

**【表紙】**

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

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

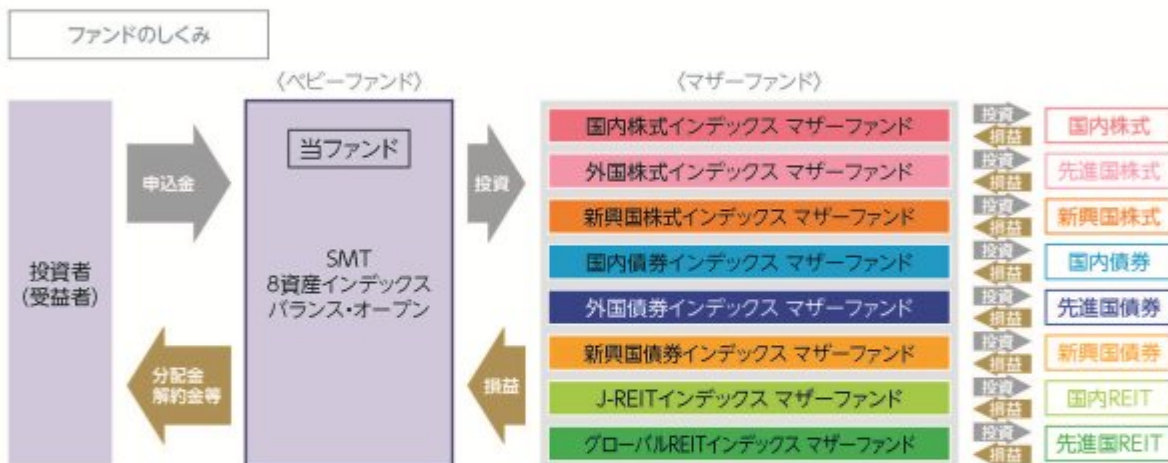
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

#### < ファンドの特色 >

## 特色1

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

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



### ? ファミリーファンド方式とは

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

### ? DR(預託証券)とは

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

### ? REITとは

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

## ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

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

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

詳しくは下記をご覧ください。



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

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

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

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

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

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

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

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

## 分配方針

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

## 主な投資制限

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

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

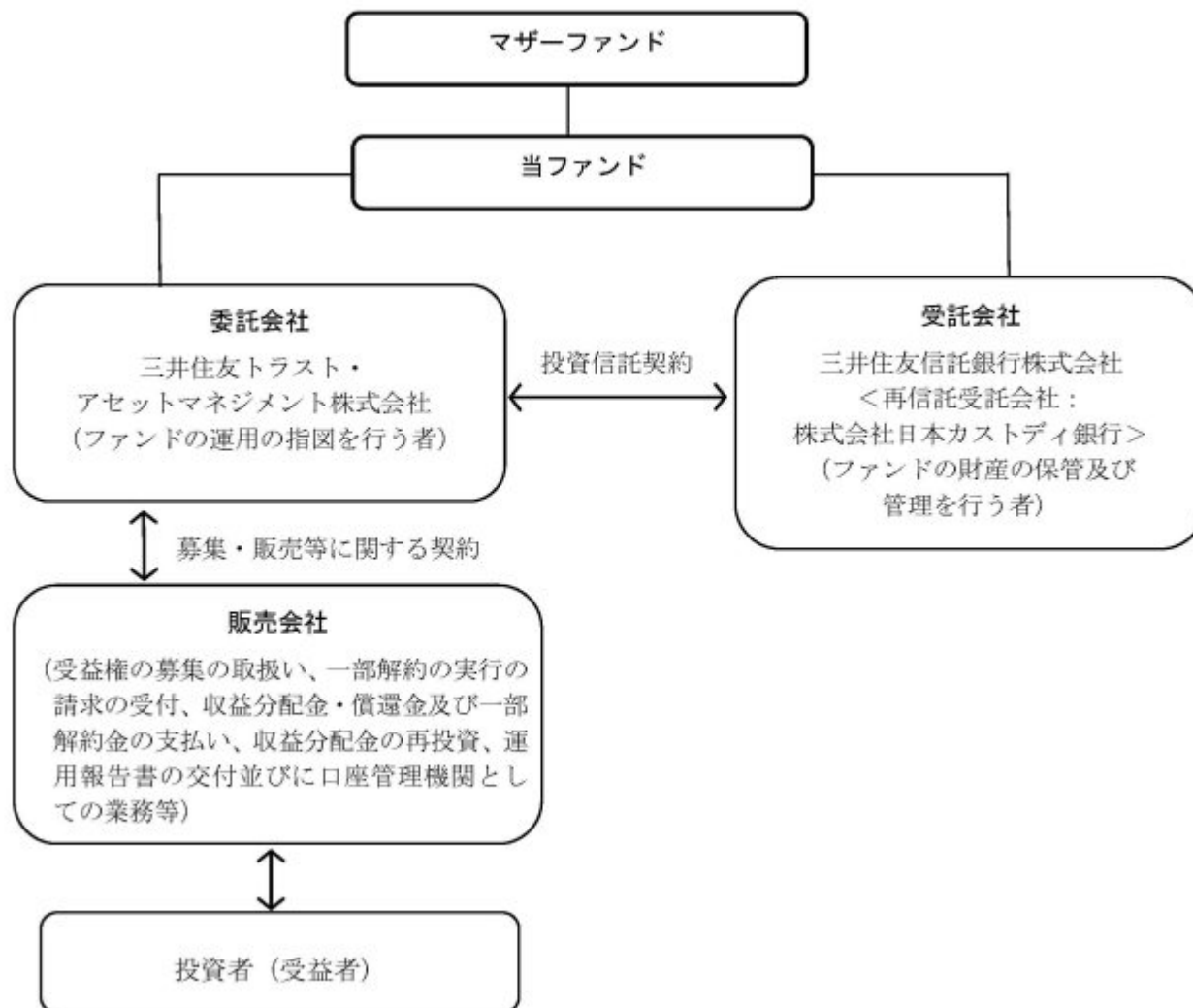
## (2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況（2021年 5月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

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

#### ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 投資対象

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

### 投資態度

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

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

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

## 1. 為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

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

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1．基本方針

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

#### 2．運用方法

##### (1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

#### 3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

もとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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



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

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

なるよう調整を行うこととします。

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

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

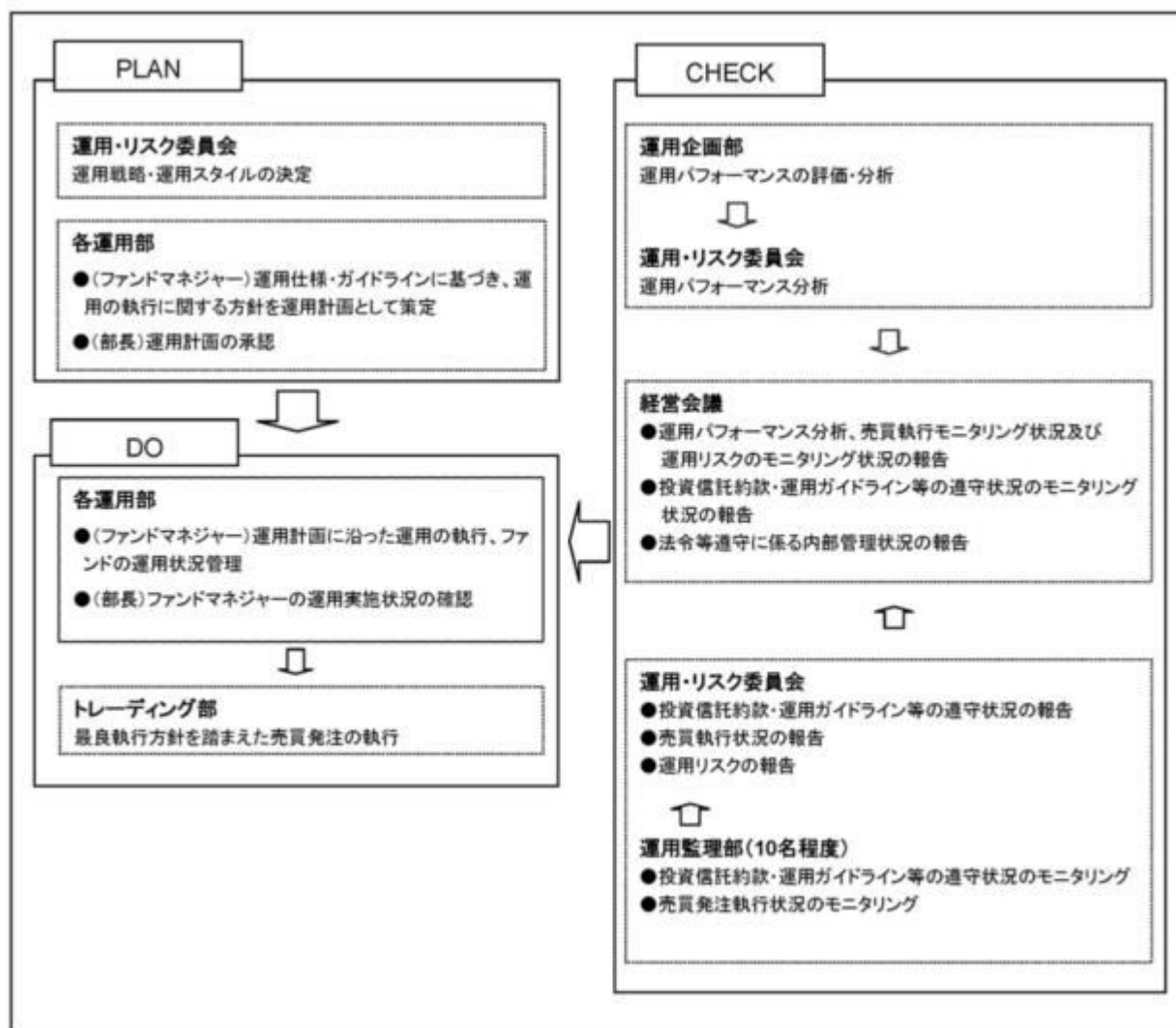
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

## (3)【運用体制】

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

ることがあります。



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ．株式等への投資割合

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

#### ロ．投資信託証券への投資割合

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

#### ハ．外貨建資産への投資割合

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

#### ニ．投資する株式等の範囲

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

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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

す。（以下同じ。）

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

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

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

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

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲



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

#### ル. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

#### ヲ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

#### カ. 資金の借入れ

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

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

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

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### リートの価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 信用リスク

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

### カントリーリスク

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

### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

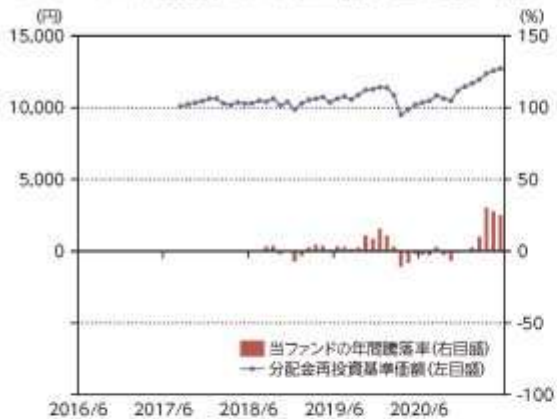
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

