHE BOERSE	17,820	135.85	2,420,847.00	
EURAZEO SA	3,357	57.80	194,034.60	
EXOR NV	10,345	66.18	684,632.10	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,615	84.06	892,296.90	
NATIXIS	89,751	3.16	284,151.66	
SOFINA	1,238	269.00	333,022.00	

WENDEL	2,023	100.50	203,311.50	
AEGON	166,267	3.57	594,071.99	
AGEAS	16,065	44.89	721,157.85	
ALLIANZ SE-REG	38,348	201.00	7,707,948.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	103,541	14.50	1,501,862.20	
AXA SA	181,327	19.65	3,563,075.55	
CNP ASSURANCES	16,287	13.69	222,969.03	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	137.20	794,250.80	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,136	237.00	3,113,232.00	
NN GROUP NV	27,631	36.34	1,004,110.54	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.31	382,550.85	
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	35.28	1,519,686.00	
SCOR SE	13,354	28.16	376,048.64	
AROUNDTOWN SA	94,068	5.94	559,140.19	
DEUTSCHE WOHNEN SE	32,092	42.04	1,349,147.68	
LEG IMMOBILIEN AG	6,992	121.16	847,150.72	
VONOVIA SE	49,415	55.80	2,757,357.00	
ADYEN NV	1,704	1,785.00	3,041,640.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	56.02	2,346,341.68	
ATOS SE	9,750	66.62	649,545.00	
BECHTLE AG	2,553	174.40	445,243.20	
CAPGEMINI SA	15,104	125.40	1,894,041.60	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	160.60	2,009,909.00	
EDENRED	22,756	46.35	1,054,740.60	
NEMETSCHEK SE	5,455	59.60	325,118.00	
NEXI SPA	41,348	15.22	629,523.30	
SAP SE	96,113	103.90	9,986,140.70	
TEAMVIEWER AG	14,174	42.00	595,308.00	
WORLDLINE SA	22,702	73.60	1,670,867.20	
NOKIA OYJ	530,458	3.30	1,752,898.46	
ALTICE NV -A	50,000	5.33	266,600.00	
CELLNEX TELECOM SA	29,693	47.00	1,395,571.00	
DEUTSCHE TELEKOM	312,407	15.06	4,706,411.45	
ELISA A	13,387	46.27	619,416.49	
ILIAD SA	1,253	157.15	196,908.95	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.21	279,905.62	
KPN (KON.)	282,927	2.60	736,741.90	
ORANGE	188,105	9.66	1,817,470.51	
PROXIMUS	13,141	16.89	221,951.49	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.35	306,066.16	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.39	186,883.43	
TELEFONICA	481,815	3.75	1,807,288.06	

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.27	224,477.91	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	36.08	343,229.04	
	E.ON SE	210,622	8.72	1,838,308.81	
	ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	12.37	758,516.03	
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	100.80	294,840.00	
	ENAGAS	25,299	18.46	467,019.54	
	ENDESA	25,972	22.43	582,551.96	
	ENEL	746,915	8.57	6,404,049.21	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	260,788	5.32	1,387,392.16	
	ENGIE	171,054	13.58	2,322,913.32	
	FORTUM OYJ	41,901	21.21	888,720.21	
	IBERDROLA SA	551,545	11.82	6,519,261.90	
	IBERDROLA SA-RTS	551,545	0.16	92,769.86	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	20.08	468,064.80	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.97	632,923.04	
	RWE STAMM	60,260	37.44	2,256,134.40	
	SNAM SPA	189,497	4.40	835,302.77	
	SUEZ	32,549	17.40	566,515.34	
	TERNA SPA	130,230	6.02	784,765.98	
	UNIPER SE	20,192	29.60	597,683.20	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	23.15	1,219,241.05	
	VERBUND AG	6,430	77.25	496,717.50	
	ASML HOLDING NV	39,056	439.90	17,180,734.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES	122,432	34.07	4,171,258.24	
	STMICROELECTRONICS	59,796	32.76	1,958,916.96	
ユーロ 小計		18,060,291		389,621,999.51 (49,170,296,338)	
イギリスポンド	BP PLC	1,855,954	3.01	5,591,061.42	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	375,759	14.71	5,528,917.92	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	339,008	14.12	4,787,470.97	
	ANGLO AMERICAN PLC	115,026	26.26	3,020,582.76	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	15.11	541,784.16	
	BHP GROUP PLC	195,828	21.11	4,133,929.08	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,112	63.04	826,580.48	
	EVRAZ PLC	43,000	5.03	216,634.00	
	FRESNILLO PLC	17,490	10.76	188,279.85	
	GLENCORE PLC	937,287	2.73	2,565,823.16	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	27.37	461,129.76	
	MONDI PLC	47,780	17.95	857,651.00	
	RIO TINTO PLC REG	102,937	59.17	6,090,782.29	
	ASHTEAD GROUP PLC	42,021	36.70	1,542,170.70	
	BAE SYSTEMS PLC	301,814	4.85	1,466,212.41	

BUNZL PLC	33,283	24.30	808,776.90	
DCC PLC	9,127	57.84	527,905.68	
FERGUSON PLC	20,559	90.30	1,856,477.70	
MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.83	837,905.04	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786,119	1.04	822,673.53	
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.96	555,889.89	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	113.90	826,344.50	
EXPERIAN PLC	82,684	26.79	2,215,104.36	
INTERTEK GROUP PLC	15,404	54.96	846,603.84	
RELX PLC	181,099	18.23	3,301,434.77	
RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	5.20	942,267.46	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.95	670,652.48	
BURBERRY GROUP PLC	40,410	17.38	702,325.80	
PERSIMMON PLC	31,506	27.15	855,387.90	
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.62	577,680.88	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	44.56	527,100.24	
COMPASS GROUP PLC	167,282	13.98	2,339,438.77	
ENTAIN PLC	49,630	12.45	617,893.50	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	48.58	779,271.78	
WHITBREAD PLC	17,434	31.03	540,977.02	
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.62	547,527.94	
INFORMA PLC	141,175	5.22	738,062.90	
PEARSON	66,305	6.79	450,210.95	
WPP PLC	113,065	7.89	892,987.37	
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	8.19	338,944.81	
KINGFISHER PLC	198,587	2.62	521,092.28	
NEXT PLC	11,468	79.84	915,605.12	
OCADO GROUP PLC	44,612	25.80	1,150,989.60	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.81	379,163.63	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.38	353,333.97	
TESCO	919,600	2.42	2,226,351.60	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	22.66	758,883.40	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	210,356	27.40	5,763,754.40	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.06	414,157.60	
DIAGEO	214,466	29.26	6,276,347.49	
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	16.03	1,465,855.56	
RECKITT BENCKISER PLC	66,664	62.24	4,149,167.36	
UNILEVER PLC	242,262	43.81	10,613,498.22	
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	16.24	1,348,748.24	
ASTRAZENECA	120,780	77.22	9,326,631.60	
GLAXOSMITHKLINE	460,480	14.10	6,494,609.92	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	24.96	410,691.84	

	BARCLAYS	1,626,772	1.46	2,389,077.35	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,872,362	4.11	7,703,833.44	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.36	2,389,358.88	
	NATWEST GROUP PLC	479,086	1.57	753,602.27	
	STANDARD CHARTERED PLC	254,760	4.76	1,214,186.16	
	3I GROUP PLC	88,121	11.29	995,326.69	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	16.00	529,264.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	29,662	91.36	2,709,920.32	
	M&G PLC	229,107	1.90	436,334.28	
	SCHRODERS PLC	11,794	34.32	404,770.08	
	ST JAMES'S PLACE PLC	50,535	11.61	586,711.35	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	210,980	2.98	629,353.34	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	29.18	474,320.90	
	AVIVA PIC	381,270	3.46	1,319,575.47	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.24	369,232.60	
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.67	1,473,926.86	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.86	350,274.86	
	PRUDENTIAL	244,591	14.34	3,508,657.89	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	97,285	6.76	657,841.17	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	37.70	411,570.90	
	SAGE GROUP PLC	95,210	5.60	533,366.42	
	HALMA PLC	37,159	24.99	928,603.41	
	BT GROUP PLC	817,227	1.38	1,128,590.48	
	VODAFONE GROUP PLC	2,475,816	1.27	3,144,286.32	
	NATIONAL GRID PLC	330,030	8.78	2,900,303.64	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	23.30	523,504.40	
	SSE PLC	92,294	15.17	1,400,099.98	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	9.29	623,976.38	
イギリスポンド 小計		27,511,134		154,997,607.64 (21,972,460,859)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.26	335,085.48	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	820.00	666,660.00	
	GIVAUDAN-REG	865	3,554.00	3,074,210.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	49,107	50.64	2,486,778.48	
	SIKA AG-BR	13,295	243.30	3,234,673.50	
	ABB LTD	172,763	26.19	4,524,662.97	
	GEBERIT AG-REG	3,423	557.40	1,907,980.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	236.20	498,854.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	235.40	886,987.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	58.84	857,475.32	
	SGS SA	586	2,703.00	1,583,958.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	201.80	1,022,520.60	

	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	47,970	83.54	4,007,413.80	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	254.80	632,668.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	49.12	193,434.56	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,008.00	562,240.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	85,400.00	854,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	8,075.00	839,800.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	265,942	100.60	26,753,765.20	
	ALCON INC	46,053	64.80	2,984,234.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	223.80	1,149,884.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	1,025.00	1,039,350.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,876	580.00	3,988,080.00	
	NOVARTIS	204,741	85.52	17,509,450.32	
	ROCHE HOLDING GENUSS	64,809	318.20	20,622,223.80	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	137.65	617,497.90	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	92.40	263,709.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	229,553	12.17	2,793,660.01	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	55.22	1,169,393.94	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,755	1,050.00	1,842,750.00	
	UBS GROUP AG	343,652	13.22	4,543,079.44	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	156.80	683,961.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	427.60	1,218,232.40	
	SWISS RE LTD	26,804	83.66	2,242,422.64	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,103	374.80	5,285,804.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	87.40	651,829.20	
	TEMENOS AG - REG	6,511	114.45	745,183.95	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	86.98	1,277,388.28	
	SWISSCOM	2,441	474.10	1,157,278.10	
スイスフラン 小計		1,615,819		126,708,582.49 (14,831,239,580)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	249.90	4,303,777.80	
	BOLIDEN AB	23,903	293.30	7,010,749.90	
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	145.05	8,263,063.35	
	ALFA LAVAL AB	27,268	234.60	6,397,072.80	
	ASSA ABLOY AB-B	94,028	209.20	19,670,657.60	
	ATLAS COPCO A	62,970	452.40	28,487,628.00	
	ATLAS COPCO B	36,538	393.50	14,377,703.00	
	EPIROC AB-A	58,039	162.00	9,402,318.00	
	EPIROC AB-B	37,972	145.95	5,542,013.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	195.00	2,730,390.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,906	281.50	7,574,039.00	
	SANDVIK AB	105,904	216.00	22,875,264.00	
	SKANSKA B	32,007	229.50	7,345,606.50	

	SKF AB-B	35,405	233.40	8,263,527.00	
	VOLVO B	133,539	212.50	28,377,037.50	
	SECURITAS B	29,533	132.70	3,919,029.10	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	199.35	4,239,975.15	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	109.05	4,221,543.60	
	EVOLUTION GAMING GROUP	14,988	839.80	12,586,922.40	
	HENNES & MAURITZ B	77,319	183.35	14,176,438.65	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	408.00	3,873,144.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,727	617.20	7,855,104.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	264.20	15,081,857.00	
	NORDEA BANK ABP	303,887	70.90	21,545,588.30	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	89.44	13,926,702.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	86.78	13,050,497.08	
	SWEDBANK AB-A	86,716	155.86	13,515,555.76	
	EQT AB	20,102	217.50	4,372,185.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	284.60	2,878,729.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	272.40	4,574,140.80	
	INVESTOR AB-B SHS	42,716	620.00	26,483,920.00	
	KINNEVIK AB - B	23,604	415.05	9,796,840.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	443.40	3,227,952.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	436.60	4,125,870.00	
	ERICSSON (LM) B	273,692	97.74	26,750,656.08	
	HEXAGON AB-B SHS	26,504	757.40	20,074,129.60	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	116.55	5,828,898.60	
	TELIA CO AB	230,643	35.20	8,118,633.60	
スウェーデンクローナ 小計		2,431,405		424,845,160.57 (5,293,570,700)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	92,158	169.00	15,574,702.00	
	NORSK HYDRO	126,800	39.81	5,047,908.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	394.00	6,464,752.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	128.60	2,458,446.20	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	284.00	2,633,816.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	332.30	2,353,348.60	
	MOWI ASA	40,968	190.35	7,798,258.80	
	ORKLA	69,804	85.42	5,962,657.68	
	DNB ASA	85,517	168.85	14,439,545.45	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	197.10	3,660,935.40	
	TELENOR ASA	65,744	146.35	9,621,634.40	
ノルウェークローネ 小計		551,446		76,016,004.53 (925,874,935)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	556.20	5,755,001.40	
	NOVOZYMES A/S	19,125	365.20	6,984,450.00	

	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	2,474.00	1,867,870.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	18,465	1,425.50	26,321,857.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	13,920.00	4,162,080.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	577	15,155.00	8,744,435.00	
	DSV PANALPINA A S	19,412	977.60	18,977,171.20	
	PANDORA A/S	9,401	612.20	5,755,292.20	
	CARLSBERG AS-B	9,672	925.00	8,946,600.00	
	AMBU A/S-B	13,555	262.80	3,562,254.00	
	COLOPLAST-B	11,223	891.00	9,999,693.00	
	DEMANT A/S	11,604	239.50	2,779,158.00	
	GN STORE NORD A/S	11,967	483.00	5,780,061.00	
	GENMAB A/S	6,127	2,710.00	16,604,170.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	232.40	1,132,020.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	156,681	448.80	70,318,432.80	
	DANSKE BANK A/S	64,813	113.65	7,365,997.45	
	TRYG A/S	14,272	199.00	2,840,128.00	
	ORSTED A/S	17,372	1,193.50	20,733,482.00	
デンマーククローネ 小計		400,538		228,630,153.95 (3,877,567,410)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	30.39	626,915.31	
	OIL SEARCH LTD	186,117	4.38	815,192.46	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.08	841,222.60	
	SANTOS	156,437	7.34	1,148,247.58	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	28.78	368,758.14	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	26.92	2,445,116.68	
	BHP GROUP LTD	269,141	45.87	12,345,497.67	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	17.01	839,069.28	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.59	560,686.86	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	24.82	3,841,540.32	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	37.71	1,630,127.88	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	26.42	1,957,669.16	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	64,628	13.30	859,552.40	
	ORICA LTD	38,288	15.27	584,657.76	
	RIO TINTO LTD	34,818	119.63	4,165,277.34	
	SOUTH32 LTD	481,840	2.63	1,267,239.20	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	26.29	242,393.80	
	BRAMBLES LTD	137,883	10.39	1,432,604.37	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.84	735,325.44	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.88	414,800.00	
	TRANSURBAN GROUP	256,633	12.94	3,320,831.02	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	29.30	1,545,633.60	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	10.25	310,862.00	

	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.13	751,713.69	
	REA GROUP LTD	5,276	142.52	751,935.52	
	SEEK LTD	31,593	27.80	878,285.40	
	WESFARMERS LTD	106,305	51.20	5,442,816.00	
	COLES GROUP LTD	115,478	17.86	2,062,437.08	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	118,441	39.53	4,681,972.73	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	12.94	596,922.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	9.35	659,530.30	
	COCHLEAR LIMITED	6,220	195.65	1,216,943.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	62.14	1,009,650.72	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	34.26	1,373,003.76	
	CSL LIMITED	41,500	271.14	11,252,310.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	265,872	24.68	6,561,720.96	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	161,955	85.11	13,783,990.05	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	297,796	24.02	7,153,059.92	
	WESTPAC BANKING	334,568	21.60	7,226,668.80	
	AMP LTD	343,649	1.55	534,374.19	
	ASX LTD	18,195	71.75	1,305,491.25	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	32,203	138.83	4,470,742.49	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	49.55	540,689.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	5.07	1,163,093.49	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.93	790,689.80	
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	8.18	1,129,420.78	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	10.54	1,257,991.16	
	AFTERPAY LTD	19,934	134.00	2,671,156.00	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	14.38	638,126.88	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	29.75	410,579.75	
	XERO LTD	11,340	137.66	1,561,064.40	
	TELSTRA CORP	403,126	3.14	1,265,815.64	
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.28	229,138.00	
	AGL ENERGY LTD	64,235	11.80	757,973.00	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.73	324,696.57	
オーストラリアドル 小計		6,505,118		126,753,224.00 (10,152,933,242)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.27	856,922.17	
	A2 MILK CO LTD	66,854	11.01	736,062.54	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	31.88	1,738,097.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.75	535,675.75	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.75	823,176.09	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.55	423,215.15	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	7.44	822,447.36	
		623,837		5,935,596.66	

ニュージーランドドル 小計				(439,234,152)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	58.20	14,928,067.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	129,000	117.80	15,196,200.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	19.52	3,357,440.00	
	MTR CORP	151,000	45.25	6,832,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	204,000	59.15	12,066,600.00	
	SANDS CHINA LTD	242,800	30.90	7,502,520.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.63	1,139,160.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	12.34	1,737,472.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	25.05	3,654,795.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.93	6,489,945.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	17.00	1,855,720.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	24.60	8,868,300.00	
	HANG SENG BANK	74,200	146.00	10,833,200.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	112,900	501.00	56,562,900.00	
	AIA GROUP LTD	1,114,800	108.90	121,401,720.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	242,996	42.30	10,278,730.80	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	26.40	4,144,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.50	3,546,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	32.65	4,088,694.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	155,375	37.10	5,764,412.50	
	SINO LAND CO	315,400	10.66	3,362,164.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	111.50	13,212,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	50.05	2,027,025.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	23.55	2,265,510.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	43.95	6,900,150.00	
	PCCW LTD	357,000	4.43	1,581,510.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	42.85	2,892,375.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	72.50	11,382,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	11.30	11,645,542.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	41.60	5,720,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	117.00	2,772,900.00	
香港ドル 小計		7,636,534		364,012,353.40 (4,881,405,659)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.68	779,864.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.83	564,542.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	4.33	469,077.56	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.87	535,050.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	5.26	939,436.00	
	DBS GROUP	168,300	26.59	4,475,097.00	
	OCBC BANK	291,200	10.64	3,098,368.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,400	23.79	2,626,416.00	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	10.00	783,000.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.46	773,310.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.71	329,988.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.83	371,925.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	20.21	519,397.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.45	1,842,995.35	
シンガポールドル 小計		2,926,575		18,108,465.91 (1,417,530,711)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	17.76	1,203,346.56	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	442.00	948,532.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	23.70	2,329,947.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	21.02	2,956,568.10	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	13.90	1,383,050.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	82.20	1,027,746.60	
	AZRIELI GROUP	4,323	211.40	913,882.20	
	NICE LTD	5,891	888.30	5,232,975.30	
イスラエルシェケル 小計		431,084		15,996,047.76 (510,433,884)	
合　計		101,336,478		453,301,958,176 (453,301,958,176)	

(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	1,091,500.02	
		LENDLEASE GROUP	64,786	822,782.20	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	765,988.65	
	オーストラリアドル 小計		303,750	2,680,270.87 (214,689,696)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,680,210.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,750,000.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,430,210.00 (72,819,116)	
投資信託受益証券合計			899,250	287,508,812 (287,508,812)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	730,445.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,030	2,003,115.30	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	40,627	8,811,183.76	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,031,441.21	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,167,361.45	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,215,475.41	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	877,218.16	
	CROWN CASTLE INTL CORP	40,319	6,426,445.41	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,462,307.09	
	DUKE REALTY CORP	35,040	1,355,697.60	
	EQUINIX INC	8,349	5,980,555.68	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	990,030.28	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,139,617.87	
	ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,498,977.60	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,376,432.82	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	51,571	1,503,294.65	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	999,384.84	
	INVITATION HOMES INC	51,458	1,514,923.52	
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	813,157.92	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,068,268.60	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,425,608.15	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	748,186.55	
	PROLOGIS INC	69,633	6,824,730.33	
	PUBLIC STORAGE	14,902	3,287,679.24	
	REALTY INCOME CORP	32,696	1,900,945.44	
	REGENCY CENTERS CORP	15,605	732,498.70	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,576	2,846,424.64	
	SIMON PROPERTY GROUP	30,301	2,807,993.67	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,280,159.30	
	UDR INC	28,059	1,085,322.12	
	VENTAS INC	34,674	1,656,376.98	
	VEREIT INC	21,159	755,376.30	
	VICI PROPERTIES INC	49,459	1,254,774.83	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	580,510.80	
	WELLTOWER INC	38,883	2,371,863.00	
	WP CAREY INC	16,500	1,104,015.00	
アメリカドル 小計		1,106,017	76,627,799.62 (7,963,927,214)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	446,927.23	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	274,173.00	
カナダドル 小計		24,377	721,100.23 (58,906,677)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	356,023.50	
	GECINA SA	4,459	538,201.30	
	KLEPIERRE	17,225	312,978.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	826,904.10	
ユーロ 小計		40,341	2,034,107.15 (256,704,322)	
	BRITISH LAND CO PLC	79,414	355,774.72	

	イギリスポンド				
		LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	434,453.25	
		SEGRO PLC	106,999	1,028,474.38	
	イギリスポンド 小計		252,762	1,818,702.35 (257,819,245)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	849,632.70	
		GOODMAN GROUP	155,698	2,755,854.60	
		GPT GROUP	167,884	740,368.44	
		MIRVAC GROUP	392,919	998,014.26	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,421,055.96	
		STOCKLAND	207,412	889,797.48	
		VICINITY CENTERS	365,149	586,064.14	
	オーストラリアドル 小計		1,869,815	8,240,787.58 (660,087,085)	
	香港ドル	LINK REIT	199,000	13,840,450.00	
	香港ドル 小計		199,000	13,840,450.00 (185,600,434)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	875,145.04	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	998,150.40	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	490,600.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	554,362.55	
		SUNTEC REIT	173,000	264,690.00	
	シンガポールドル 小計		1,376,783	3,182,947.99 (249,161,168)	
投資証券合計			4,869,095	9,632,206,145 (9,632,206,145)	
合計				9,919,714,957 (9,919,714,957)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　593銘柄	97.6%	—	—	70.0%
	投資証券　36銘柄	—	—	2.4%	1.7%
カナダドル	株式　86銘柄	99.6%	—	—	3.4%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%

ユーロ	株式　236銘柄	99.5%	—	—	10.6%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式　85銘柄	98.8%	—	—	4.7%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式　39銘柄	100.0%	—	—	3.2%
スウェーデンクローナ	株式　38銘柄	100.0%	—	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　19銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　55銘柄	92.1%	—	—	2.2%
	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	95.0%	—	—	1.1%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.6%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	85.1%	—	—	0.3%
	投資証券　5銘柄	—	—	14.9%	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。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	855,220,075
金銭信託	11,725
コール・ローン	228,991,494
国債証券	61,585,277,384
未収利息	846,462,215
前払費用	46,920,190
流動資産合計	63,562,883,083

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産合計	63,562,883,083
負債の部	
流動負債	
未払解約金	90,466,098
未払利息	155
流動負債合計	90,466,253
負債合計	90,466,253
純資産の部	
元本等	
元本	36,785,091,133
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	26,687,325,697
元本等合計	63,472,416,830
純資産合計	63,472,416,830
負債純資産合計	63,562,883,083