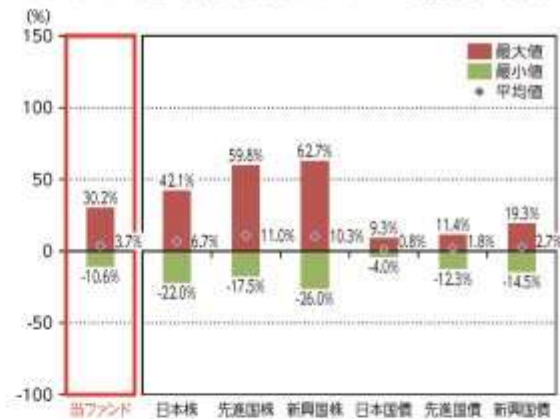
## 〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*当ファンドについては2018年8月～2021年5月の2年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年6月～2021年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- \*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

### 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる報酬に対しても、責任を負いません。
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測る株価指数で、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測る株価指数で、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定期利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入利率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により開発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、本ファンドの差戻、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あり、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、複製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権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEMカンパニイ・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバインツ(円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその発生性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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

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

「分配金再投資コース」(2)において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.55%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

## （4）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マ

ザーファンドにおいて負担する場合があります。 )。

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。 ）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

です。

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2021年5月31日現在のもので、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5月31日現在の状況について記載してあります。

### 【SMT 8資産インデックスパランス・オープン】



## （１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	85,810,687	99.24
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		654,505	0.76
合計（純資産総額）		86,465,192	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	3,221,197	3.7193	11,980,679	3.7583	12,106,224	14.00
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	5,508,249	2.1174	11,663,607	2.1617	11,907,181	13.77
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	5,088,969	2.1495	10,939,109	2.1726	11,056,294	12.79
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	2,892,569	3.7318	10,794,645	3.8002	10,992,340	12.71
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	5,778,508	1.8808	10,868,396	1.8550	10,719,132	12.40
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	5,626,583	1.7683	9,949,629	1.7888	10,064,831	11.64
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	3,260,367	3.0397	9,910,707	3.0717	10,014,869	11.58
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	6,355,501	1.4085	8,952,322	1.4082	8,949,816	10.35

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	99.24
合計	99.24

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】



該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末 (2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
第3期計算期間末 (2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
第4期計算期間末 (2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
第5期計算期間末 (2019年11月11日)	32,350,523	32,350,523	11,176	11,176
第6期計算期間末 (2020年 5月11日)	38,971,244	38,971,244	9,884	9,884
第7期計算期間末 (2020年11月10日)	58,213,200	58,213,200	11,058	11,058
第8期計算期間末 (2021年 5月10日)	83,447,901	83,447,901	12,622	12,622
2020年 5月末日	42,610,218		10,196	
6月末日	45,094,246		10,354	
7月末日	47,888,603		10,467	
8月末日	52,032,382		10,841	
9月末日	53,610,550		10,639	
10月末日	54,789,251		10,476	
11月末日	60,893,010		11,187	
12月末日	64,805,911		11,448	
2021年 1月末日	67,836,156		11,673	
2月末日	73,535,199		11,958	
3月末日	78,921,080		12,365	
4月末日	82,753,531		12,573	
5月末日	86,465,192		12,725	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	0
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	0

第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	0
---------	-------------------------	---

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.7
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	11.6
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	11.9
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	14.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	10,577,572	4,052,049	28,946,438
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	15,251,653	4,770,851	39,427,240
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	16,057,478	2,841,160	52,643,558
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	17,379,718	3,908,644	66,114,632

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	455,964,175,980	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,871,529,851	1.48
合計(純資産総額)		462,835,705,831	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	6,749,750,000	1.46

(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	1,750,200	7,039.23	12,320,064,827	9,115.00	15,953,073,000	3.45
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,082,300	8,032.80	8,693,902,620	10,785.00	11,672,605,500	2.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,345,200	5,893.99	7,928,607,750	8,256.00	11,105,971,200	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,600	47,732.19	8,095,380,860	53,870.00	9,136,352,000	1.97
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,656,200	460.11	5,363,230,300	620.00	7,226,844,000	1.56
日本	株式	任天堂	その他製品	98,900	48,659.61	4,812,436,326	67,700.00	6,695,530,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,182,600	4,004.75	4,736,021,080	5,555.00	6,569,343,000	1.42
日本	株式	信越化学工業	化学	312,900	14,178.39	4,436,419,235	18,855.00	5,899,729,500	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,983,000	2,506.48	4,970,361,249	2,931.50	5,813,164,500	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,437,400	4,050.03	5,821,524,080	3,719.00	5,345,690,600	1.15
日本	株式	日本電産	電気機器	415,900	8,387.20	3,488,239,580	12,530.00	5,211,227,000	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,359,600	3,169.84	4,309,719,103	3,717.00	5,053,633,200	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	101,200	25,973.21	2,628,489,288	48,660.00	4,924,392,000	1.06
日本	株式	HOYA	精密機器	340,000	10,805.04	3,673,715,338	14,350.00	4,879,000,000	1.05
日本	株式	日立製作所	電気機器	830,700	3,785.96	3,145,002,048	5,736.00	4,764,895,200	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	220,100	17,714.03	3,898,858,804	21,605.00	4,755,260,500	1.03
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,179,200	3,214.93	3,791,045,529	3,951.00	4,659,019,200	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,360,300	2,829.73	3,849,286,623	3,353.00	4,561,085,900	0.99
日本	株式	村田製作所	電気機器	507,600	6,790.96	3,447,092,016	8,279.00	4,202,420,400	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	151,600	21,058.12	3,192,411,565	26,300.00	3,987,080,000	0.86

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,315,400	1,387.83	3,213,392,914	1,673.00	3,873,664,200	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,190,100	2,506.00	2,982,393,874	3,249.00	3,866,634,900	0.84
日本	株式	第一三共	医薬品	1,357,700	3,307.39	4,490,443,976	2,530.00	3,434,981,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	50,600	56,792.99	2,873,725,362	65,520.00	3,315,312,000	0.72
日本	株式	三井物産	卸売業	1,357,400	1,734.22	2,354,037,994	2,414.00	3,276,763,600	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	665,700	3,780.07	2,516,398,760	4,736.00	3,152,755,200	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,036,000	2,579.42	2,672,280,578	2,984.00	3,091,424,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,727,600	1,483.00	2,562,036,924	1,692.00	2,923,099,200	0.63
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	561,200	4,858.26	2,726,458,754	5,179.00	2,906,454,800	0.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	175,600	15,952.06	2,801,182,201	16,310.00	2,864,036,000	0.62

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.29
		食料品	3.34
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.27
		医薬品	5.01
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.66
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.61
		機械	5.54
		電気機器	17.52
		輸送用機器	7.52
		精密機器	2.67
		その他製品	2.52
		電気・ガス業	1.21
陸運業	3.27		
海運業	0.27		
空運業	0.47		
倉庫・運輸関連業	0.17		
情報・通信業	8.89		

	卸売業	4.65
	小売業	4.46
	銀行業	5.10
	証券、商品先物取引業	0.81
	保険業	1.92
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.97
	サービス業	5.53
	小計	98.52
合計		98.52

(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	350円		6,850,854,700	6,749,750,000	1.46

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

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

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	337,733,171,533	65.25
	イギリス	22,698,120,946	4.39
	カナダ	18,702,513,626	3.61
	フランス	17,353,631,230	3.35
	スイス	16,922,557,071	3.27
	ドイツ	15,230,237,194	2.94
	オーストラリア	10,525,541,301	2.03
	オランダ	9,807,010,846	1.89
	アイルランド	9,322,692,926	1.80
	スウェーデン	5,830,828,860	1.13
	スペイン	4,246,861,396	0.82

	デンマーク	4,097,445,805	0.79
	香港	3,956,330,338	0.76
	イタリア	3,157,956,874	0.61
	フィンランド	2,071,721,882	0.40
	ジャージー	1,727,609,807	0.33
	シンガポール	1,548,352,937	0.30
	ベルギー	1,465,202,276	0.28
	バミューダ	1,238,003,738	0.24
	ノルウェー	1,066,293,306	0.21
	ケイマン	1,012,447,293	0.20
	イスラエル	963,399,722	0.19
	ニュージーランド	529,289,606	0.10
	ルクセンブルク	529,046,883	0.10
	キュラソー	421,821,486	0.08
	オーストリア	321,899,735	0.06
	ポルトガル	264,760,060	0.05
	パナマ	228,802,535	0.04
	リベリア	197,242,352	0.04
	マン島	127,381,450	0.02
	パプアニューギニア	58,559,406	0.01
	小計	493,356,734,420	95.32
投資信託受益証券	オーストラリア	219,217,878	0.04
	香港	80,837,673	0.02
	小計	300,055,551	0.06
投資証券	アメリカ	9,367,107,819	1.81
	オーストラリア	713,695,039	0.14
	イギリス	309,350,245	0.06
	フランス	285,432,551	0.06
	シンガポール	223,641,258	0.04
	香港	180,453,619	0.03
	カナダ	74,489,713	0.01
	小計	11,154,170,244	2.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,792,938,030	2.47
合計(純資産総額)		517,603,898,245	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,571,050,048	1.85

買建	カナダ	819,767,296	0.16
買建	ドイツ	1,490,482,234	0.29
買建	イギリス	590,142,564	0.11
買建	オーストラリア	409,631,512	0.08

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		1,870,816,968	0.36
	売建		376,402,910	0.07

(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	1,450,831	8,848.85	12,838,187,635	13,677.19	19,843,296,468	3.83
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	619,180	19,996.07	12,381,170,833	27,404.87	16,968,551,617	3.28
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,986	266,094.46	9,841,769,727	353,764.16	13,084,321,340	2.53
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	207,790	24,897.95	5,173,546,776	36,081.40	7,497,355,103	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	25,465	155,865.78	3,969,122,230	264,692.82	6,740,402,804	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,977	156,011.76	4,052,717,655	258,687.85	6,719,934,435	1.30
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	263,503	10,959.53	2,887,870,614	18,026.98	4,750,163,943	0.92
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,189	18,808.47	1,244,914,059	68,624.14	4,542,163,679	0.88
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	226,967	16,138.01	3,662,796,351	18,576.88	4,216,338,723	0.81
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	53,433	37,942.93	2,027,404,814	71,319.85	3,810,833,695	0.74

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	118,353	20,461.45	2,421,675,081	31,768.93	3,759,948,693	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,910	33,373.62	2,733,633,673	45,212.33	3,703,342,704	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	146,419	21,360.39	3,127,567,471	24,948.44	3,652,926,808	0.71
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,795	12,567.70	3,126,781,394	13,546.63	3,370,336,100	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	92,922	27,041.57	2,512,756,879	35,003.56	3,252,600,951	0.63
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	212,538	12,815.57	2,723,797,232	14,801.13	3,145,803,843	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	670,589	2,730.82	1,831,263,754	4,652.72	3,120,067,144	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	156,656	12,871.55	2,016,406,351	19,608.62	3,071,808,601	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	76,521	33,319.84	2,549,667,722	39,577.26	3,028,491,574	0.59
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	95,999	16,461.80	1,580,316,799	28,539.79	2,739,791,799	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	36,125	39,528.19	1,427,956,022	73,864.60	2,668,358,747	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	394,334	4,368.44	1,722,627,574	6,293.63	2,481,795,605	0.48
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,854	41,570.09	2,529,706,312	38,474.79	2,341,345,236	0.45
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	365,193	4,913.95	1,794,542,041	6,406.69	2,339,678,779	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	41,289	42,055.64	1,736,435,386	55,382.70	2,286,696,333	0.44
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	356,926	6,134.48	2,189,557,692	6,200.34	2,213,063,411	0.43
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	350,418	6,728.28	2,357,713,224	6,269.49	2,196,942,567	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	355,696	5,180.67	1,842,744,308	6,068.63	2,158,587,559	0.42
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	38,504	45,654.67	1,757,887,490	55,188.42	2,124,975,139	0.41
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	364,089	4,986.39	1,815,492,224	5,806.30	2,114,011,417	0.41

(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	3.22



素材	4.52
資本財	6.55
商業・専門サービス	1.19
運輸	2.11
自動車・自動車部品	1.91
耐久消費財・アパレル	1.99
消費者サービス	1.88
メディア・娯楽	7.08
小売	5.33
食品・生活必需品小売り	1.32
食品・飲料・タバコ	3.93
家庭用品・パーソナル用品	1.75
ヘルスケア機器・サービス	5.03
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.20
銀行	6.36
各種金融	4.68
保険	3.17
不動産	0.49
ソフトウェア・サービス	11.28
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.34
電気通信サービス	1.71
公益事業	2.92
半導体・半導体製造装置	4.37
小計	95.32
投資信託受益証券	0.06
投資証券	2.15
合計	97.53

(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	415	アメリカドル	85,451,060	9,379,108,346	87,199,800	9,571,050,048	1.85
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	38	カナダドル	8,755,853	795,119,010	9,027,280	819,767,296	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	34	スイスフラン	3,781,238	460,970,724	3,884,840	473,600,844	0.09

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	187	ユーロ	7,374,696.5	986,291,909	7,603,420	1,016,881,390	0.20
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	27	オーストラリアドル	4,688,789	396,577,773	4,843,125	409,631,512	0.08
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	54	イギリスポンド	3,717,087.5	578,378,815	3,792,690	590,142,564	0.11

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	14,880,000.00	1,630,132,800	1,633,216,968	0.32
	スウェーデンクローナ	買建	18,000,000.00	238,694,000	237,600,000	0.05
	ユーロ	売建	2,000,000.00	267,952,000	267,483,400	0.05
	イギリスポンド	売建	700,000.00	109,269,160	108,919,510	0.02

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

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

## 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	22,427,734,682	22.71
	台湾	12,447,216,699	12.61
	韓国	12,308,879,740	12.46
	中国	11,038,856,943	11.18
	インド	9,011,427,823	9.13
	ブラジル	4,519,530,660	4.58
	南アフリカ	3,478,893,135	3.52
	サウジアラビア	2,586,535,438	2.62
	ロシア	2,549,056,235	2.58
	メキシコ	1,580,367,687	1.60
	タイ	1,549,037,574	1.57
	マレーシア	1,192,341,821	1.21
	香港	1,093,791,403	1.11
	インドネシア	1,042,544,563	1.06
	バミューダ	720,283,391	0.73

	ポーランド	637,895,143	0.65
	カタール	616,122,057	0.62
	フィリピン	592,556,404	0.60
	アラブ首長国連邦	545,348,970	0.55
	クウェート	472,849,747	0.48
	チリ	431,733,119	0.44
	アメリカ	387,716,569	0.39
	トルコ	225,864,138	0.23
	オランダ	225,153,419	0.23
	ルクセンブルク	221,642,103	0.22
	ハンガリー	217,057,428	0.22
	コロンビア	130,772,211	0.13
	ギリシャ	126,147,748	0.13
	キプロス	120,849,873	0.12
	チェコ	95,683,091	0.10
	ジャージー	94,893,876	0.10
	エジプト	54,224,105	0.05
	英ヴァージン諸島	49,021,678	0.05
	マン島	25,537,142	0.03
	シンガポール	23,523,587	0.02
	ペルー	21,406,888	0.02
	パキスタン	12,531,825	0.01
	アルゼンチン	8,001,691	0.01
	小計	92,883,030,606	94.06
新株予約権証券	タイ	396,097	0.00
投資信託受益証券	ブラジル	201,063,950	0.20
	メキシコ	31,363,320	0.03
	小計	232,427,270	0.24
投資証券	メキシコ	39,566,986	0.04
	南アフリカ	34,293,017	0.03
	小計	73,860,003	0.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,557,822,255	5.63
合計(純資産総額)		98,747,536,231	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,586,527,161	5.66

(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		213,498,582	0.22
	売建		107,685,749	0.11

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 (円) 単価	帳簿価額 (円) 金額	評価額 (円) 単価	評価額 (円) 金額	投資比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,454,389	1,821.64	4,471,028,035	2,336.98	5,735,882,549	5.81
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	578,800	8,805.74	5,096,767,960	8,505.21	4,922,815,548	4.99
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	190,461	31,750.98	6,047,323,859	23,484.24	4,472,833,663	4.53
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	478,574	5,954.39	2,849,616,659	7,881.83	3,772,043,696	3.82
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	364,500	4,729.82	1,724,020,725	3,749.92	1,366,848,756	1.38
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	43,648	26,790.34	1,169,344,789	24,134.37	1,053,417,047	1.07
ブラジル	株式	VALE SA	素材	393,678	1,389.11	546,863,656	2,344.33	922,914,498	0.93
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	279,072	3,117.06	869,885,285	3,184.09	888,592,039	0.90
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,450,620	83.56	789,763,742	90.49	855,243,308	0.87
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	629,500	1,186.44	746,864,773	1,199.77	755,260,881	0.76
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	332,785	1,727.55	574,904,724	2,135.67	710,720,938	0.72
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	85,581	9,314.23	797,121,425	8,115.65	694,545,819	0.70
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	54,927	8,621.04	473,527,916	12,300.00	675,602,100	0.68
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	170,867	3,290.75	562,281,562	3,862.85	660,033,933	0.67
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	44,003	12,874.82	566,530,992	13,706.82	603,141,588	0.61
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	83,239	5,472.50	455,525,961	7,104.48	591,369,811	0.60

ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	26,907	15,826.29	425,838,103	21,542.59	579,646,609	0.59
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	371.31	521,996,595	404.40	568,511,143	0.58
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	147,804	2,780.62	410,987,054	3,806.52	562,619,030	0.57
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	132,230	4,929.79	651,867,024	4,238.93	560,513,873	0.57
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	334,500	1,169.46	391,186,425	1,627.51	544,403,433	0.55
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	321.63	388,612,670	439.67	531,231,606	0.54
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	40,751	9,641.31	392,893,367	12,943.99	527,480,814	0.53
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	511,368	711.83	364,007,912	977.43	499,829,492	0.51
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	268,967	1,372.79	369,235,466	1,852.19	498,180,677	0.50
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	94,235	4,159.96	392,014,335	4,778.27	450,280,462	0.46
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	575,861	485.13	279,372,744	779.73	449,018,999	0.45
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	12,477	29,626.37	369,648,271	35,227.19	439,529,774	0.45
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	5,924,515	66.45	393,731,418	72.11	427,240,475	0.43
中国	株式	CHINA MERCHANTS BANK-H	銀行	392,423	663.16	260,241,591	1,013.83	397,853,349	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	4.61
		素材	8.20
		資本財	2.49
		商業・専門サービス	0.31
		運輸	1.52
		自動車・自動車部品	3.21
		耐久消費財・アパレル	1.58
		消費者サービス	1.23
		メディア・娯楽	8.45
		小売	9.88
		食品・生活必需品小売り	1.12
		食品・飲料・タバコ	3.27
		家庭用品・パーソナル用品	0.96
		ヘルスケア機器・サービス	1.25
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.50		

	銀行	12.43
	各種金融	2.12
	保険	2.73
	不動産	1.95
	ソフトウェア・サービス	2.37
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.36
	電気通信サービス	2.29
	公益事業	1.80
	半導体・半導体製造装置	8.43
	小計	94.06
新株予約権証券		0.00
投資信託受益証券		0.24
投資証券		0.07
合計		94.37

(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	748	アメリカドル	50,013,751	5,489,509,309	50,897,660	5,586,527,161	5.66

(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	1,619,098.95	177,878,528	177,710,743	0.18
	イギリスポンド	買建	230,000.00	35,902,724	35,787,839	0.04
	ブラジルリアル	売建	42,000.00	863,007	882,357	0.00
	タイバーツ	売建	17,744,007.74	62,281,467	62,281,467	0.06
	インドネシアルピア	売建	884,844,445.00	6,813,302	6,813,302	0.01
	新台湾ドル	売建	9,519,976.00	37,674,352	37,708,623	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。

## 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	525,432,430,000	83.62
地方債証券	日本	34,036,521,966	5.42
特殊債券	日本	39,338,438,637	6.26
社債券	日本	26,659,799,160	4.24
	フランス	1,101,387,000	0.18
	オーストラリア	399,688,000	0.06
	小計	28,160,874,160	4.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,397,905,758	0.22
合計(純資産総額)		628,366,170,521	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	8,240,000,000	100.99	8,321,576,000	100.95	8,318,362,400	0.100	2025/9/20	1.32
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	7,960,000,000	101.20	8,055,599,200	101.05	8,044,137,200	0.100	2028/3/20	1.28
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	100.74	7,848,113,400	0.100	2024/9/20	1.25
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	100.60	7,092,441,000	0.100	2023/12/20	1.13
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	100.54	6,796,706,800	0.100	2023/9/20	1.08
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	100.98	6,705,404,000	0.100	2026/9/20	1.07
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,520,000,000	100.98	6,583,896,000	100.91	6,579,723,200	0.100	2025/6/20	1.05
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	102.24	6,462,136,800	0.400	2025/9/20	1.03
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	101.36	6,436,406,300	101.01	6,414,706,500	0.100	2027/3/20	1.02
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	100.99	6,362,370,000	100.70	6,344,352,000	0.100	2024/6/20	1.01
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	6,150,000,000	100.74	6,195,510,000	100.46	6,178,474,500	0.100	2030/9/20	0.98
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	6,070,000,000	100.89	6,124,055,000	100.66	6,110,062,000	0.100	2024/3/20	0.97
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	5,700,000,000	100.67	5,738,190,000	100.35	5,720,406,000	0.100	2022/12/20	0.91