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 1月20日現在	
1．　計算期間の末日における受益権の総数		36,785,091,133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	1.7255円
	(1万口当たり純資産額)	(17,255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

	2021年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2021年 1月20日現在
	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	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	33,299,525,287円
期中追加設定元本額	6,058,481,425円
期中一部解約元本額	2,572,915,579円
期末元本額	36,785,091,133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	4,262,849,121円
世界経済インデックスファンド	6,525,530,343円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	4,730,704,751円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,330,432,420円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,811,418,507円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	84,790,266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

区分	2021年 1月20日現在
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	312,684,810円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,869,937,278円
コア投資戦略ファンド（切替型）	86,647,214円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	182,271,675円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	85,841,744円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	152,071,261円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,142,450,568円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	183,826,780円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	175,945,663円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	297,749,660円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,477,993円
グローバル経済コア	639,011,517円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	28,048,658円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,598,606円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	737,126円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	675,039円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	306,085円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	422,878円
ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	85,899,881円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	183,502,199円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	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）	313,596,985円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	302,592,728円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	298,009,298円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△50,222,765
合計	△50,222,765

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	42,797,216.00	
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	119,882,960.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	80,800,000.00	84,515,184.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	111,624,530.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	57,950,000.00	60,927,471.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	123,626,316.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	55,900,000.00	65,470,080.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	69,893,520.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	38,192,530.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	93,600,000.00	113,982,336.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	57,450,000.00	70,476,787.50	
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	82,640,892.00	
		MBONO 8% 11/07/47	63,700,000.00	74,089,470.00	
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	107,636,275.50	
	メキシコペソ 小計		1,023,250,000.00	1,165,755,568.00 (6,166,846,954)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	79,700,000.00	66,694,346.78	
		BLTN 0% 07/01/22	22,300,000.00	20,959,587.14	
		BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	44,616,663.04	
		BNTNF 10% 01/01/23	37,750,000.00	41,016,136.07	
		BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000.00	37,810,421.40	
		BNTNF 10% 01/01/27	26,850,000.00	30,707,866.02	
		BNTNF 10% 01/01/29	13,200,000.00	15,260,244.92	
		BNTNF 10% 01/01/31	5,500,000.00	6,409,225.13	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,657,250.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,075,750.00	
	ブラジルレアル 小計		273,400,000.00	267,207,490.50 (5,186,497,390)	
	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	275,000,000.00	273,887,757.00	
		BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,666,116,451.31	
		BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,938,930,980.22	
		BTPCL 4.7% 09/01/30	1,480,000,000.00	1,734,240,077.28	
		BTPCL 4% 03/01/23	880,000,000.00	944,792,591.60	
		BTPCL 5% 03/01/35	1,930,000,000.00	2,311,589,818.76	

	BTPCL 6% 01/01/43	1,480,000,000.00	2,009,287,533.76	
チリペソ 小計		10,270,000,000.00	11,878,845,209.93 (1,676,105,059)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	88,800,000,000.00	114,591,960,000.00	
コロンビアペソ 小計		88,800,000,000.00	114,591,960,000.00 (3,414,840,408)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	4,052,621.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	4,300,000.00	4,727,033.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,200,000.00	3,722,560.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,741,661.50	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,050,000.00	7,330,966.50	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,450,000.00	8,049,471.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	8,386,287.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,250,000.00	8,113,625.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,543,428.00	
ペルーヌエボソル 小計		49,950,000.00	60,667,653.00 (1,744,195,023)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	16,504,020.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	18,111,665.00	
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	34,615,685.00 (85,154,585)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,051,780.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	26,902,000.00	
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	47,953,780.00 (85,837,266)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,643,954.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	7,653,606.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,950,000.00	9,008,332.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	6,850,000.00	6,522,022.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	6,705,584.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	7,350,000.00	7,065,702.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,606,267.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	4,546,498.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	6,264,660.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,427,914.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	3,750,000.00	3,443,137.50	
	TURKGB 8% 03/12/25	7,100,000.00	5,945,327.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,371,445.00	
トルコリラ 小計		89,050,000.00	82,204,449.00 (1,143,463,885)	
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	48,700,000.00	46,632,685.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	48,200,000.00	48,268,444.00	

	CZGB 0.95% 05/15/30	46,900,000.00	45,757,985.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	30,900,000.00	30,703,785.00	
	CZGB 1% 06/26/26	57,200,000.00	57,561,504.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	39,500,000.00	42,505,160.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	47,800,000.00	52,862,976.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	43,300,000.00	49,024,693.00	
	CZGB 2% 10/13/33	49,200,000.00	52,708,452.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	38,480,346.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	44,474,313.00	
チェココルナ 小計		485,200,000.00	508,980,343.00 (2,453,285,253)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	395,500,000.00	395,812,445.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	328,372,725.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	367,000,000.00	375,279,520.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	468,753,750.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	577,323,480.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	502,150,535.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	642,000,000.00	707,978,340.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	429,065,000.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	596,341,950.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	643,030,400.00	
	HGB 3% 10/27/38	186,000,000.00	199,749,120.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	781,222,200.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	608,456,970.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	252,000,000.00	341,606,160.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	305,872,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		6,679,000,000.00	7,261,014,595.00 (2,558,781,543)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	7,500,000.00	7,625,775.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,350,000.00	4,386,148.50	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,351,240.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	10,850,000.00	11,678,723.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,893,806.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,850,000.00	21,395,322.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	19,400,000.00	21,517,122.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	16,072,272.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000.00	16,129,070.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000.00	17,230,895.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,966,272.50	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	12,036,447.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	11,899,737.50	
ポーランドズロチ 小計		172,450,000.00	188,182,832.00 (5,222,073,588)	

ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	82,500,000.00	79,377,375.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	163,100,000.00	169,805,041.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	167,694,880.00	
	RFLB 6% 10/06/27	213,500,000.00	215,479,145.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	146,000,000.00	155,993,700.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	174,653,271.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	224,690,368.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	171,879,450.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	216,489,474.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	173,820,582.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	137,700,000.00	144,078,264.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	226,500,000.00	252,101,295.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	149,632,140.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	175,394,220.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	155,925,925.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	200,871,990.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	74,527,176.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	112,646,832.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	175,620,120.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	138,279,243.00	
ロシアルーブル 小計		3,094,650,000.00	3,328,960,491.00 (4,693,834,292)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	3,350,000.00	3,351,474.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,424,186.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,694,993.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	9,450,000.00	10,087,308.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,575,291.50	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,064,273.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,458,053.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	7,500,000.00	7,936,575.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	25,750,000.00	28,193,417.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	14,732,685.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,816,360.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,400,000.00	9,136,344.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	9,400,000.00	10,218,646.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	13,800,000.00	14,843,280.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	8,181,172.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	5,850,000.00	6,778,395.00	
マレーシアリンギット 小計		159,550,000.00	171,492,453.00 (4,403,926,193)	
タイバーツ	THAIGB 0.95% 06/17/25	50,000,000.00	50,569,000.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	99,000,000.00	102,110,580.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	44,294,922.00	

	THAIGB 1.6% 12/17/29	80,200,000.00	82,772,816.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	67,300,000.00	68,670,228.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	96,100,000.00	103,443,962.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	76,000,000.00	80,139,720.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	78,200,000.00	88,565,410.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	53,500,000.00	55,083,065.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	171,200,000.00	210,036,720.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	126,700,000.00	156,104,536.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,353,760.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	139,856,337.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	100,151,064.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	82,400,000.00	94,794,608.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	136,515,945.00	
タイバーツ 小計		1,408,900,000.00	1,603,462,673.00 (5,564,015,475)	
フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,335,550.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	38,798,400.00	
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	54,133,950.00 (116,929,332)	
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,469,998,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,870,110,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	1,000,000,000.00	1,012,450,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	52,500,000,000.00	53,718,000,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	25,000,000,000.00	24,979,750,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	7,000,000,000.00	7,137,760,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	44,100,000,000.00	45,984,834,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	24,146,640,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	13,000,000,000.00	13,928,200,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	20,278,896,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	28,992,480,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,169,543,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,092,957,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	38,711,760,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,635,740,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	38,848,144,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,681,203,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,676,102,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	30,400,000,000.00	34,205,472,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	50,903,510,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	59,137,000,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	24,290,112,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	44,100,000,000.00	49,693,644,000.00	

		INDOGB 8.75% 05/15/31	18,700,000,000.00	21,821,404,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,895,460,000.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	33,700,000,000.00	39,292,515,000.00	
	インドネシアルピア 小計		742,400,000,000.00	808,573,684,000.00 (5,983,445,261)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	114,200,000.00	135,840,900.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	26,100,000.00	17,844,309.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,081,796.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	43,500,000.00	46,350,990.00	
		SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	35,798,774.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	49,200,000.00	44,376,432.00	
		SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	56,787,420.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	55,480,700.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	72,701,809.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	54,302,170.00	
		SAGB 8% 01/31/30	89,200,000.00	85,138,724.00	
		SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	29,690,850.00	
	南アフリカランド 小計		721,000,000.00	656,394,874.00 (4,555,380,425)	
	香港・オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,211,200.00	
		CGB 2.36% 07/02/23	24,500,000.00	24,232,460.00	
		CGB 2.68% 05/21/30	35,400,000.00	33,925,236.00	
		CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000.00	30,002,240.00	
		CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	16,937,687.00	
		CGB 2.94% 10/17/24	43,000,000.00	43,076,540.00	
		CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,082,320.00	
		CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,121,200.00	
		CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,613,474.00	
		CGB 3.19% 04/11/24	28,000,000.00	28,292,600.00	
		CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,139,320.00	
		CGB 3.25% 06/06/26	35,000,000.00	35,445,200.00	
		CGB 3.25% 11/22/28	20,200,000.00	20,313,322.00	
		CGB 3.27% 11/19/30	20,000,000.00	20,193,400.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	12,000,000.00	12,094,800.00	
		CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,239,720.00	
		CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,228,000.00	
	香港・オフショア人民元 小計		408,200,000.00	407,148,719.00 (6,530,665,452)	
合計				61,585,277,384 (61,585,277,384)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	10.0%
ブラジルレアル	国債証券　10銘柄	100.0%	8.4%
チリペソ	国債証券　7銘柄	100.0%	2.7%
コロンビアペソ	国債証券　1銘柄	100.0%	5.5%
ペルーヌエボソル	国債証券　9銘柄	100.0%	2.8%
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　13銘柄	100.0%	1.9%
チェココルナ	国債証券　11銘柄	100.0%	4.0%
ハンガリーフォリント	国債証券　15銘柄	100.0%	4.2%
ポーランドズロチ	国債証券　13銘柄	100.0%	8.5%
ロシアルーブル	国債証券　20銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリンギット	国債証券　16銘柄	100.0%	7.2%
タイバーツ	国債証券　16銘柄	100.0%	9.0%
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　26銘柄	100.0%	9.7%
南アフリカランド	国債証券　12銘柄	100.0%	7.4%
香港・オフショア人民元	国債証券　17銘柄	100.0%	10.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,326,857,261
金銭信託	83,362

	2021年 1月20日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	1,628,083,246
株式	87,674,234,403
投資信託受益証券	187,548,032
投資証券	59,863,466
派生商品評価勘定	69,390,028
未収入金	905,681,931
未収配当金	21,603,717
差入委託証拠金	679,335,811
流動資産合計	92,552,681,257
資産合計	92,552,681,257
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	94,257
前受金	69,295,327
未払金	8,283
未払解約金	1,811,598,457
未払利息	1,106
流動負債合計	1,880,997,430
負債合計	1,880,997,430
純資産の部	
元本等	
元本	25,006,661,411
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	65,665,022,416
元本等合計	90,671,683,827
純資産合計	90,671,683,827
負債純資産合計	92,552,681,257