日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	5,380,000,000	101.31	5,450,478,000	100.96	5,431,863,200	0.100	2026/3/20	0.86
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	5,380,000,000	101.07	5,437,566,000	100.80	5,423,201,400	0.100	2024/12/20	0.86
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	4,900,000,000	102.76	5,035,240,000	102.23	5,009,564,000	0.600	2024/6/20	0.80
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	102.13	4,953,693,000	0.400	2025/6/20	0.79
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	4,880,000,000	101.50	4,953,361,200	101.04	4,930,947,200	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	102.54	4,922,030,800	101.87	4,889,760,000	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	4,820,000,000	101.26	4,881,165,000	100.96	4,866,464,800	0.100	2026/6/20	0.77
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	4,800,000,000	100.98	4,847,190,000	100.85	4,841,232,000	0.100	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,740,000,000	99.97	4,738,702,200	100.33	4,755,736,800	0.100	2030/12/20	0.76
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,690,000,000	101.23	4,747,687,000	100.89	4,732,116,200	0.100	2029/3/20	0.75
日本	国債証券	第416回利付国債（2年）	4,670,000,000	100.45	4,691,015,000	100.30	4,684,056,700	0.100	2022/9/1	0.75
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	4,640,000,000	100.88	4,680,832,000	100.78	4,676,563,200	0.100	2029/9/20	0.74
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,610,000,000	101.47	4,677,767,000	101.02	4,657,252,500	0.100	2028/6/20	0.74
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	102.39	4,669,250,400	102.00	4,651,382,400	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	4,590,000,000	101.85	4,675,151,800	101.20	4,645,447,200	0.800	2022/9/20	0.74
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	4,580,000,000	100.68	4,611,334,800	100.54	4,604,777,800	0.100	2030/6/20	0.73
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	4,400,000,000	100.69	4,430,706,100	100.48	4,421,252,000	0.100	2023/6/20	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.62
地方債証券	5.42
特殊債券	6.26
社債券	4.48
合計	99.78

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。



## 外国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	132,115,094,711	43.42
	フランス	30,970,696,394	10.18
	イタリア	28,417,855,854	9.34
	ドイツ	22,536,372,411	7.41
	イギリス	19,785,369,114	6.50
	スペイン	18,202,803,911	5.98
	ベルギー	7,233,204,858	2.38
	オーストラリア	6,569,251,479	2.16
	カナダ	6,190,083,364	2.03
	オランダ	5,819,811,099	1.91
	オーストリア	4,485,399,337	1.47
	アイルランド	2,501,713,224	0.82
	メキシコ	2,399,051,797	0.79
	ポーランド	1,904,317,299	0.63
	フィンランド	1,846,189,676	0.61
	デンマーク	1,534,167,724	0.50
	マレーシア	1,425,343,880	0.47
	イスラエル	1,356,443,547	0.45
	シンガポール	1,291,459,562	0.42
	スウェーデン	1,091,472,367	0.36
ノルウェー	750,250,784	0.25	
	小計	298,426,352,392	98.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,829,240,629	1.92
合計(純資産総額)		304,255,593,021	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	1,430,303,129	0.47
	買建	ドイツ	1,950,065,614	0.64

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		4,662,029,884	1.53

(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	10,838.07	1,728,672,432	10,121.07	1,614,311,072	0.625	2030/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,425.36	1,569,017,317	10,535.24	1,585,554,372	1.125	2031/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,926.07	1,540,576,191	10,162.23	1,432,874,789	0.625	2030/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	10,958.12	1,424,556,850	10,977.71	1,427,102,950	0.250	2024/3/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	12,371.15	1,329,898,899	11,842.07	1,273,023,062	2.375	2027/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	10,845.01	1,247,176,989	10,855.95	1,248,434,250	0.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,771.88	1,270,345,227	9,557.69	1,242,500,350	1.375	2040/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	10,927.90	1,202,069,868	10,973.85	1,207,124,191	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,835.06	1,282,222,494	12,006.71	1,199,470,828	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,029.43	1,229,408,637	11,619.12	1,187,474,574	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,917.96	1,209,673,317	11,671.00	1,184,606,877	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,708.77	1,194,028,203	10,328.58	1,151,637,512	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,455.34	1,145,534,255	11,271.19	1,127,119,436	2.000	2022/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,997.73	1,116,269,847	11,001.29	1,116,631,572	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,295.41	1,129,541,872	11,165.07	1,116,507,872	1.500	2022/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	13,704.47	1,108,692,210	13,638.67	1,103,368,521	0.000	2025/3/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	10,922.32	1,092,232,736	10,947.27	1,094,727,372	0.125	2024/1/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	24,220.56	1,143,210,844	23,080.71	1,089,409,770	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,980.83	1,157,890,482	12,195.36	1,087,826,558	2.875	2028/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,969.19	1,096,919,488	10,822.93	1,082,293,628	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,320.71	1,081,128,282	11,159.93	1,065,773,670	1.750	2022/5/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,269.66	1,070,618,140	11,176.01	1,061,721,132	1.500	2022/9/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,597.10	1,059,710,848	10,602.13	1,060,213,000	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,242.52	1,095,706,215	11,766.18	1,053,073,672	2.250	2027/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	16,805.01	1,072,159,717	16,379.40	1,045,006,057	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,250.09	1,113,007,560	12,396.02	1,041,265,680	3.125	2028/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,516.12	1,036,451,606	11,340.43	1,020,639,380	1.375	2025/1/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	16,437.51	1,043,782,222	15,982.46	1,014,886,525	3.500	2026/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,377.73	1,023,996,486	11,206.88	1,008,619,373	1.875	2022/7/31	0.33

アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,311.98	1,052,674,717	11,755.46	1,005,092,475	2.250	2027/8/15	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	98.08
合計	98.08

(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	40	アメリカドル	4,954,393.15	543,794,192	4,954,062.4	543,757,889	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	28	アメリカドル	3,695,875.35	405,659,279	3,694,250	405,480,880	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	28	アメリカドル	4,389,640.9	481,806,985	4,382,875	481,064,360	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	20	ユーロ	2,241,032	299,715,620	2,240,900	299,697,966	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	26	ユーロ	3,501,904.6	468,344,720	3,503,240	468,523,317	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	52	ユーロ	8,836,799.2	1,181,833,525	8,836,880	1,181,844,331	0.39

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

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

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	19,207,051.92	2,103,788,621	2,108,040,404	0.69
	カナダドル	買建	2,390,000.00	215,555,524	217,012,000	0.07
	ユーロ	買建	15,010,000.00	1,995,196,603	2,007,812,650	0.66
	イギリスポンド	買建	2,115,544.10	328,089,460	329,164,830	0.11

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	中国	7,088,294,831	9.92
	インドネシア	6,787,684,726	9.50
	メキシコ	6,536,043,714	9.14
	ブラジル	6,045,811,200	8.46
	タイ	6,030,019,526	8.44
	ポーランド	5,779,826,098	8.09
	南アフリカ	5,592,868,017	7.83
	ロシア	5,257,651,534	7.36
	マレーシア	5,141,999,590	7.19
	コロンビア	3,091,555,234	4.33
	チェコ	3,057,008,066	4.28
	ハンガリー	2,836,628,081	3.97
	チリ	1,627,361,106	2.28
	ペルー	1,610,366,890	2.25
	トルコ	1,200,584,651	1.68
	ドミニカ共和国	94,778,346	0.13
	フィリピン	89,896,126	0.13
	ウルグアイ	76,744,386	0.11
	小計	67,945,122,122	95.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,527,872,000	4.94
	合計(純資産総額)	71,472,994,122	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		16,906,581	0.02
	売建		16,900,301	0.02

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビ ア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000	3.82	2,767,775,409	3.54	2,565,175,731	9.850	2027/6/28	3.59
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000	1,759.99	1,474,878,243	1,737.45	1,455,983,988	0.000	2024/1/1	2.04
南アフリ カ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	121,100,000	937.23	1,134,985,618	908.00	1,099,589,575	10.500	2026/12/21	1.54
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	46,650,000	2,292.52	1,069,463,440	2,198.94	1,025,809,984	10.000	2023/1/1	1.44
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,817.87	930,749,612	1,813.94	928,742,154	0.000	2023/7/1	1.30
マレーシ ア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000	2,908.34	792,524,865	2,791.13	760,583,617	3.885	2029/8/15	1.06
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000	2,377.95	798,991,910	2,234.42	750,766,646	10.000	2025/1/1	1.05
マレーシ ア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,827.46	735,142,128	2,797.06	727,236,924	3.955	2025/9/15	1.02
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000	652.87	763,211,475	619.31	723,979,933	8.500	2029/5/31	1.01
南アフリ カ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000	758.22	721,830,511	751.60	715,531,673	8.000	2030/1/31	1.00
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000	2,388.01	749,835,685	2,236.39	702,226,689	10.000	2027/1/1	0.98
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000	428.83	766,329,233	391.63	699,852,227	3.300	2038/6/17	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	613.58	666,661,786	584.12	634,646,938	7.500	2027/6/3	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000	563.64	655,514,187	542.77	631,244,081	5.750	2026/3/5	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	655.79	657,431,094	624.63	626,193,072	10.000	2024/12/5	0.88
マレーシ ア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,752.46	628,938,258	2,719.01	621,294,922	3.480	2023/3/15	0.87
南アフリ カ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	93,600,000	644.65	603,398,076	663.69	621,221,140	8.750	2048/2/28	0.87
ポーラン ド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	3,146.19	626,091,998	3,090.00	614,910,405	2.500	2023/1/25	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	569.13	615,800,110	560.71	606,698,559	6.500	2022/6/9	0.85
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000	1,724.20	586,228,817	1,730.99	588,538,328	2.940	2024/10/17	0.82
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	604.89	592,498,893	585.88	573,878,085	8.000	2023/12/7	0.80
ポーラン ド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	17,600,000	3,304.49	581,591,591	3,166.36	557,279,862	2.500	2026/7/25	0.78
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,682.14	513,053,034	1,705.49	520,176,486	2.850	2027/6/4	0.73
中国	国債証券	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000	1,738.78	511,202,618	1,745.99	513,322,278	3.190	2024/4/11	0.72
コロンビ ア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	17,100,000,000	3.12	533,558,724	2.84	486,717,147	7.250	2034/10/18	0.68
中国	国債証券	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000	1,719.28	481,400,414	1,731.28	484,760,686	3.020	2025/10/22	0.68
ポーラン ド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	3,402.03	512,007,014	3,219.47	484,531,473	2.750	2029/10/25	0.68
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000	434.85	518,345,849	399.23	475,883,245	3.400	2036/6/17	0.67
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000	428.38	489,644,021	409.15	467,662,656	3.650	2031/6/20	0.65

南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000	660.23	453,584,570	674.53	463,404,617	8.500	2037/1/31	0.65
-------	------	--------------------	------------	--------	-------------	--------	-------------	-------	-----------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.06
合計	95.06

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	154,033.25	16,786,877	16,906,581	0.02
	ロシアルーブル	売建	11,342,485.00	16,786,877	16,900,301	0.02

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

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

#### J - REITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	104,705,558,260	96.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,832,240,132	3.53
合計(純資産総額)		108,537,798,392	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
-------	---------	------	---------	----------

不動産投信指数先物取引	買建	日本		3,806,946,000	3.51
-------------	----	----	--	---------------	------

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,532	577,174.42	6,078,800,991	694,000	7,309,208,000	6.73
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,358	553,778.9	5,182,262,946	660,000	6,176,280,000	5.69
日本	投資証券	GLP投資法人	29,241	154,608.66	4,520,911,827	186,900	5,465,142,900	5.04
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	30,261	137,219.39	4,152,395,960	173,400	5,247,257,400	4.83
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	46,610	85,175.81	3,970,044,504	110,800	5,164,388,000	4.76
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	14,794	330,698.85	4,892,358,786	339,500	5,022,563,000	4.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	13,351	245,731.15	3,280,756,583	306,000	4,085,406,000	3.76
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,645	160,390.78	2,990,486,093	203,500	3,794,257,500	3.50
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,013	127,088.48	2,543,421,750	157,000	3,142,041,000	2.89
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,888	305,051.62	2,711,298,798	352,000	3,128,576,000	2.88
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,227	176,882.37	2,339,623,107	196,000	2,592,492,000	2.39
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,826	315,337.73	1,837,157,614	430,500	2,508,093,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	27,523	75,320.64	2,073,049,974	90,600	2,493,583,800	2.30
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,895	636,026.47	1,841,296,630	812,000	2,350,740,000	2.17
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	4,689	404,593.87	1,897,140,656	498,500	2,337,466,500	2.15
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,225	585,719.87	1,888,946,580	634,000	2,044,650,000	1.88
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,147	57,705.11	1,739,635,951	67,200	2,025,878,400	1.87
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,319	162,600.01	1,840,469,513	178,500	2,020,441,500	1.86
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,114	291,125.1	1,779,938,861	309,000	1,889,226,000	1.74
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,266	494,591.48	1,615,335,773	562,000	1,835,492,000	1.69
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	39,128	38,213.41	1,495,214,306	44,600	1,745,108,800	1.61
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,992	132,581.2	1,457,332,550	157,800	1,734,537,600	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,105	380,403.13	1,181,151,718	504,000	1,564,920,000	1.44
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,994	632,501.54	1,261,208,070	778,000	1,551,332,000	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人	9,491	124,612.01	1,182,692,586	154,100	1,462,563,100	1.35
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,378	175,388.37	1,118,627,023	225,200	1,436,325,600	1.32
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,207	301,921.13	1,270,182,193	339,000	1,426,173,000	1.31
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	12,219	100,373.74	1,226,466,729	112,000	1,368,528,000	1.26
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	8,683	125,695.53	1,091,414,286	157,200	1,364,967,600	1.26
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,757	144,991.3	1,124,697,514	174,900	1,356,699,300	1.25

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	96.47
合計	96.47

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,836	円	3,499,048,800	3,806,946,000	3.51

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

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	66,499,371,997	73.87
	オーストラリア	6,300,675,544	7.00
	イギリス	5,075,952,352	5.64
	シンガポール	3,287,460,525	3.65
	フランス	2,228,849,772	2.48
	カナダ	1,791,017,204	1.99
	香港	1,427,368,238	1.59
	ベルギー	1,209,960,116	1.34
	スペイン	437,743,012	0.49
	ニュージーランド	380,097,131	0.42
	ガンジー	242,754,882	0.27
	ドイツ	242,687,813	0.27
	オランダ	189,114,151	0.21
	韓国	128,789,801	0.14



	アイルランド	113,578,548	0.13
	イスラエル	62,008,159	0.07
	イタリア	18,347,443	0.02
	小計	89,635,776,688	99.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		384,738,841	0.43
合計(純資産総額)		90,020,515,529	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		52,684,464	0.06
	売建		76,843,955	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。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	415,603	10,949.77	4,550,758,322	12,934.11	5,375,458,409	5.97
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	50,183	81,466.93	4,088,255,371	80,862.38	4,057,917,177	4.51
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	85,167	24,432.11	2,080,809,711	31,005.00	2,640,603,244	2.93
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	157,445	15,161.54	2,387,109,650	16,635.22	2,619,133,095	2.91
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	183,977	8,734.00	1,606,855,433	14,103.06	2,594,639,111	2.88
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	233,927	7,325.46	1,713,625,029	8,206.75	1,919,781,624	2.13
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,131	18,109.95	1,414,949,139	22,713.73	1,774,646,782	1.97
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	192,017	6,531.05	1,254,073,922	8,500.91	1,632,319,619	1.81
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	209,144	6,763.16	1,414,475,235	7,507.58	1,570,166,148	1.74
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	946,128	1,688.67	1,597,699,421	1,634.93	1,546,854,376	1.72
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,656	17,051.47	1,221,840,683	19,565.81	1,402,008,226	1.56
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	211,066	5,150.90	1,087,181,369	6,086.19	1,284,588,201	1.43
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	319,561	3,037.97	970,818,261	3,980.99	1,272,170,807	1.41
香港	投資証券	LINK REIT	1,172,400	893.15	1,047,136,685	1,058.37	1,240,843,540	1.38
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	73,703	11,748.71	865,915,202	16,443.14	1,211,909,160	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	36,652	27,984.37	1,025,683,177	32,411.03	1,187,929,086	1.32
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	62,289	15,017.36	935,416,536	18,376.01	1,144,623,860	1.27

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,825	13,796.83	880,582,802	17,638.43	1,125,772,922	1.25
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	300,597	3,195.11	960,441,563	3,663.78	1,101,323,922	1.22
イギリス	投資証券	SEGO PLC	668,523	1,409.81	942,496,894	1,623.68	1,085,471,435	1.21
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	208,515	4,243.32	884,796,203	5,099.44	1,063,311,733	1.18
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	79,963	9,777.70	781,854,537	12,903.38	1,031,793,423	1.15
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	299,377	2,614.48	782,716,137	3,416.82	1,022,919,956	1.14
アメリカ	投資証券	UDR INC	166,554	4,200.79	699,659,763	5,227.86	870,722,460	0.97
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	98,450	7,335.56	722,186,350	8,281.39	815,303,042	0.91
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	161,925	2,954.44	478,399,254	4,778.95	773,831,543	0.86
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	328,011	2,122.60	696,238,682	2,323.61	762,172,657	0.85
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	54,777	10,866.78	595,249,657	13,761.70	753,825,123	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	398,631	1,505.89	600,296,026	1,884.57	751,251,691	0.83
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,808	5,772.92	449,179,867	9,652.01	751,004,045	0.83

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.57
合計	99.57

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	480,000.00	52,396,800	52,684,464	0.06
	アメリカドル	売建	530,000.00	58,172,800	58,172,111	0.06
	イギリスポンド	売建	120,000.00	18,672,720	18,671,844	0.02

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2017年8月25日

作成基準日：2021年5月31日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	12,725円
純資産総額	0.86億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年5月	0円
2019年11月	0円
2020年5月	0円
2020年11月	0円
2021年5月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位銘柄銘柄	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	14.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ウェアラブル機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
グローバル債券インデックスマザーファンド	13.8%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
J-REITインデックスマザーファンド	12.8%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
新興国株式インデックスマザーファンド	12.7%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.7%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.6%
国内株式インデックスマザーファンド	12.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.4%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.3%
新興国債券インデックスマザーファンド	11.6%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.4%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.2%
外国債券インデックスマザーファンド	11.6%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	10.4%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.1%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### (2) 【保管】

該当事項はありません。

### (3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年 8月25日設定）

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

### (4) 【計算期間】

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

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

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

## （５）【その他】

### <投資信託契約の終了（償還）と手続き>

#### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

#### (1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき



・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

権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、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2020年11月11日から2021年5月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (2020年11月10日現在)	第8期 (2021年5月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	662,194	847,810
親投資信託受益証券	57,690,708	82,802,279
流動資産合計	58,352,902	83,650,089
資産合計	58,352,902	83,650,089
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,066	7,274
未払受託者報酬	13,544	19,313
未払委託者報酬	121,805	173,725
その他未払費用	1,287	1,876
流動負債合計	139,702	202,188
負債合計	139,702	202,188
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	52,643,558	66,114,632
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,569,642	17,333,269
(分配準備積立金)	2,713,476	11,598,161
元本等合計	58,213,200	83,447,901
純資産合計	58,213,200	83,447,901
負債純資産合計	58,352,902	83,650,089

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第7期		第8期	
	自	2020年5月12日	自	2020年11月11日
	至	2020年11月10日	至	2021年5月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		5,524,578		9,506,403
営業収益合計		5,524,578		9,506,403
営業費用				
支払利息		87		50
受託者報酬		13,544		19,313
委託者報酬		121,805		173,725
その他費用		1,287		1,876
営業費用合計		136,723		194,964
営業利益又は営業損失( )		5,387,855		9,311,439
経常利益又は経常損失( )		5,387,855		9,311,439
当期純利益又は当期純損失( )		5,387,855		9,311,439
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( )		193,369		252,997
期首剰余金又は期首欠損金( )		455,996		5,569,642
剰余金増加額又は欠損金減少額		831,152		3,138,622
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,834		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		817,318		3,138,622
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		433,437
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		433,437
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		5,569,642		17,333,269

## (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11月10日現在)	第8期 (2021年 5月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,643,558口	66,114,632口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1058円 (11,058円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2622円 (12,622円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日			第8期 自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	654,293円	費用控除後の配当等収益額	A	864,725円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	57,237円	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	8,193,717円
収益調整金額	C	4,361,799円	収益調整金額	C	6,370,691円
分配準備積立金額	D	2,001,946円	分配準備積立金額	D	2,539,719円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,075,275円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,968,852円
当ファンドの期末残存口数	F	52,643,558口	当ファンドの期末残存口数	F	66,114,632口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,343円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,717円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第8期 自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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 5月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。



## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第7期	第8期
	自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日	自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	39,427,240円	52,643,558円
期中追加設定元本額	16,057,478円	17,379,718円
期中一部解約元本額	2,841,160円	3,908,644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11月10日現在)	第8期 (2021年 5月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	5,417,965	9,300,751
合計	5,417,965	9,300,751

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	4,954,578	10,652,342
	グローバルREITインデックス マザーファンド	5,371,396	11,377,153
	新興国株式インデックス マザーファンド	2,813,997	10,508,308
	国内株式インデックス マザーファンド	5,621,986	10,582,264
	外国株式インデックス マザーファンド	3,146,186	11,706,014
	国内債券インデックス マザーファンド	6,168,151	8,689,074
	外国債券インデックス マザーファンド	3,165,817	9,624,083
	新興国債券インデックス マザーファンド	5,464,285	9,663,041
合計		36,706,396	82,802,279

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,261,145,192
株式	460,742,957,170
派生商品評価勘定	35,797,450
未収配当金	4,332,026,086
前払金	13,490,400
差入委託証拠金	346,933,600
流動資産合計	467,732,349,898
資産合計	467,732,349,898
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,326,350
未払金	849,700
未払解約金	184,421,515
未払利息	1,751
流動負債合計	234,599,316
負債合計	234,599,316