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券

	2021年 1月20日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 1月20日現在
1．　計算期間の末日における受益権の総数	25,006,661,411口

	2021年 1月20日現在	
2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	3.6259円
	(1万口当たり純資産額)	(36,259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

	2021年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2021年 1月20日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	23,263,694,840円
期中追加設定元本額	4,502,772,052円
期中一部解約元本額	2,759,805,481円
期末元本額	25,006,661,411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	7,183,866,418円
世界経済インデックスファンド	3,807,169,006円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	4,698,930,759円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	4,643,867,783円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	208,289,799円

区分	2021年 1月20日現在
分散投資コア戦略ファンドＡ	323,155,672円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,286,691,180円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	553,047,967円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	578,352,685円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	318,784,520円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,425,983円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	89,986,897円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	102,596,285円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	324,777,988円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	56,098,749円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,604,846円
グローバル経済コア	390,683,691円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	31,154,533円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	797,427円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	782,792円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	383,828円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	540,101円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	304,685,564円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	82,986,938円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	11,409,403,797
投資信託受益証券	25,458,042
投資証券	5,905,457
合計	11,440,767,296

(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

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,663,937,917	－	2,733,233,244	69,295,327
合計		2,663,937,917	－	2,733,233,244	69,295,327

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	74,168	－	73,968	△200
	アメリカドル	74,168	－	73,968	△200
	売建	197,522,168	－	197,521,524	644
	アメリカドル	197,448,000	－	197,448,000	－
	ブラジルレアル	74,168	－	73,524	644
合計		197,596,336	－	197,595,492	444

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	608,554	6.06	3,687,837.24	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	39,446	79.92	3,152,524.32	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,717	186.00	1,807,362.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	6.88	922,690.38	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.87	600,259.63	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	25,084	42.98	1,078,110.32	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	3.94	61,113.34	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	10.88	184,198.40	

MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,853	35.13	2,348,545.89	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	29.76	583,236.48	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	15.28	409,779.04	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	99.40	789,037.20	
SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	18.18	704,893.14	
SOUTHERN COPPER CORP	9,585	70.90	679,576.50	
51JOB INC-ADR	2,701	68.33	184,559.33	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	38,964	30.14	1,174,374.96	
NIO INC - ADR	129,908	58.44	7,591,823.52	
XPENG INC - ADR	10,341	53.84	556,759.44	
GSX TECHEDU INC- ADR	7,846	65.96	517,522.16	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	15,919	48.11	765,863.09	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,618	175.09	2,734,555.62	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	38,928	68.33	2,659,950.24	
YUM CHINA HOLDINGS INC	39,507	59.29	2,342,370.03	
AUTOHOME INC-ADR	6,571	106.51	699,877.21	
BAIDU INC - SPON ADR	27,659	250.42	6,926,366.78	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12,149	127.88	1,553,614.12	
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	5,000	12.48	62,400.00	
HUYA INC-ADR	8,211	23.00	188,853.00	
IQIYI INC-ADR	21,239	19.49	413,948.11	
JOYY INC	6,185	91.77	567,597.45	
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	10,503	26.20	275,178.60	
MOMO INC-SPON ADR	15,529	15.47	240,233.63	
NETEASE INC-ADR	42,243	110.10	4,650,954.30	
SINA CORP	5,725	41.85	239,591.25	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	39,090	26.87	1,050,348.30	
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	41.56	218,148.44	
YANDEX NV-A	30,372	68.08	2,067,725.76	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	191,380	251.65	48,160,777.00	
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	34.68	121,657.44	
JD.COM INC-ADR	87,842	91.15	8,006,798.30	
PINDUODUO INC-ADR	38,642	168.79	6,522,383.18	
TRIP.COM GROUP LTD	48,611	33.67	1,636,732.37	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	29.64	1,407,544.32	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	16.59	662,372.34	
BEIGENE LTD-ADR	2,200	356.68	784,696.00	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	7,243	33.25	240,829.75	
ZAI LAB LTD-ADR	5,149	184.69	950,968.81	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	141,961	4.00	567,844.00	
CREDICORP LTD	7,332	155.49	1,140,052.68	
SBERBANK-SPONSORED ADR	271,136	15.08	4,090,086.56	

	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.00	378,793.07	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	48.94	98,907.74	
	KE HOLDINGS INC	10,000	63.37	633,700.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.80	43,763.32	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	9,050	106.20	961,110.00	
	GLOBANT SA	3,899	212.99	830,448.01	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	44.46	247,108.68	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	9.23	367,852.42	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	6.57	96,684.12	
アメリカドル 小計		3,087,528		132,642,889.33 (13,785,575,488)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	13.07	20,195,254.27	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	323,292	89.13	28,815,015.96	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	323.43	4,689,735.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	47.66	4,615,966.32	
	ALFA S.A.B.-A	359,900	13.60	4,894,640.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	65.06	2,439,750.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	325.19	7,578,552.95	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	211.96	9,258,412.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	164.23	2,788,625.40	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	33.19	7,414,314.10	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	73.47	2,306,958.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	511,980	63.99	32,761,600.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	97.00	4,896,075.00	
	BECLE SAB DE CV	48,100	49.28	2,370,368.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	185,340	146.80	27,207,912.00	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	224.03	5,815,818.80	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	42.60	7,744,680.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	35.36	6,428,448.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	254,500	115.05	29,280,225.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	20.04	5,060,100.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,438,640	14.09	48,450,437.60	
	TELESITES SAB DE CV	74,800	21.15	1,582,020.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	76.54	4,401,050.00	
メキシコペソ 小計		7,979,355		270,995,959.40 (1,433,568,625)	
ブラジルレアル	COSAN SA	18,400	82.35	1,515,240.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	375,100	29.12	10,922,912.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	484,640	28.69	13,904,321.60	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	22.19	1,677,564.00	
	BRADESPAR SA -PREF	10,000	71.71	717,100.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	33.04	2,081,520.00	

GERDAU SA-PREF	105,000	25.67	2,695,350.00	
SUZANO SA	74,079	65.21	4,830,691.59	
VALE SA	379,178	94.06	35,665,482.68	
WEG SA	85,572	89.60	7,667,251.20	
CCR SA	125,600	13.01	1,634,056.00	
LOCALIZA RENT A CAR	61,952	68.80	4,262,297.60	
RUMO SA	114,200	21.10	2,409,620.00	
ALPARGATAS SA - PREF	10,300	42.00	432,600.00	
B2W CIA DIGITAL	22,349	80.62	1,801,776.38	
LOJAS AMERICANAS SA PREF RTS	902	5.12	4,618.24	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	95,716	24.65	2,359,399.40	
LOJAS RENNER S.A.	82,907	43.90	3,639,617.30	
MAGAZINE LUIZA SA	305,500	24.08	7,356,440.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	21.75	1,653,000.00	
VIA VAREJO SA	135,900	14.32	1,946,088.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	19.94	827,510.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	19,700	78.60	1,548,420.00	
RAIA DROGASIL SA	122,500	26.80	3,283,000.00	
AMBEV SA	476,800	16.27	7,757,536.00	
BRF SA	52,500	20.41	1,071,525.00	
JBS SA	110,000	24.47	2,691,700.00	
NATURA &CO HOLDING SA	80,908	51.18	4,140,871.44	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	100,500	17.37	1,745,685.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	96.80	5,265,920.00	
HYPERA SA	35,300	35.41	1,249,973.00	
BANCO BRADESCO S.A.	146,698	23.16	3,397,525.68	
BANCO BRADESCO SA-PREF	432,548	26.40	11,419,267.20	
BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	35.32	3,118,756.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	486,581	30.83	15,001,292.23	
ITAUSA SA	466,267	11.45	5,338,757.15	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	210,903	60.59	12,778,612.77	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	28.83	1,989,270.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	21.19	962,026.00	
TOTVS SA	26,200	29.52	773,424.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	43.79	2,290,217.00	
TIM SA	96,100	13.72	1,318,492.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	14,500	33.74	489,230.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	33.30	1,118,880.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	102,126	14.18	1,448,146.68	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	7,900	64.99	513,421.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	41.58	1,442,826.00	
CPFL ENERGIA SA	33,800	31.69	1,071,122.00	

	ENGIE BRASIL SA	29,250	44.99	1,315,957.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	80,900	22.77	1,842,093.00	
ブラジルレアル 小計		6,253,076		206,388,402.64 (4,005,998,895)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	8,698.00	389,061,540.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	2,186.00	297,219,490.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,556	42,201.00	445,473,756.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,770.00	196,218,490.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,460.00	201,462,480.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,100.00	45,048,500.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,995.00	30,347,940.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	80.80	392,901,312.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	32,165.00	175,492,240.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	40.64	255,211,925.44	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,272.60	52,940,160.00	
	COLBUN SA	1,215,680	131.75	160,165,840.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	116.71	407,471,373.65	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	61.50	157,518,597.00	
チリペソ 小計		18,880,463		3,206,533,644.09 (452,441,897)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,450.00	1,197,998,550.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	32,860.00	965,295,360.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	33,490.00	1,281,930,220.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	24,930.00	519,042,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	29,200.00	1,474,921,200.00	
コロンビアペソ 小計		627,964		5,439,187,930.00 (162,087,800)	
ユーロ	OPAP SA	17,668	11.03	194,878.04	
	JUMBO SA	7,201	13.31	95,845.31	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.05	342,001.35	
ユーロ 小計		51,076		632,724.70 (79,849,857)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	16.37	437,212.50	
イギリスポンド 小計		26,700		437,212.50 (61,979,244)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	108.40	1,257,765.20	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	15.67	1,829,550.85	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	18.41	1,833,010.06	
	KOC HOLDING AS	89,884	22.30	2,004,413.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	89,157	7.94	707,906.58	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	13.43	835,225.13	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	168.20	1,093,468.20	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	74.30	3,181,823.20	
	AKBANK T.A.S.	276,321	7.01	1,937,010.21	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	10.13	2,431,118.96	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	6.97	1,205,893.64	
	YAPI VE KREDI BANKASI	246,063	3.23	794,783.49	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	11.24	1,285,608.72	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	16.94	2,423,961.54	
トルコリラ 小計		1,711,338		22,821,538.98 (317,447,607)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	698.00	5,209,174.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	71.40	4,908,607.20	
	CEZ AS	18,145	539.00	9,780,155.00	
チェココルナ 小計		94,356		19,897,936.20 (95,908,052)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,328.00	98,602,440.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,050.00	122,182,900.00	
	OTP BANK NYRT	22,061	14,100.00	311,060,100.00	
ハンガリーフォリント 小計		79,594		531,845,440.00 (187,422,333)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	60.66	1,863,050.58	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	5.85	1,171,498.65	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	195.60	2,568,619.20	
	LPP SA	124	7,745.00	960,380.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	248.20	1,663,932.80	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	30.70	1,108,208.60	
	ALLEGRO.EU SA	27,362	75.00	2,052,150.00	
	DINO POLSKA SA	5,945	263.80	1,568,291.00	
	BANK PEKAO SA	15,847	66.34	1,051,289.98	
	PKO BANK POLSKI SA	93,849	30.24	2,837,993.76	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	195.60	707,094.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	31.00	1,923,364.00	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.37	354,819.75	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.25	460,599.98	
ポーランドズロチ 小計		614,638		20,291,292.30 (563,083,361)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	9.40	1,804,800.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,495,400	4.08	10,181,232.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	331,000	15.98	5,289,380.00	
	CNOOC LTD-R	1,817,000	8.43	15,317,310.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,148,000	2.64	5,670,720.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.71	952,820.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.60	884,000.00	

ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	105,500	51.30	5,412,150.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	6.88	698,320.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	5.29	2,475,720.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	10.66	4,391,920.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	9.15	2,635,200.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	13.92	1,155,360.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.58	1,092,280.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	11.90	1,535,100.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	17.90	908,425.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	9.02	816,310.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	9.26	6,750,540.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	7.63	2,098,250.00	
BOC AVIATION LTD	23,800	65.25	1,552,950.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.93	770,280.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	39.50	6,300,250.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	13.78	1,763,840.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	3.98	1,886,520.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	4.81	817,700.00	
CITIC LTD	677,000	6.26	4,238,020.00	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	12.50	3,600,000.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	28.20	2,199,600.00	
HEBEI CONSTRUCTION GROUP C-H	46,500	3.82	177,630.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	23.00	1,253,500.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	21.25	4,500,750.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	16.34	513,337.44	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	44.80	2,791,040.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	10.60	1,231,720.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	36.90	1,531,350.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.78	1,840,653.72	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	67.00	9,112,000.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	9.65	1,737,000.00	
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.72	1,224,080.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	6.02	1,492,960.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.98	1,817,706.06	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.59	807,840.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	398,500	9.90	3,945,150.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.78	1,449,473.72	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	9.26	1,444,560.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	13.46	1,721,830.12	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.55	576,400.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	6.69	2,461,920.00	
BYD CO LTD-H	76,000	234.00	17,784,000.00	

DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	8.89	2,364,740.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	53.45	1,453,840.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	609,000	32.00	19,488,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	27.20	9,594,800.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	8.18	2,931,253.92	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	18.46	1,993,680.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	143.90	15,972,900.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	3.98	772,120.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	227,200	32.65	7,418,080.00	
LI NING CO LTD	217,000	54.70	11,869,900.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	154.00	13,059,200.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	16.28	732,600.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	16.88	1,181,600.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	7.49	719,040.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	85,000	63.75	5,418,750.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	22,500	23.85	536,625.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.00	1,450,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	32,200	55.90	1,799,980.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	581,700	655.00	381,013,500.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	28.90	1,560,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	1.24	1,496,627.92	
MEITUAN-CLASS B	365,100	341.00	124,499,100.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	14.72	1,006,848.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	11.92	1,358,880.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	52.80	3,590,400.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	7.41	1,919,190.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	111.40	1,693,280.00	
CHINA FEIHE LTD	144,000	24.05	3,463,200.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	48.00	13,488,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	148,000	71.00	10,508,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.70	1,156,200.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	43,000	75.15	3,231,450.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.20	3,009,600.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	78.50	3,611,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.58	686,400.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.47	3,063,200.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	111.90	5,371,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	78,500	55.90	4,388,150.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	25.35	633,750.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	30,000	13.90	417,000.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	23.45	9,895,900.00	

JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	15.28	1,894,720.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	88.20	4,736,340.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	15.70	3,830,800.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.00	1,797,600.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	19.26	2,411,352.00	
3SBIO INC	119,000	7.35	874,650.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	5,800	235.00	1,363,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	9.89	989,000.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	8.47	8,098,675.20	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.45	700,875.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.96	657,360.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	11.10	910,200.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	181.00	923,100.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	44.65	5,447,300.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	99,000	96.95	9,598,050.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	192,500	3.96	762,300.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	12,800	143.00	1,830,400.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	37.85	2,763,050.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	7.37	8,202,810.00	
SSY GROUP LTD	114,000	4.46	508,440.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	26,740	170.20	4,551,148.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	314,500	110.80	34,846,600.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	3.05	8,616,250.00	
BANK OF CHINA LTD-H	8,279,200	2.77	22,933,384.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.44	4,877,229.00	
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.63	3,452,856.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,709,620	6.26	60,782,221.20	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	3.35	1,256,250.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	415,923	60.80	25,288,118.40	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	4.82	3,250,608.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.45	520,950.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,208,515	5.17	32,098,022.55	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.31	5,623,290.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.62	1,347,840.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	11.22	1,503,480.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	5.30	2,559,900.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.05	973,350.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	24.45	3,227,400.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	20.15	5,007,275.00	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	8.16	1,958,400.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	12.68	1,123,448.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	7.73	2,761,156.00	

HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	13.66	1,852,296.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	805,000	17.94	14,441,700.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	38.70	11,478,420.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	16.74	3,080,561.76	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	33.35	3,214,940.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.65	2,488,350.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	6.36	4,383,871.68	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	606,000	101.60	61,569,600.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	42.50	1,942,250.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	10.66	1,513,720.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	8.28	1,043,280.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	17.26	3,210,360.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.22	2,439,160.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	409,040	18.78	7,681,771.20	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	5.57	445,600.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	317,111	35.10	11,130,596.10	
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	31.75	5,664,200.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	7.19	1,984,440.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	800,964	10.72	8,586,334.08	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	12.56	910,600.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	10.50	1,419,600.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	60,000	22.25	1,335,000.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	4.22	658,320.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	12.00	1,830,000.00	
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	13.24	1,986,000.00	
LONGFOR PROPERTIES	197,000	45.65	8,993,050.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	70.70	565,600.00	
SEAZEN GROUP LTD	204,000	6.80	1,387,200.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.79	937,440.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	25.75	3,411,875.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	34.75	8,722,250.00	
WHARF HOLDINGS	100,000	18.58	1,858,000.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.64	947,920.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	5.16	675,960.00	
CHINA YOUZAN LTD	1,456,000	3.51	5,110,560.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	31.30	7,574,600.00	
KINGSOFT CORP LTD	92,000	59.55	5,478,600.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	18.90	1,493,100.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	47.00	3,360,500.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	49.40	4,199,000.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	33.05	2,214,350.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	13.38	923,220.00	

	LENOVO GROUP LTD	732,000	9.31	6,814,920.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	70,500	221.00	15,580,500.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,452,800	31.40	45,617,920.00	
	ZTE CORP-H	82,908	24.20	2,006,373.60	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.29	5,890,140.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.80	1,654,100.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.37	2,055,700.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.84	1,455,440.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	255,200	30.75	7,847,400.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	11.28	3,823,920.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.77	1,178,820.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	42.10	4,462,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	8.93	1,566,322.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	84,700	122.00	10,333,400.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	13.96	4,467,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.06	1,132,200.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	7.33	2,638,800.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	48.50	2,182,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	428,273	19.28	8,257,103.44	
香港ドル 小計		89,399,476		1,462,401,236.11 (19,610,800,576)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.21	1,327,874.28	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	20.66	518,566.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	7.51	2,026,949.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	8.79	1,268,397.00	
	GAMUDA BHD	141,520	3.55	502,396.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	8.20	313,240.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.28	766,868.88	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.55	591,596.70	
	MISC BHD	125,040	6.53	816,511.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.35	304,500.00	
	GENTING BHD	188,500	4.23	797,355.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.41	890,977.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	31.76	184,208.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.75	136,500.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.45	1,203,013.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,146	23.76	835,068.96	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	139.00	959,100.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	19.08	1,401,998.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.80	723,840.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.98	1,230,289.08	

	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	12.20	2,211,860.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.35	1,226,755.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	128,200	4.07	521,774.00	
	SUPERMAX CORP BHD	161,715	6.34	1,025,273.10	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	6.13	3,095,037.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	265,600	3.19	847,264.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	635,119	4.00	2,540,476.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	17.44	1,068,932.48	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	16.86	280,432.38	
	MALAYAN BANKING BHD	411,105	8.10	3,329,950.50	
	PUBLIC BANK BERHAD	296,320	20.90	6,193,088.00	
	RHB BANK BHD	206,419	5.24	1,081,635.56	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.56	1,015,628.84	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.07	1,268,619.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.04	1,350,216.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.00	423,312.00	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.62	1,254,810.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	225,575	10.00	2,255,750.00	
マレーシアリンギット 小計		7,340,799		47,790,062.36 (1,227,248,801)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	113.00	15,187,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,194,000	41.00	48,954,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	59.00	7,085,900.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	38.25	7,894,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	63.50	14,283,309.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	388.00	31,428,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	60.75	26,007,075.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.30	6,781,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	9.80	7,933,100.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.88	3,954,264.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	25.50	9,249,819.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	30.25	5,511,550.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	13.90	6,547,386.50	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	36.50	6,482,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	592,000	58.00	34,336,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	326,300	29.25	9,544,275.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	35.75	2,359,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	14.20	2,625,580.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	907,200	21.20	19,232,640.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	124.00	4,067,200.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	38.50	2,833,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	122.00	6,331,800.00	

	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	114.50	14,472,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	55,900	115.00	6,428,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	12.10	5,307,665.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	91.25	8,093,875.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	21.50	3,549,650.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	77.00	7,815,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	66.50	5,971,700.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	69.50	5,302,850.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	48.25	10,918,975.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.05	7,019,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	28,000	622.00	17,416,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	179.00	21,426,300.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	57.75	14,073,675.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	34.00	2,244,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.44	3,307,246.96	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	53.75	2,870,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	191.50	3,236,350.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	129,400	63.75	8,249,250.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	83.25	5,677,650.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	35.50	10,231,100.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	52.00	2,823,600.00	
タイバーツ 小計		12,523,866		445,067,035.46 (1,544,382,613)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	44.85	10,671,609.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	826.00	23,359,280.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	569.50	3,905,631.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	74.50	22,611,718.50	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	1,072.00	24,446,960.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	126.80	12,186,748.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	190.70	11,634,607.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	87,300	37.95	3,313,035.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	153.80	14,697,128.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	102,805	84.50	8,687,022.50	
	BDO UNIBANK INC	219,911	111.00	24,410,121.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	48.00	7,741,776.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.39	10,341,523.00	
	AYALA LAND INC	794,100	39.65	31,486,065.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.21	2,685,980.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,003,150	39.00	39,122,850.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,060.00	9,661,400.00	
	PLDT INC	10,460	1,420.00	14,853,200.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	26.50	2,371,750.00	

	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	290.00	8,441,900.00	
フィリピンペソ 小計		6,348,089		286,630,304.00 (619,121,456)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,415.00	2,036,609,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	25,925.00	5,208,332,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	1,000.00	2,882,500,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	12,775.00	3,119,655,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	15,650.00	2,973,500,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	604,200	2,350.00	1,419,870,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	12,400.00	4,285,440,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	6,675.00	14,369,272,500.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	905,700	1,740.00	1,575,918,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	792,300	6,425.00	5,090,527,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	41,175.00	2,454,030,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,750.00	1,569,750,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,800.00	2,917,880,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	7,575.00	5,653,980,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,585.00	4,368,101,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	967,700	35,475.00	34,329,157,500.00	
	BANK MANDIRI	2,047,596	6,975.00	14,281,982,100.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	6,225.00	5,043,495,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,531,700	4,620.00	25,556,454,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,100,000	960.00	1,056,000,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,789,600	3,410.00	16,332,536,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	1,705.00	1,349,507,500.00	
インドネシアルピア 小計		29,947,696		157,874,498,600.00 (1,168,271,289)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	38,650.00	254,819,450.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	73,600.00	327,299,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	270,000.00	1,508,220,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,706	55,200.00	590,971,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	45,400.00	328,786,800.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	418,000.00	327,294,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	165,000.00	313,170,000.00	
	LG CHEM LTD	4,588	997,000.00	4,574,236,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	496,000.00	434,992,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	292,500.00	564,525,000.00	
	POSCO	7,515	271,000.00	2,036,565,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,399	128,000.00	435,072,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	748	392,000.00	293,216,000.00	
	CJ CORP	1,230	109,000.00	134,070,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	32,000.00	137,856,000.00	

DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	17,992	13,300.00	239,293,600.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	44,500.00	300,820,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,825	31,250.00	88,281,250.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,239	45,150.00	417,140,850.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,036	268,000.00	277,648,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	30,050.00	214,526,950.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	110,500.00	481,117,000.00	
LG CORP	9,902	103,000.00	1,019,906,000.00	
LOTTE CORP	2,370	35,500.00	84,135,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	8,727	144,000.00	1,256,688,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	13,600.00	251,817,600.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	6,850.00	406,246,100.00	
SK HOLDINGS CO LTD	3,592	309,000.00	1,109,928,000.00	
S-1 CORPORATION	840	87,500.00	73,500,000.00	
CJ LOGISTICS	862	165,000.00	142,230,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	189,000.00	299,754,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	9,145	31,700.00	289,896,500.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,825.00	143,476,200.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	40,900.00	288,999,400.00	
HANON SYSTEMS	19,000	17,650.00	335,350,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,916	345,000.00	2,386,020,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	15,682	261,500.00	4,100,843,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	117,500.00	358,492,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,610	118,000.00	189,980,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	26,820	83,400.00	2,236,788,000.00	
COWAY CO LTD	5,058	74,000.00	374,292,000.00	
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	47,300.00	192,984,000.00	
HLB INC	5,006	91,200.00	456,547,200.00	
LG ELECTRONICS INC	11,019	148,000.00	1,630,812,000.00	
KANGWON LAND INC	7,703	24,600.00	189,493,800.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	20,350.00	103,174,500.00	
KAKAO CORP	5,779	440,000.00	2,542,760,000.00	
NAVER CORP	12,485	308,000.00	3,845,380,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,643	957,000.00	1,572,351,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	120,500.00	297,032,500.00	
PEARL ABYSS CORP	921	266,900.00	245,814,900.00	
CJ ENM CO LTD	830	163,000.00	135,290,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	84,300.00	257,199,300.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	115,000.00	118,910,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	881	243,500.00	214,523,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	145,000.00	79,605,000.00	
EMART	1,864	172,000.00	320,608,000.00	

GS RETAIL CO LTD	4,060	35,250.00	143,115,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	437,000.00	338,675,000.00	
KT&G CORP	10,548	81,000.00	854,388,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,968	120,500.00	357,644,000.00	
OTTOGI CORPORATION	68	561,000.00	38,148,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,873	223,000.00	640,679,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,551,000.00	1,482,756,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	83	694,000.00	57,602,000.00	
PACIFIC CORP	3,393	61,100.00	207,312,300.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,871	140,000.00	961,940,000.00	
ALTEOGEN INC	1,894	149,500.00	283,153,000.00	
CELLTRION INC	9,922	312,500.00	3,100,625,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,911	181,700.00	347,228,700.00	
HANMI PHARM CO LTD	499	350,000.00	174,650,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,638	796,000.00	1,303,848,000.00	
SEEGENE INC	1,919	165,000.00	316,635,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	96,800.00	295,143,200.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,470	148,000.00	217,560,000.00	
YUHAN CORPORATION	5,817	72,600.00	422,314,200.00	
HANA FINANCIAL GROUP	29,188	38,250.00	1,116,441,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	8,630.00	244,487,900.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	38,842	45,200.00	1,755,658,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,219	33,050.00	1,494,487,950.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	9,900.00	588,119,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	87,800.00	404,055,600.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,640.00	174,370,560.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,015	10,000.00	310,150,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	11,650.00	141,046,550.00	
SAMSUNG CARD CO	1,899	32,700.00	62,097,300.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	41,900.00	242,014,400.00	
DB INSURANCE CO LTD	4,209	42,000.00	176,778,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	5,513	21,600.00	119,080,800.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	183,000.00	568,764,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	79,600.00	590,393,200.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	113,000.00	163,963,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	200,000.00	745,000,000.00	
KMW CO LTD	1,901	79,200.00	150,559,200.00	
LG DISPLAY CO LTD	24,071	21,000.00	505,491,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,415	188,500.00	266,727,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	207,000.00	1,159,821,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	481,312	87,000.00	41,874,144,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	82,952	76,400.00	6,337,532,800.00	

	SAMSUNG SDI CO LTD	5,567	732,000.00	4,075,044,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	12,050.00	266,606,250.00	
	SK TELECOM	3,705	245,000.00	907,725,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	24,950.00	660,152,050.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	35,000.00	158,830,000.00	
	SK HYNIX INC	54,791	130,500.00	7,150,225,500.00	
韓国ウォン 小計		1,510,224		125,783,931,060.00 (11,886,581,485)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	99.20	11,134,208.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	42.15	9,870,518.40	
	CHINA STEEL	1,266,261	24.30	30,770,142.30	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	356,061	83.10	29,588,669.10	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	93.20	36,238,396.80	
	NAN YA PLASTICS CORP	501,752	71.70	35,975,618.40	
	TAIWAN CEMENT	486,511	41.75	20,311,834.25	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	1,130.00	13,560,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	27.45	9,553,368.60	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	22,532	441.50	9,947,878.00	
	EVERGREEN MARINE	266,039	32.00	8,513,248.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	30.00	4,500,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	43.20	7,649,035.20	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	402.00	8,014,674.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	189.50	8,233,396.00	
	GIANT MANUFACTURING	34,464	289.50	9,977,328.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	370.00	5,920,000.00	
	POU CHEN	273,780	29.10	7,966,998.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	638.00	19,140,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	264.00	15,719,616.00	
	STANDARD FOODS CORP	35,756	57.20	2,045,243.20	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	494,395	67.10	33,173,904.50	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	206.00	4,120,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	17.75	10,327,766.50	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,786,237	19.65	35,099,557.05	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,122,970	24.90	27,961,953.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,002,216	20.90	20,946,314.40	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	772,097	17.90	13,820,536.30	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,056,339	29.10	30,739,464.90	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	11.35	13,130,690.15	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	965,570	13.05	12,600,688.50	
	TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	9.48	4,744,275.48	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,087,289	19.90	21,637,051.10	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	41.10	13,598,387.10	

CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,302	168.50	23,135,387.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	21.30	22,496,186.70	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	759,123	41.35	31,389,736.05	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.31	11,700,621.80	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	326,258	22.60	7,373,430.80	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	710,082	47.25	33,551,374.50	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	8.49	10,150,109.13	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	113,432	44.40	5,036,380.80	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	40.00	5,906,400.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	283.00	13,584,000.00	
ACER INC	255,803	24.35	6,228,803.05	
ADVANTECH CO LTD	43,336	393.00	17,031,048.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	76,092	285.00	21,686,220.00	
AU OPTRONICS CORP	945,090	14.70	13,892,823.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	208.00	14,497,600.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	87.40	5,400,620.80	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	13.80	10,695,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	21.50	9,282,840.00	
DELTA ELECTRONICS INC	198,903	294.00	58,477,482.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	76.00	7,056,600.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,250,248	115.00	143,778,520.00	
INVENTEC CO LTD	280,511	23.50	6,592,008.50	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,040	2,880.00	28,915,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	53.10	11,971,501.20	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	132.50	7,950,000.00	
PEGATRON CORP	200,474	79.00	15,837,446.00	
QUANTA COMPUTER INC	286,270	82.60	23,645,902.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	46.85	6,001,485.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	96.40	9,640,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	234.50	6,331,500.00	
WISTRON CORP	242,695	30.75	7,462,871.25	
WIWYNN CORP	8,000	802.00	6,416,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	143,692	43.30	6,221,863.60	
YAGEO CORPORATION	38,764	608.00	23,568,512.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	117.00	7,010,874.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	366,315	111.00	40,660,965.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	61.00	9,577,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	143,200	98.20	14,062,240.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	314,315	105.50	33,160,232.50	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,765.00	5,295,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	666.00	15,984,000.00	
MEDIATEK INC	152,804	879.00	134,314,716.00	

	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	86.80	9,982,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	410.00	23,798,450.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	386.00	4,477,214.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	69,770	101.50	7,081,655.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	469.00	23,892,736.00	
	SILERGY CORP	7,000	2,745.00	19,215,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,487,389	627.00	1,559,592,903.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	53.00	64,130,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	118.50	10,546,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	445.00	14,240,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	26.60	9,283,400.00	
新台湾ドル 小計		33,113,782		3,185,741,119.91 (11,819,099,554)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	413.45	27,337,314.00	
	COAL INDIA LTD	84,540	140.10	11,844,054.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	231.90	13,780,657.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	98.55	19,095,540.75	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	98.10	24,790,752.90	
	PETRONET LNG LTD	83,779	249.35	20,890,293.65	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	288,002	2,016.40	580,727,232.80	
	ACC LTD	5,315	1,712.40	9,101,406.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	261.95	19,261,969.35	
	ASIAN PAINTS LTD	37,699	2,645.05	99,715,739.95	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	789.50	23,249,985.50	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,031.90	32,534,775.10	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	147,807	251.55	37,180,850.85	
	JSW STEEL LTD	80,284	395.40	31,744,293.60	
	PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,230.20	18,169,439.40	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,736.35	21,301,541.80	
	SHREE CEMENT LTD	901	24,374.50	21,961,424.50	
	TATA STEEL LTD	67,202	681.10	45,771,282.20	
	ULTRATECH CEMENT LTD	12,469	5,490.10	68,456,056.90	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	564.00	30,571,056.00	
	VEDANTA LTD	198,772	174.00	34,586,328.00	
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,019.20	23,926,739.20	
	LARSEN & TOUBRO LTD	62,365	1,369.85	85,430,695.25	
	SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,679.65	9,953,605.90	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	45,467	532.80	24,224,817.60	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	437.00	11,560,835.00	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,664.75	13,917,310.00	
	BAJAJ AUTO LTD	5,820	3,641.00	21,190,620.00	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	1,637.35	14,459,437.85	

BHARAT FORGE LTD	30,322	599.20	18,168,942.40	
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,883.50	42,344,197.50	
HERO MOTOCORP LTD	12,238	3,232.90	39,564,230.20	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	83,591	808.05	67,545,707.55	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,994	7,922.60	110,868,864.40	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	159.50	19,845,947.00	
MRF LTD	133	87,197.55	11,597,274.15	
TATA MOTORS LTD	190,082	258.65	49,164,709.30	
PAGE INDUSTRIES LTD	601	28,307.20	17,012,627.20	
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	1,519.90	49,989,511.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	2,801.75	24,616,175.50	
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	4,927.40	38,704,727.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	225.05	17,885,398.65	
TRENT LTD	19,255	677.75	13,050,076.25	
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	2,778.40	48,688,681.60	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,155	3,601.25	36,570,693.75	
ITC LTD	289,062	218.85	63,261,218.70	
NESTLE INDIA LIMITED	3,198	17,754.70	56,779,530.60	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	582.70	35,552,275.10	
UNITED SPIRITS LTD	32,483	628.75	20,423,686.25	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,556.10	14,885,652.60	
DABUR INDIA LTD	58,111	541.40	31,461,295.40	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	786.70	30,259,628.80	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	82,607	2,363.15	195,212,732.05	
MARICO LTD	42,465	417.15	17,714,274.75	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	2,645.50	26,756,587.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	924.25	32,732,313.75	
BIOCON LTD	58,256	451.60	26,308,409.60	
CIPLA LTD	49,816	822.45	40,971,169.20	
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,599.45	53,207,069.90	
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	5,088.90	64,344,051.60	
IPCA LABORATORIES LTD	9,167	2,128.50	19,511,959.50	
LUPIN LTD	26,552	1,089.20	28,920,438.40	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	78,858	596.55	47,042,739.90	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,750.90	16,807,999.00	
AXIS BANK LTD	229,173	668.75	153,259,443.75	
BANDHAN BANK LTD	74,811	362.30	27,104,025.30	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	171,928	2,656.95	456,804,099.60	
ICICI BANK LTD	515,102	546.45	281,477,487.90	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	56,150	1,887.00	105,955,050.00	
STATE BANK OF INDIA	187,504	298.60	55,988,694.40	
YES BANK LTD	1,020,164	17.90	18,260,935.60	