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	248,363,141,878
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	219,134,608,704
元本等合計	467,497,750,582
純資産合計	467,497,750,582
負債純資産合計	467,732,349,898

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	248,363,141,878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 1.8823円 (1万口当たり純資産額) (18,823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 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	224,126,876,199円
期中追加設定元本額	53,343,075,862円
期中一部解約元本額	29,106,810,183円
期末元本額	248,363,141,878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）	426,546,883円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,843,112,972円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,679,351円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,275,999,594円
世界経済インデックスファンド	2,636,633,867円
日本株式インデックス・オープン	3,608,491,153円
DCマイセレクション25	6,022,402,023円
DCマイセレクション50	17,808,256,511円
DCマイセレクション75	17,445,586,637円
DC日本株式インデックス・オープン	5,756,866,721円

区分	2021年 5月10日現在
DCマイセレクションS25	2,753,740,100円
DCマイセレクションS50	8,172,713,122円
DCマイセレクションS75	5,734,449,846円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,400,454,679円
DCターゲット・イヤーフンド2025	246,671,315円
DCターゲット・イヤーフンド2035	639,834,663円
DCターゲット・イヤーフンド2045	456,115,271円
DC世界経済インデックスファンド	3,163,332,283円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,535,953,339円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	6,227,022円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	26,725,162円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	25,297,047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)	198,941,548円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,358,345円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	52,282,962円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	170,954,225円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	30,939,348円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	98,131,095円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,188,478,233円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	491,003,404円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,126,744,431円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	323,286,485円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	29,119,791円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	561,010,702円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	321,308,515円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	405,108,729円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	42,081,893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)	653,443,965円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,731,672,493円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,859,744,293円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,664,905,026円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,195,855,155円
分散投資コア戦略ファンドA	2,020,477,503円
分散投資コア戦略ファンドS	7,117,796,551円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	385,022,461円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	378,308,846円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,005,572,530円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	201,449,996円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,320,477円
SMT インデックスバランス・オープン	59,342,566円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	24,107,759,942円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	623,662,329円
SMT 世界経済インデックス・オープン	32,919,636円

区分	2021年 5月10日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	107,005,839円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	18,594,136円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,621,986円
グローバル経済コア	235,497,660円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,224,695円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	52,758,327円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,885,464円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,149,454,517円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	118,999,556円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	661,927円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	656,421円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	278,950円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	627,631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）	42,222,011,781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）	1,219,797,320円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	163,727,479円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	26,760,409円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	595,818,256円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,326,666,488円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	72,229,695,184	
合計	72,229,695,184	

(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 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,735,250,400	-	6,721,760,000	13,490,400
合計		6,735,250,400	-	6,721,760,000	13,490,400

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,600	3,005.00	22,838,000	
日本水産	216,700	540.00	117,018,000	
マルハニチロ	36,500	2,662.00	97,163,000	
雪国まいたけ	19,200	1,974.00	37,900,800	
カネコ種苗	7,100	1,573.00	11,168,300	
サカタのタネ	27,800	3,825.00	106,335,000	
ホクト	19,600	2,030.00	39,788,000	
ホクリヨウ	3,600	723.00	2,602,800	
住石ホールディングス	40,800	130.00	5,304,000	
日鉄鉱業	5,300	6,890.00	36,517,000	
三井松島ホールディングス	9,800	990.00	9,702,000	
I N P E X	858,000	813.00	697,554,000	
石油資源開発	30,500	2,238.00	68,259,000	
K & O エナジーグループ	11,300	1,447.00	16,351,100	
ヒノキヤグループ	5,800	2,591.00	15,027,800	
ショーボンドホールディングス	33,300	4,660.00	155,178,000	
ミライト・ホールディングス	80,900	1,812.00	146,590,800	
タマホーム	14,100	2,477.00	34,925,700	
サンヨーホームズ	2,700	766.00	2,068,200	
日本アクア	9,300	619.00	5,756,700	
ファーストコーポレーション	7,100	779.00	5,530,900	
ベステラ	4,500	1,647.00	7,411,500	
R o b o t H o m e	43,700	175.00	7,647,500	
キャンディル	4,000	541.00	2,164,000	
スペースバリューホールディングス	28,400	770.00	21,868,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,500	977.00	4,396,500	
第一カッター興業	5,800	1,416.00	8,212,800	
安藤・間	149,600	861.00	128,805,600	
東急建設	68,300	585.00	39,955,500	
コムシスホールディングス	82,700	3,580.00	296,066,000	
ビーアールホールディングス	31,200	577.00	18,002,400	



高松コンストラクショングループ	14,500	2,076.00	30,102,000
東建コーポレーション	7,200	9,930.00	71,496,000
ソネック	2,400	936.00	2,246,400
ヤマウラ	10,100	924.00	9,332,400
オリエンタル白石	78,400	300.00	23,520,000
大成建設	167,700	4,230.00	709,371,000
大林組	538,800	1,041.00	560,890,800
清水建設	504,700	935.00	471,894,500
飛鳥建設	15,500	1,135.00	17,592,500
長谷工コーポレーション	176,500	1,536.00	271,104,000
松井建設	21,200	726.00	15,391,200
銭高組	2,400	4,530.00	10,872,000
鹿島建設	394,800	1,583.00	624,968,400
不動テトラ	13,200	1,907.00	25,172,400
大末建設	6,800	974.00	6,623,200
鉄建建設	10,900	1,868.00	20,361,200
西松建設	38,500	2,944.00	113,344,000
三井住友建設	130,200	486.00	63,277,200
大豊建設	11,800	3,985.00	47,023,000
前田建設工業	134,900	981.00	132,336,900
佐田建設	12,400	436.00	5,406,400
ナカノフドー建設	12,900	385.00	4,966,500
奥村組	29,600	2,783.00	82,376,800
東鉄工業	23,100	2,603.00	60,129,300
イチケン	3,900	1,934.00	7,542,600
富士ピー・エス	6,900	591.00	4,077,900
浅沼組	6,500	4,535.00	29,477,500
戸田建設	223,700	811.00	181,420,700
熊谷組	25,000	3,140.00	78,500,000
北野建設	3,300	2,420.00	7,986,000
植木組	4,800	1,541.00	7,396,800
矢作建設工業	23,800	802.00	19,087,600
ピーエス三菱	17,700	661.00	11,699,700
日本ハウスホールディングス	36,800	333.00	12,254,400
大東建託	58,800	11,630.00	683,844,000
新日本建設	22,900	866.00	19,831,400
N I P P O	44,600	2,914.00	129,964,400
東亜道路工業	3,300	4,495.00	14,833,500
前田道路	33,300	2,193.00	73,026,900
日本道路	5,200	8,030.00	41,756,000
東亜建設工業	14,400	2,487.00	35,812,800
日本国土開発	52,400	608.00	31,859,200

若築建設	9,700	1,304.00	12,648,800
東洋建設	60,400	593.00	35,817,200
五洋建設	228,800	883.00	202,030,400
世紀東急工業	25,900	889.00	23,025,100
福田組	6,200	4,985.00	30,907,000
住友林業	126,700	2,450.00	310,415,000
日本基礎技術	16,500	519.00	8,563,500
巴コーポレーション	23,900	390.00	9,321,000
大和ハウス工業	497,500	3,421.00	1,701,947,500
ライト工業	30,800	1,798.00	55,378,400
積水ハウス	584,400	2,318.00	1,354,639,200
日特建設	14,100	801.00	11,294,100
北陸電気工事	9,300	1,140.00	10,602,000
ユアテック	30,800	793.00	24,424,400
日本リーテック	11,300	1,806.00	20,407,800
四電工	2,900	3,295.00	9,555,500
中電工	24,800	2,369.00	58,751,200
関電工	87,600	955.00	83,658,000
きんでん	109,400	1,854.00	202,827,600
東京エネシス	17,900	970.00	17,363,000
トーエネック	5,400	3,845.00	20,763,000
住友電設	15,200	2,339.00	35,552,800
日本電設工業	29,500	1,801.00	53,129,500
協和エクシオ	81,700	2,995.00	244,691,500
新日本空調	14,200	2,253.00	31,992,600
九電工	37,800	3,810.00	144,018,000
三機工業	38,200	1,413.00	53,976,600
日揮ホールディングス	179,700	1,297.00	233,070,900
中外炉工業	5,800	2,167.00	12,568,600
ヤマト	17,200	698.00	12,005,600
太平電業	11,900	2,704.00	32,177,600
高砂熱学工業	48,700	1,695.00	82,546,500
三晃金属工業	2,100	2,684.00	5,636,400
朝日工業社	4,000	2,915.00	11,660,000
明星工業	34,800	793.00	27,596,400
大気社	26,200	3,015.00	78,993,000
ダイダン	12,000	2,793.00	33,516,000
日比谷総合設備	17,300	1,925.00	33,302,500
フィル・カンパニー	3,100	3,035.00	9,408,500
東洋エンジニアリング	22,600	741.00	16,746,600
レイズネクスト	28,900	1,202.00	34,737,800
ニッポン	50,500	1,610.00	81,305,000

日清製粉グループ本社	194,800	1,844.00	359,211,200
日東富士製粉	1,300	7,180.00	9,334,000
昭和産業	14,500	3,025.00	43,862,500
鳥越製粉	15,300	818.00	12,515,400
中部飼料	21,100	1,410.00	29,751,000
フィード・ワン	23,200	885.00	20,532,000
東洋精糖	2,900	1,211.00	3,511,900
日本甜菜製糖	9,000	1,634.00	14,706,000
D M三井製糖ホールディングス	13,600	1,859.00	25,282,400
塩水港精糖	20,500	237.00	4,858,500
日新製糖	8,200	1,795.00	14,719,000
森永製菓	40,500	3,750.00	151,875,000
中村屋	4,100	3,850.00	15,785,000
江崎グリコ	47,500	4,245.00	201,637,500
名糖産業	7,600	1,529.00	11,620,400
井村屋グループ	9,800	2,501.00	24,509,800
不二家	11,000	2,180.00	23,980,000
山崎製パン	129,300	1,755.00	226,921,500
第一屋製パン	3,300	959.00	3,164,700
モロゾフ	2,700	5,350.00	14,445,000
亀田製菓	9,800	4,680.00	45,864,000
寿スピリッツ	16,600	6,490.00	107,734,000
カルビー	78,600	2,676.00	210,333,600
森永乳業	31,900	6,280.00	200,332,000
六甲バター	11,400	1,631.00	18,593,400
ヤクルト本社	118,600	5,550.00	658,230,000
明治ホールディングス	114,000	6,930.00	790,020,000
雪印メグミルク	41,500	2,281.00	94,661,500
プリマハム	24,300	3,345.00	81,283,500
日本ハム	65,900	4,830.00	318,297,000
林兼産業	5,700	634.00	3,613,800
丸大食品	17,000	1,721.00	29,257,000
S Foods	15,500	3,315.00	51,382,500
柿安本店	6,000	2,563.00	15,378,000
伊藤ハム米久ホールディングス	111,000	733.00	81,363,000
サッポロホールディングス	58,800	2,240.00	131,712,000
アサヒグループホールディングス	376,700	4,741.00	1,785,934,700
キリンホールディングス	731,300	2,082.00	1,522,566,600
宝ホールディングス	127,800	1,472.00	188,121,600
オエノンホールディングス	49,000	393.00	19,257,000
養命酒製造	5,300	1,859.00	9,852,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,000	1,831.00	241,692,000