	BAJAJ FINANCE LTD	28,025	4,959.15	138,980,178.75	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	3,204.60	13,122,837.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,207.85	15,005,120.55	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,591.55	18,656,149.10	
	REC LTD	48,168	147.50	7,104,780.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,228.35	26,060,673.60	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	8,924.15	34,697,095.20	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	74,097	698.55	51,760,459.35	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,550	1,510.00	35,560,500.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	515.55	16,359,432.60	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	41,424	904.40	37,463,865.60	
	DLF LTD	56,420	289.00	16,305,380.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	109,406	983.85	107,639,093.10	
	INFOSYS LTD	343,887	1,316.65	452,778,818.55	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,091.35	23,549,810.60	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	93,766	3,260.70	305,742,796.20	
	TECH MAHINDRA LTD	62,414	992.50	61,945,895.00	
	WIPRO LTD	118,712	430.25	51,075,838.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	128,919	592.30	76,358,723.70	
	INDUS TOWERS LTD	35,804	258.25	9,246,383.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	992.85	42,275,553.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	139.65	24,406,351.20	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	557.55	14,899,966.20	
	NTPC LTD	394,110	99.65	39,273,061.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	199.65	40,202,522.25	
インドルピー 小計		7,889,115		5,583,827,871.70 (7,984,873,856)	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	112.47	8,210,310.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	139.45	9,273,425.00	
	MCB BANK LTD	53,300	196.01	10,447,333.00	
パキスタンルピー 小計		192,800		27,931,068.00 (18,155,194)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	57,358	19.15	1,098,405.70	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	83,310	3.47	289,335.63	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.06	914,485.50	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	11.70	2,302,419.60	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.42	901,635.80	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.52	1,837,560.80	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	9.22	908,713.98	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	17.21	1,965,898.30	
	QATAR NATIONAL BANK	489,714	18.50	9,059,709.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.44	713,765.60	

	OOREDOO QSC	72,800	8.33	606,424.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	18.32	1,143,552.72	
カタールリアル 小計		2,437,125		21,741,906.63 (618,339,824)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	155.17	3,494,428.40	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	5,158	290.75	1,499,688.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,544.50	9,450,795.50	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,424	336.10	13,250,406.40	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	133.75	12,987,392.50	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	64.65	3,639,859.65	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	79,345	221.86	17,603,481.70	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	652.00	3,502,544.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	212.70	7,221,165.00	
	SASOL LTD	57,207	172.01	9,840,176.07	
	SIBANYE STILLWATER LTD	252,042	61.92	15,606,440.64	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	164.57	4,558,918.14	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	130.18	5,276,065.22	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	176.84	5,041,708.40	
	NASPERS LTD-N SHS	44,032	3,450.00	151,910,400.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	40.70	4,497,146.50	
	BID CORP LTD	35,017	271.79	9,517,270.43	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	276.30	7,438,272.30	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,265	140.94	6,238,709.10	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	195.17	4,542,386.58	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	212.65	2,769,340.95	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	145.59	5,422,353.96	
	ABSA GROUP LTD	73,296	119.50	8,758,872.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,974	1,428.20	9,960,266.80	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	128.99	4,906,392.63	
	STANDARD BANK GROUP LTD	127,912	129.79	16,601,698.48	
	FIRSTRAND LTD	500,947	50.08	25,087,425.76	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	272.98	4,691,707.26	
	REMGRO LTD	55,441	103.50	5,738,143.50	
	DISCOVERY LIMITED	48,488	142.13	6,891,599.44	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	12.24	5,992,850.88	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	32.73	3,314,501.64	
	SANLAM LTD	167,172	57.51	9,614,061.72	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	33,499	91.30	3,058,458.70	
	MTN GROUP LTD	173,000	63.49	10,983,770.00	
	VODACOM GROUP	62,331	123.40	7,691,645.40	
南アフリカランド 小計		2,980,716		428,600,344.15 (2,974,486,388)	

アラブ首長国連邦ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	331,172	6.66	2,205,605.52	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	61,141	5.08	310,596.28	
	DUBAI ISLAMIC BANK	215,945	5.08	1,097,000.60	
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	11.45	3,037,639.20	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	14.98	4,243,264.76	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	3.33	1,223,904.87	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.95	350,303.85	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.13	1,590,215.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	174,383	20.80	3,627,166.40	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		2,263,421		17,685,696.68 (501,212,643)	
クウェートディナール	AGILITY	129,938	0.73	96,024.18	
	BOUBYAN BANK K.S.C	123,828	0.57	71,077.27	
	GULF BANK	107,146	0.21	23,250.68	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	402,865	0.70	283,214.09	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	629,392	0.85	536,871.37	
	MABANEE CO KPSC	63,211	0.71	45,385.49	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.63	135,880.00	
クウェートディナール 小計		1,671,380		1,191,703.08 (409,433,427)	
香港・オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	5.77	524,493.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	18.74	374,800.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	4.26	426,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	11.07	423,981.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	6.07	532,946.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	10.16	621,792.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	3.46	568,478.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	55.07	1,621,260.80	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.21	240,327.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	18,150	47.37	859,765.50	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	14.46	772,164.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	125.59	1,004,720.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5,000	38.13	190,650.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	38.21	1,417,591.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	20.61	206,100.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.16	534,760.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.80	288,000.00	
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	11.15	430,055.50	
	KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	23.27	707,408.00	
	LOMON BILLIONS GROUP CO -A	15,300	39.67	606,951.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.08	457,808.00	
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	32,300	32.19	1,039,737.00	

SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	23.14	167,811.28	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	13,800	41.58	573,804.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	5,100	44.31	225,981.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	4,000	100.50	402,000.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	84.82	508,920.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	14.34	58,794.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	25.25	247,450.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.27	485,894.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	107.49	1,881,075.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	89.09	821,409.80	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	130.16	1,353,664.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	78.55	447,735.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	14.60	344,560.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.44	286,960.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	66.80	761,520.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	34.36	584,120.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	11,100	81.58	905,538.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	49.36	414,624.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	6.67	644,322.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	110,200	4.39	483,778.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.06	1,067,154.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	366.11	4,905,874.00	
EAST GROUP CO LTD-A	52,700	7.54	397,358.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	91.50	692,929.50	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	37.00	214,600.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	44.39	603,704.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	116.69	1,336,800.64	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	29.31	1,424,466.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.03	657,696.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	39.30	1,646,670.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,400	93.41	1,905,564.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	83.90	839,000.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	8.64	195,264.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	18.75	810,000.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	14.35	288,592.85	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	37.64	1,189,424.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	103.50	854,910.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	24.41	1,151,907.90	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	14.43	639,249.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	11.36	909,936.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.51	605,306.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	93.47	1,028,170.00	

AIR CHINA LTD-A	25,900	7.20	186,480.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	5.52	588,984.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.65	186,000.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.64	812,072.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	13.15	407,650.00	
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	91.50	1,857,450.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	71.65	381,106.35	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.72	209,568.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	51.62	428,446.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	16.48	359,923.20	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	23,820	19.80	471,636.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	53.54	1,997,042.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	29.52	1,012,536.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	29.00	849,700.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	23.69	1,009,194.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	74.80	456,429.60	
NAVINFO CO LTD-A	33,200	15.78	523,896.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	130.10	1,001,770.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	33.76	877,760.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	3,000	27.49	82,470.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	9.08	926,160.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	79.85	638,800.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.20	570,960.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	15.71	525,970.80	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	12.73	682,328.00	
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	12.09	205,530.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	11.68	1,628,192.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	82.60	1,346,380.00	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	9.51	156,915.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	9.12	751,123.20	
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	26.33	600,324.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	30.35	743,575.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	6.60	405,900.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	268.15	3,271,430.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	24.69	419,730.00	
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	7.57	346,706.00	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	76.55	658,330.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,800	95.93	748,254.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	7.28	294,840.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	55.20	590,640.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	223.50	357,600.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	66.22	145,684.00	

BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	9.78	581,910.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	66.98	689,894.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	58.06	580,600.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	121.57	960,403.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	47.00	216,200.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	14,160	200.19	2,834,690.40	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	3,000	184.35	553,050.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	27.40	750,760.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	63.46	1,078,820.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	48.96	58,752.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	46.14	1,582,694.28	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	57.99	1,003,227.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	190.61	1,734,551.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	16.99	470,623.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	66.56	765,440.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	82.10	574,700.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	2,009.41	15,271,516.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	229.87	2,252,726.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	23,970	82.09	1,967,697.30	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	22.20	594,960.00	
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	14,000	43.28	605,920.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	358.00	2,398,600.00	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	37.19	1,175,204.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.29	697,946.40	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	281.50	5,967,800.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	18.47	97,891.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	24.28	721,116.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,914	70.60	1,264,728.40	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	142.29	711,450.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	132.98	377,397.24	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	27.35	265,842.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	74.47	919,704.50	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	29.27	526,860.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	18.75	195,000.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	28.50	421,800.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	13.30	330,372.00	
OVCTEK CHINA INC-A	5,150	86.78	446,917.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	425.91	2,257,323.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	281.13	562,260.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	14.50	548,535.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,800	295.20	1,121,760.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	23,400	39.80	931,320.00	

BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	148.62	817,410.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	451.00	992,200.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	39.81	609,093.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	25.94	264,588.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	132.30	1,309,770.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	36.98	820,697.14	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.78	476,480.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	159.06	1,272,480.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	51.20	965,120.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	31,752	104.95	3,332,372.40	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	16,380	34.00	556,920.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.39	473,699.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	140.01	952,068.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	30.49	213,430.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	18.18	204,197.76	
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	103,300	4.40	454,520.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	11.91	232,245.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	35.25	599,250.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	13,720	143.38	1,967,173.60	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	17.83	465,363.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	131.51	933,721.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	283.50	1,105,650.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	27.38	246,967.60	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	39.26	950,092.00	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	71.01	688,797.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.20	1,131,520.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.92	285,360.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.60	454,940.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	5.59	420,032.60	
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	8.48	428,240.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	38.89	933,360.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.37	380,835.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.95	868,055.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	4.21	542,669.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	51.85	5,439,065.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.27	1,441,872.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.31	753,414.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.20	1,358,240.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	23.88	2,273,376.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	22.34	2,667,396.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.36	758,440.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.16	1,405,128.00	

AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	4.42	541,450.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	11.61	512,001.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	8.18	162,782.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	12.41	579,547.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	73,060	25.17	1,838,920.20	
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	30.45	1,315,440.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	42.22	1,017,502.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	34,900	37.04	1,292,696.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	17.72	63,792.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	7.98	480,396.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	9.09	752,652.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	17.40	1,054,440.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	127.00	685,800.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	7.38	320,292.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	19.14	602,910.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	8.74	768,246.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	11.73	500,871.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	11.12	352,504.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	45,800	13.76	630,208.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.14	1,065,008.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	5.22	595,080.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	5.77	545,842.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	13.95	609,615.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	42.20	768,040.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	86.80	5,798,240.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	11.81	214,942.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	13.65	746,655.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	31.28	1,679,736.00	
GEMDALE CORP-A	45,500	13.06	594,230.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	6.15	723,240.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	8.42	592,431.20	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.10	1,316,980.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	40.10	513,280.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	17.79	151,215.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	140,000	3.15	441,000.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	16.66	448,154.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	30.30	409,050.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	17.80	512,640.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	78.01	522,667.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	8.27	460,639.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	97.50	887,250.00	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	46.70	504,360.00	

SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	279.63	838,890.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	4,700	63.48	298,356.00	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	143.60	789,800.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	38,870	45.59	1,772,083.30	
ADDSINO CO LTD -A	5,800	25.21	146,218.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	74.50	998,300.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	6.52	747,192.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	40.26	1,127,280.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	18.70	650,760.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	24.27	504,816.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	15.10	681,010.00	
GOERTEK INC -A	26,900	42.65	1,147,285.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	11.81	590,500.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	103.59	725,130.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	30.38	598,850.56	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	38.74	650,832.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	55.71	2,587,729.50	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	600	660.00	396,000.00	
NINESTAR CORP-A	18,543	27.04	501,402.72	
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	14.04	439,452.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	27.30	663,390.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	131.40	625,464.00	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	20.88	490,680.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	40.18	538,412.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	25.72	733,020.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	16.22	762,340.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	24.75	453,915.00	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	19.67	55,076.00	
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	43,600	11.36	495,296.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	127.15	534,030.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	21,080	46.35	977,058.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	79.53	894,712.50	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	23.48	711,444.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	56.40	490,680.00	
ZTE CORP-A	12,600	35.86	451,836.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	5.10	886,380.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	19.40	2,599,600.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	8.84	597,584.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.21	781,500.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	4.37	360,525.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,480	225.00	1,008,000.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	25.60	192,000.00	

	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	24,000	102.50	2,460,000.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	231.01	716,131.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	32.87	1,334,522.00	
	SG MICRO CORP-A	1,400	313.98	439,572.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	155.70	404,820.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	28.76	848,420.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	16.05	525,637.50	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	29.38	660,051.08	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	128.81	631,169.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	314.89	1,700,406.00	
香港・オフショア人民元 小計		11,756,385		252,833,318.10 (4,055,446,422)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	14.40	339,249.60	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	218,286	34.90	7,618,181.40	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	65.10	638,240.40	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	13.66	436,136.48	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,868	93.00	1,754,724.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	18.60	600,463.80	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	42.10	1,893,826.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	92,341	103.60	9,566,527.60	
	SAUDI CEMENT	7,489	65.40	489,780.60	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	26.65	561,222.35	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	14.50	958,653.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	65.90	1,750,040.40	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	77.70	344,366.40	
	JARIR MARKETING CO	7,199	173.40	1,248,306.60	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	125.00	465,625.00	
	ALMARAI CO	30,130	54.70	1,648,111.00	
	SAVOLA	25,336	41.60	1,053,977.60	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,778	115.40	320,581.20	
	AL RAJHI BANK	124,491	74.20	9,237,232.20	
	ALINMA BANK	109,956	16.42	1,805,477.52	
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	20.68	1,191,953.84	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	13.62	487,773.06	
	BANK ALBILAD	45,859	28.85	1,323,032.15	
	BANQUE SAUDI FRANSI	69,061	34.25	2,365,339.25	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	148,781	45.25	6,732,340.25	
	RIYAD BANK	138,943	21.48	2,984,495.64	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	31.60	3,213,182.80	
	SAUDI BRITISH BANK	71,793	26.25	1,884,566.25	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	120.20	728,772.60	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	80.70	533,669.10	

	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	8.70	409,700.40	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.11	420,763.57	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	29.25	1,006,609.50	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	13.70	368,406.70	
	SAUDI TELECOM CO	60,999	113.20	6,905,086.80	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	22.26	2,052,839.46	
サウジアラビアリアル 小計		1,891,369		75,339,254.92 (2,091,417,716)	
合　計		250,672,331		87,674,234,403 (87,674,234,403)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	5,380,976.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	5,380,976.00 (28,465,363)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	2,416,810.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,972,323.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	788,040.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,881,798.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	27,469	1,136,941.91	
	ブラジルレアル 小計		179,869	8,195,912.91 (159,082,669)	
投資信託受益証券合計			238,269	187,548,032 (187,548,032)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	6,864,984.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	6,864,984.00 (36,315,765)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	3,393,040.50	
	南アフリカランド 小計		295,047	3,393,040.50 (23,547,701)	
投資証券合計			603,447	59,863,466 (59,863,466)	
合計				247,411,498 (247,411,498)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　59銘柄	100.0%	—	—	15.7%
メキシコペソ	株式　23銘柄	95.7%	—	—	1.6%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	2.4%	0.0%
ブラジルレアル	株式　50銘柄	96.2%	—	—	4.6%
	投資信託受益証券　5銘柄	—	3.8%	—	0.2%
チリペソ	株式　14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　3銘柄	100.0%	—	—	0.1%
イギリスポンド	株式　1銘柄	100.0%	—	—	0.1%
トルコリラ	株式　14銘柄	100.0%	—	—	0.4%
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　14銘柄	100.0%	—	—	0.6%
香港ドル	株式　195銘柄	100.0%	—	—	22.3%
マレーシアリンギット	株式　38銘柄	100.0%	—	—	1.4%
タイバーツ	株式　43銘柄	100.0%	—	—	1.8%
フィリピンペソ	株式　20銘柄	100.0%	—	—	0.7%
インドネシアルピア	株式　22銘柄	100.0%	—	—	1.3%
韓国ウォン	株式　105銘柄	100.0%	—	—	13.5%
新台湾ドル	株式　87銘柄	100.0%	—	—	13.4%
インドルピー	株式　96銘柄	100.0%	—	—	9.1%
パキスタンルピー	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.0%
カタールリアル	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.7%
南アフリカランド	株式　36銘柄	99.2%	—	—	3.4%
	投資証券　1銘柄	—	—	0.8%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.6%
クウェートディナール	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.5%
香港・オフショア人民元	株式　284銘柄	100.0%	—	—	4.6%
サウジアラビアリアル	株式　36銘柄	100.0%	—	—	2.4%

(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。

2【ファンドの現況】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

【純資産額計算書】

（2021年 2月26日現在）

Ⅰ　資産総額	8,732,208,659円
Ⅱ　負債総額	9,953,196円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	8,722,255,463円
Ⅳ　発行済口数	4,849,405,677口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7986円
（1万口当たり純資産額）	（17,986円）

（参考）

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 2月26日現在）

Ⅰ　資産総額	616,505,109,900円
Ⅱ　負債総額	10,829,102,797円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	605,676,007,103円
Ⅳ　発行済口数	434,122,212,603口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3952円
（1万口当たり純資産額）	（13,952円）

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 2月26日現在）

Ⅰ　資産総額	451,645,305,758円
Ⅱ　負債総額	1,634,087,031円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	450,011,218,727円
Ⅳ　発行済口数	252,606,378,179口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7815円
（1万口当たり純資産額）	（17,815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 2月26日現在）

Ⅰ　資産総額	285,162,600,309円
Ⅱ　負債総額	428,192,268円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	284,734,408,041円
Ⅳ　発行済口数	96,070,399,531口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9638円
（1万口当たり純資産額）	（29,638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 2月26日現在）

Ⅰ　資産総額	476,405,171,983円
Ⅱ　負債総額	781,021,562円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	475,624,150,421円
Ⅳ　発行済口数	143,456,227,057口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3155円
（1万口当たり純資産額）	（33,155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 2月26日現在）

Ⅰ　資産総額	64,659,706,753円
Ⅱ　負債総額	37,908,712円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	64,621,798,041円
Ⅳ　発行済口数	37,549,945,518口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7210円
（1万口当たり純資産額）	（17,210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 2月26日現在）

Ⅰ　資産総額	92,257,743,914円
Ⅱ　負債総額	157,706,663円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	92,100,037,251円
Ⅳ　発行済口数	24,833,151,994口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7088円
（1万口当たり純資産額）	（37,088円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 2月26日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2021年 4月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年2月26日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	524	14,079,487
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	294,131
単位型公社債投資信託	43	281,810
合計	645	14,655,429

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
また、第35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から資本金への振替					－
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		△30	△30	△30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	－	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	0	－	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から資本金への振替				－
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				△30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
その他資本剰余金から資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			

当期変動額合計	―	―	―
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から資本金への振替					―
会社分割による増加					―
剰余金の配当	230		△2,536	△2,305	△2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	―	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から資本金への振替				―
会社分割による増加				―
剰余金の配当				△2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△980	151	△829	△829
当期変動額合計	△980	151	△829	6,022
当期末残高	△587	284	△302	56,464

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

６．引当金の計上基準

（1）貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

（2）賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

（3）退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

７．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

８．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

９．連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項
該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項
該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

４．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２．金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2019年3月31日）　（単位：百万円）

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

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

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2020年3月31日）　　（単位：百万円）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

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

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

(3) 未収委託者報酬、 及び(4)未収運用受託報酬
　これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券
　これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

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

(7) デリバティブ取引
　（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

(注2)　時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位:百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難 と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日） （単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	－	－	－
未収委託者報酬	6,351	－	－	－
未収運用受託報酬	5,525	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020年3月31日） （単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	－	－	－
未収委託者報酬	7,284	－	－	－
未収運用受託報酬	5,842	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	9	5,605	－

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

前事業年度（2019年3月31日） （単位：百万円）

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

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

当事業年度（2020年3月31日）　（単位：百万円）

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

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

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

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

(2) 株式関連

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

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

当事業年度（2020年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

(2) 株式関連

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

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,819	－	△44
	英ポンド		2,660	－	△67
	カナダドル		6	－	△0
	スイスフラン		35	－	△0
	香港ドル		71	－	△1
	ユーロ		72	－	△0
合計			5,666	－	△114

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要
　　当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

２．確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	△38	△11
退職給付債務の期末残高	537	600

（2）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

（3）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用　前事業年度79百万円　　当事業年度74百万円

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

４．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （2019年3月31日）		当事業年度 （2020年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	〃	99	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	〃	183	〃
有価証券評価差額	―		259	〃
その他	82	〃	151	〃
繰延税金資産 合計	413	〃	862	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△173	〃	―	
繰延ヘッジ損益	△58	〃	△125	〃
その他	△38	〃	△35	〃
繰延税金負債 合計	△271	〃	△161	〃
繰延税金資産の純額	141	〃	700	〃

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	 18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	―	―

（注）1．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

③ 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

④ 吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

（注）1．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2020年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第35期中間会計期間末 （2020年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745
固定資産		
有形固定資産	※1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106
固定資産合計		19,252
資産合計		66,997
負債の部		
流動負債		
未払金		7,364
未払法人税等		473

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

（単位：百万円）

	第35期中間会計期間末 （2020年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	35,114
利益剰余金合計	37,714
株主資本合計	56,953
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	251
繰延ヘッジ損益	299
評価・換算差額等合計	551
純資産合計	57,504
負債・純資産合計	66,997

中間損益計算書

（単位：百万円）

		第35期中間会計期間 （自　2020年4月1日 至　2020年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	※1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	※2	1,933

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

中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		△3,857	△3,662	△3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	194	－	△8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△587	284	△302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				△3,662
中間純利益				3,848

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

重要な会計方針

第35期中間会計期間
（自　2020年4月1日
至　2020年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法
有価証券
子会社株式
移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券
時価のあるもの
中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。
（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）
時価のないもの
移動平均法による原価法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法
時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法
(1) 有形固定資産
定額法によっております。
(2) 無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．引当金の計上基準
(1) 賞与引当金
従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。
(2) 退職給付引当金
従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

7．ヘッジ会計の会計処理
(1) ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

８．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

９．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

１０．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

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

（単位：百万円）

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

(*1)負債に計上されているものについては、(　　)で示しております。

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

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

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、 及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

（有価証券関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

１．子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

（デリバティブ取引関係）

第35期中間会計期間（自　2020年4月1日　至　2020年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

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

2．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,865	－	△82	△82
合計		10,865	－	△82	△82

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

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

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第35期中間会計期間（自　2020年4月1日　至　2020年9月30日）

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

（関連情報）

第35期中間会計期間（自　2020年4月1日　至　2020年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）
第35期中間会計期間（自　2020年4月1日　至　2020年9月30日）
該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）
第35期中間会計期間（自　2020年4月1日　至　2020年9月30日）
該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）
第35期中間会計期間（自　2020年4月1日　至　2020年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年 4月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2020年7月27日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年3月19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世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2020年1月21日から2021年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2021年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月１日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年４月１日から2020年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

（注）1．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。