サントリー食品インターナショナル	115,400	3,775.00	435,635,000
ダイドグループホールディングス	9,700	5,250.00	50,925,000
伊藤園	52,300	6,240.00	326,352,000
キーコーヒー	16,900	2,089.00	35,304,100
ユニカフェ	5,200	1,005.00	5,226,000
ジャパンフーズ	2,400	1,209.00	2,901,600
日清オイリオグループ	22,200	3,135.00	69,597,000
不二製油グループ本社	42,000	2,842.00	119,364,000
かどや製油	1,900	4,160.00	7,904,000
J・オイルミルズ	16,100	1,891.00	30,445,100
キッコーマン	124,100	6,920.00	858,772,000
味の素	410,100	2,322.50	952,457,250
ブルドックソース	7,800	2,326.00	18,142,800
キューピー	96,000	2,604.00	249,984,000
ハウス食品グループ本社	64,500	3,495.00	225,427,500
カゴメ	70,500	3,215.00	226,657,500
焼津水産化学工業	8,400	986.00	8,282,400
アリアケジャパン	15,800	6,680.00	105,544,000
ピエトロ	2,300	1,780.00	4,094,000
エバラ食品工業	3,800	2,677.00	10,172,600
やまみ	1,900	2,143.00	4,071,700
ニチレイ	82,100	2,824.00	231,850,400
東洋水産	88,700	4,555.00	404,028,500
イトアンドホールディングス	6,000	1,852.00	11,112,000
大冷	1,900	1,949.00	3,703,100
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,600	826.00	7,929,600
日清食品ホールディングス	67,700	7,900.00	534,830,000
永谷園ホールディングス	8,400	2,283.00	19,177,200
一正蒲鉾	6,700	1,267.00	8,488,900
フジッコ	18,700	1,942.00	36,315,400
ロック・フィールド	18,600	1,579.00	29,369,400
日本たばこ産業	924,600	2,147.50	1,985,578,500
ケンコーマヨネーズ	10,500	1,784.00	18,732,000
わらべや日洋ホールディングス	11,300	2,034.00	22,984,200
なとり	9,600	1,931.00	18,537,600
イフジ産業	2,700	946.00	2,554,200
ピクルスコーポレーション	4,100	3,375.00	13,837,500
ファーマフーズ	16,300	3,335.00	54,360,500
北の達人コーポレーション	60,200	492.00	29,618,400
ユーグレナ	87,800	919.00	80,688,200
ミヨシ油脂	6,000	1,230.00	7,380,000
理研ビタミン	16,300	1,410.00	22,983,000

片倉工業	22,900	1,462.00	33,479,800
グンゼ	12,500	4,055.00	50,687,500
東洋紡	66,900	1,453.00	97,205,700
ユニチカ	50,600	400.00	20,240,000
富士紡ホールディングス	8,200	4,540.00	37,228,000
倉敷紡績	15,800	1,890.00	29,862,000
シキボウ	9,500	959.00	9,110,500
日本毛織	55,900	1,012.00	56,570,800
トーア紡コーポレーション	6,700	460.00	3,082,000
帝国繊維	19,200	2,104.00	40,396,800
帝人	158,700	1,876.00	297,721,200
東レ	1,219,100	708.10	863,244,710
サカイオーベックス	4,600	3,080.00	14,168,000
住江織物	3,700	1,996.00	7,385,200
日本フェルト	10,700	439.00	4,697,300
イチカワ	2,600	1,334.00	3,468,400
日東製網	1,800	1,548.00	2,786,400
アツギ	13,300	642.00	8,538,600
ダイニック	6,400	814.00	5,209,600
セーレン	41,600	1,966.00	81,785,600
ソトー	6,900	800.00	5,520,000
東海染工	2,300	1,125.00	2,587,500
小松マテーレ	27,800	927.00	25,770,600
ワコールホールディングス	42,100	2,602.00	109,544,200
ホギメディカル	22,700	3,350.00	76,045,000
T S Iホールディングス	51,800	337.00	17,456,600
マツオカコーポレーション	5,500	1,876.00	10,318,000
ワールド	22,200	1,459.00	32,389,800
三陽商会	8,800	837.00	7,365,600
ナイガイ	6,800	340.00	2,312,000
オンワードホールディングス	101,800	306.00	31,150,800
ルックホールディングス	5,900	1,276.00	7,528,400
ゴールドウイン	27,900	6,750.00	188,325,000
デサント	28,800	1,942.00	55,929,600
キング	9,300	532.00	4,947,600
ヤマトインターナショナル	15,400	333.00	5,128,200
特種東海製紙	10,300	4,715.00	48,564,500
王子ホールディングス	757,500	762.00	577,215,000
日本製紙	74,400	1,446.00	107,582,400
三菱製紙	23,900	363.00	8,675,700
北越コーポレーション	120,400	588.00	70,795,200
中越パルプ工業	6,400	1,263.00	8,083,200

巴川製紙所	5,500	812.00	4,466,000
大王製紙	81,100	1,926.00	156,198,600
阿波製紙	4,300	433.00	1,861,900
レンゴー	173,500	965.00	167,427,500
トーモク	10,300	2,047.00	21,084,100
ザ・パック	12,700	2,832.00	35,966,400
クラレ	265,000	1,252.00	331,780,000
旭化成	1,115,300	1,207.50	1,346,724,750
共和レザー	9,100	770.00	7,007,000
昭和電工	127,800	3,670.00	469,026,000
住友化学	1,324,600	603.00	798,733,800
住友精化	8,200	3,890.00	31,898,000
日産化学	92,800	5,980.00	554,944,000
ラサ工業	5,500	2,228.00	12,254,000
クレハ	14,400	7,900.00	113,760,000
多木化学	6,600	5,890.00	38,874,000
テイカ	12,300	1,427.00	17,552,100
石原産業	30,200	938.00	28,327,600
片倉コープアグリ	4,300	1,212.00	5,211,600
日本曹達	23,500	3,365.00	79,077,500
東ソー	260,100	2,038.00	530,083,800
トクヤマ	50,000	2,529.00	126,450,000
セントラル硝子	32,100	2,374.00	76,205,400
東亜合成	102,700	1,249.00	128,272,300
大阪ソーダ	17,100	2,588.00	44,254,800
関東電化工業	39,900	899.00	35,870,100
デンカ	61,400	4,520.00	277,528,000
信越化学工業	311,200	18,575.00	5,780,540,000
日本カーバイド工業	6,100	1,351.00	8,241,100
堺化学工業	11,800	1,955.00	23,069,000
第一稀元素化学工業	16,900	1,400.00	23,660,000
エア・ウォーター	171,600	1,930.00	331,188,000
日本酸素ホールディングス	138,600	2,134.00	295,772,400
日本化学工業	4,800	2,999.00	14,395,200
東邦アセチレン	2,500	1,282.00	3,205,000
日本パーカラライジング	84,900	1,086.00	92,201,400
高压ガス工業	26,700	733.00	19,571,100
チタン工業	2,100	2,079.00	4,365,900
四国化成工業	22,400	1,250.00	28,000,000
戸田工業	3,600	2,153.00	7,750,800
ステラ ケミファ	9,200	3,160.00	29,072,000
保土谷化学工業	4,900	4,470.00	21,903,000

日本触媒	30,500	5,930.00	180,865,000
大日精化工業	13,900	2,376.00	33,026,400
カネカ	43,500	4,465.00	194,227,500
三菱瓦斯化学	168,600	2,615.00	440,889,000
三井化学	145,200	3,660.00	531,432,000
J S R	168,900	3,365.00	568,348,500
東京応化工業	28,900	7,310.00	211,259,000
大阪有機化学工業	15,500	4,085.00	63,317,500
三菱ケミカルホールディングス	1,124,900	869.30	977,875,570
K Hネオケム	27,700	2,717.00	75,260,900
ダイセル	226,200	896.00	202,675,200
住友ベークライト	26,500	4,650.00	123,225,000
積水化学工業	355,800	2,004.00	713,023,200
日本ゼオン	151,800	1,751.00	265,801,800
アイカ工業	46,900	4,225.00	198,152,500
宇部興産	85,000	2,333.00	198,305,000
積水樹脂	27,800	2,174.00	60,437,200
タキロンシーアイ	36,400	675.00	24,570,000
旭有機材	9,500	1,448.00	13,756,000
ニチバン	8,800	1,869.00	16,447,200
リケンテクノス	41,000	553.00	22,673,000
大倉工業	7,900	1,979.00	15,634,100
積水化成成品工業	22,600	599.00	13,537,400
群栄化学工業	3,800	2,425.00	9,215,000
タイガースポリマー	8,900	489.00	4,352,100
ミライアル	5,400	1,354.00	7,311,600
ダイキアクシス	6,400	913.00	5,843,200
ダイキョーニシカワ	35,500	794.00	28,187,000
竹本容器	6,000	1,003.00	6,018,000
森六ホールディングス	9,000	2,136.00	19,224,000
恵和	3,300	2,526.00	8,335,800
日本化薬	104,200	1,075.00	112,015,000
カーリットホールディングス	16,700	725.00	12,107,500
日本精化	12,200	1,446.00	17,641,200
扶桑化学工業	13,300	4,280.00	56,924,000
トリケミカル研究所	15,600	3,655.00	57,018,000
A D E K A	77,500	2,184.00	169,260,000
日油	63,400	6,150.00	389,910,000
新日本理化	27,800	287.00	7,978,600
ハリマ化成グループ	12,500	939.00	11,737,500
花王	411,400	6,981.00	2,871,983,400
第一工業製薬	5,700	3,710.00	21,147,000

石原ケミカル	4,200	2,128.00	8,937,600
日華化学	5,700	1,232.00	7,022,400
ニイタカ	3,500	2,660.00	9,310,000
三洋化成工業	10,000	5,400.00	54,000,000
有機合成薬品工業	12,900	292.00	3,766,800
大日本塗料	19,000	878.00	16,682,000
日本ペイントホールディングス	694,200	1,753.00	1,216,932,600
関西ペイント	189,000	2,814.00	531,846,000
神東塗料	13,200	210.00	2,772,000
中国塗料	40,500	1,004.00	40,662,000
日本特殊塗料	12,600	1,062.00	13,381,200
藤倉化成	22,700	551.00	12,507,700
太陽ホールディングス	12,400	5,490.00	68,076,000
D I C	71,100	2,945.00	209,389,500
サカタインクス	36,700	1,086.00	39,856,200
東洋インキＳＣホールディングス	35,600	2,090.00	74,404,000
T & K T O K A	11,700	805.00	9,418,500
富士フィルムホールディングス	302,000	7,286.00	2,200,372,000
資生堂	341,400	7,920.00	2,703,888,000
ライオン	223,400	2,040.00	455,736,000
高砂香料工業	10,700	2,693.00	28,815,100
マンダム	36,000	2,062.00	74,232,000
ミルボン	23,000	5,790.00	133,170,000
ファンケル	62,600	3,540.00	221,604,000
コーセー	32,300	16,120.00	520,676,000
コタ	10,900	1,541.00	16,796,900
シーボン	2,200	1,975.00	4,345,000
ポーラ・オルビスホールディングス	73,300	2,871.00	210,444,300
ノエビアホールディングス	14,600	4,870.00	71,102,000
アジュバンコスメジャパン	3,800	1,039.00	3,948,200
新日本製薬	4,700	2,094.00	9,841,800
エステー	11,000	1,843.00	20,273,000
アグロ カネショウ	6,400	1,485.00	9,504,000
コニシ	28,200	1,614.00	45,514,800
長谷川香料	29,600	2,183.00	64,616,800
星光 P M C	9,800	801.00	7,849,800
小林製薬	48,100	9,830.00	472,823,000
荒川化学工業	14,300	1,273.00	18,203,900
メック	11,800	2,537.00	29,936,600
日本高純度化学	4,700	2,674.00	12,567,800
タカラバイオ	45,000	2,836.00	127,620,000
J C U	19,300	4,090.00	78,937,000



新田ゼラチン	10,800	647.00	6,987,600
OATアグリオ	3,200	1,419.00	4,540,800
デクセリアルズ	48,000	2,017.00	96,816,000
アース製薬	12,900	6,240.00	80,496,000
北興化学工業	16,000	1,003.00	16,048,000
大成ラミック	5,300	2,815.00	14,919,500
クミアイ化学工業	71,000	899.00	63,829,000
日本農薬	30,600	576.00	17,625,600
アキレス	11,800	1,418.00	16,732,400
有沢製作所	23,900	970.00	23,183,000
日東電工	103,800	9,030.00	937,314,000
レック	20,400	1,177.00	24,010,800
三光合成	18,000	451.00	8,118,000
きもと	26,300	277.00	7,285,100
藤森工業	15,400	4,210.00	64,834,000
前澤化成工業	10,900	1,138.00	12,404,200
未来工業	6,100	1,783.00	10,876,300
ウェーブロックホールディングス	5,900	736.00	4,342,400
JSP	10,100	1,741.00	17,584,100
エフピコ	31,600	4,430.00	139,988,000
天馬	12,900	2,316.00	29,876,400
信越ポリマー	26,400	1,090.00	28,776,000
東リ	42,800	258.00	11,042,400
ニフコ	63,100	3,860.00	243,566,000
バルカー	14,000	2,144.00	30,016,000
ユニ・チャーム	364,300	4,254.00	1,549,732,200
ショーエイコーポレーション	3,800	1,006.00	3,822,800
協和キリン	172,800	3,375.00	583,200,000
武田薬品工業	1,429,500	3,730.00	5,332,035,000
アステラス製薬	1,489,700	1,722.00	2,565,263,400
大日本住友製薬	127,300	1,954.00	248,744,200
塩野義製薬	216,100	5,797.00	1,252,731,700
わかもと製薬	20,400	332.00	6,772,800
日本新薬	48,700	7,410.00	360,867,000
バイオフェルミン製薬	2,900	3,025.00	8,772,500
中外製薬	537,400	4,171.00	2,241,495,400
科研製薬	29,400	4,590.00	134,946,000
エーザイ	189,800	7,250.00	1,376,050,000
ロート製薬	81,900	2,860.00	234,234,000
小野薬品工業	394,600	2,880.50	1,136,645,300
久光製薬	50,000	6,560.00	328,000,000
持田製薬	23,800	3,940.00	93,772,000

参天製薬	299,000	1,430.00	427,570,000
扶桑薬品工業	5,500	2,477.00	13,623,500
日本ケミファ	2,000	2,345.00	4,690,000
ツムラ	57,300	3,730.00	213,729,000
日医工	48,700	973.00	47,385,100
キッセイ薬品工業	30,400	2,298.00	69,859,200
生化学工業	30,300	1,040.00	31,512,000
栄研化学	30,200	2,210.00	66,742,000
日水製薬	6,300	990.00	6,237,000
鳥居薬品	10,800	2,576.00	27,820,800
JCRファーマ	48,400	3,060.00	148,104,000
東和薬品	24,700	2,322.00	57,353,400
富士製薬工業	11,600	1,224.00	14,198,400
ゼリア新薬工業	31,200	2,011.00	62,743,200
第一三共	1,475,000	2,922.50	4,310,687,500
キョーリン製薬ホールディングス	37,900	1,908.00	72,313,200
大幸薬品	21,100	1,039.00	21,922,900
ダイト	11,000	3,470.00	38,170,000
大塚ホールディングス	357,100	4,384.00	1,565,526,400
大正製薬ホールディングス	40,900	6,770.00	276,893,000
ペプチドリーム	88,600	4,870.00	431,482,000
あすか製薬ホールディングス	19,600	1,382.00	27,087,200
サワイグループホールディングス	37,600	5,330.00	200,408,000
日本コークス工業	145,100	110.00	15,961,000
ニチレキ	20,300	1,414.00	28,704,200
ユシロ化学工業	9,600	1,150.00	11,040,000
ビーピー・カストロール	6,100	1,402.00	8,552,200
富士石油	41,700	245.00	10,216,500
MORESCO	6,200	1,104.00	6,844,800
出光興産	190,700	2,808.00	535,485,600
ENEOSホールディングス	2,584,600	507.50	1,311,684,500
コスモエネルギーホールディングス	54,300	2,603.00	141,342,900
横浜ゴム	99,500	2,133.00	212,233,500
TOYO TIRE	90,400	2,096.00	189,478,400
ブリヂストン	456,800	4,628.00	2,114,070,400
住友ゴム工業	154,300	1,408.00	217,254,400
藤倉コンポジット	15,000	493.00	7,395,000
オカモト	10,500	4,070.00	42,735,000
フコク	7,500	790.00	5,925,000
ニッタ	17,800	2,714.00	48,309,200
住友理工	33,300	745.00	24,808,500
三ツ星ベルト	20,900	1,728.00	36,115,200

バンドー化学	30,200	754.00	22,770,800
日東紡績	25,600	4,025.00	103,040,000
A G C	157,700	5,230.00	824,771,000
日本板硝子	87,200	771.00	67,231,200
石塚硝子	2,900	1,948.00	5,649,200
日本山村硝子	7,300	973.00	7,102,900
日本電気硝子	63,800	2,794.00	178,257,200
オハラ	6,900	1,575.00	10,867,500
住友大阪セメント	31,000	3,675.00	113,925,000
太平洋セメント	101,800	2,912.00	296,441,600
日本ヒューム	15,800	729.00	11,518,200
日本コンクリート工業	37,300	406.00	15,143,800
三谷セキサン	8,000	4,095.00	32,760,000
アジアパイルホールディングス	26,700	523.00	13,964,100
東海カーボン	168,100	1,916.00	322,079,600
日本カーボン	9,500	4,995.00	47,452,500
東洋炭素	10,100	2,274.00	22,967,400
ノリタケカンパニーリミテド	9,500	3,785.00	35,957,500
T O T O	122,700	5,830.00	715,341,000
日本碍子	189,100	2,045.00	386,709,500
日本特殊陶業	130,800	1,708.00	223,406,400
M A R U W A	6,000	11,340.00	68,040,000
品川リフラクトリーズ	4,100	3,290.00	13,489,000
黒崎播磨	2,900	4,750.00	13,775,000
ヨータイ	12,400	1,106.00	13,714,400
イソライト工業	7,800	660.00	5,148,000
東京窯業	22,300	331.00	7,381,300
ニッカトー	8,000	734.00	5,872,000
フジミインコーポレーテッド	13,800	4,655.00	64,239,000
クニミネ工業	5,500	1,214.00	6,677,000
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,018.00	3,359,400
ニチアス	43,500	2,997.00	130,369,500
ニチハ	23,900	3,265.00	78,033,500
日本製鉄	811,100	2,281.00	1,850,119,100
神戸製鋼所	311,100	912.00	283,723,200
中山製鋼所	23,800	489.00	11,638,200
合同製鐵	9,200	1,902.00	17,498,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	491,700	1,725.00	848,182,500
東京製鐵	66,300	1,189.00	78,830,700
共英製鋼	19,200	1,526.00	29,299,200
大和工業	36,100	3,720.00	134,292,000
東京鐵鋼	6,500	1,733.00	11,264,500

大阪製鐵	9,100	1,407.00	12,803,700
淀川製鋼所	22,900	2,591.00	59,333,900
丸一鋼管	55,200	2,899.00	160,024,800
モリ工業	5,100	2,727.00	13,907,700
大同特殊鋼	27,800	6,110.00	169,858,000
日本高周波鋼業	6,500	456.00	2,964,000
日本冶金工業	13,300	2,494.00	33,170,200
山陽特殊製鋼	20,400	1,842.00	37,576,800
愛知製鋼	9,600	3,510.00	33,696,000
日立金属	160,200	2,130.00	341,226,000
日本金属	4,300	1,208.00	5,194,400
大平洋金属	11,500	2,565.00	29,497,500
新日本電工	109,900	407.00	44,729,300
栗本鐵工所	7,700	1,750.00	13,475,000
虹技	2,400	1,218.00	2,923,200
三菱製鋼	12,700	915.00	11,620,500
日亜鋼業	25,200	320.00	8,064,000
日本精線	2,400	4,350.00	10,440,000
エンビプロ・ホールディングス	7,300	1,134.00	8,278,200
シンニッタン	20,900	271.00	5,663,900
新家工業	4,300	1,709.00	7,348,700
大紀アルミニウム工業所	25,700	1,067.00	27,421,900
日本軽金属ホールディングス	46,400	2,318.00	107,555,200
三井金属鉱業	45,900	4,080.00	187,272,000
東邦亜鉛	9,500	2,592.00	24,624,000
三菱マテリアル	112,300	2,734.00	307,028,200
住友金属鉱山	217,200	5,283.00	1,147,467,600
D O W Aホールディングス	43,000	5,060.00	217,580,000
古河機械金属	28,200	1,339.00	37,759,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,800	1,071.00	19,063,800
東邦チタニウム	30,500	1,044.00	31,842,000
U A C J	25,800	2,884.00	74,407,200
C Kサンエツ	3,600	3,605.00	12,978,000
古河電気工業	52,800	3,000.00	158,400,000
住友電気工業	593,000	1,677.50	994,757,500
フジクラ	205,200	590.00	121,068,000
昭和電線ホールディングス	16,500	1,624.00	26,796,000
東京特殊電線	2,200	2,614.00	5,750,800
タツタ電線	30,200	613.00	18,512,600
カナレ電気	2,900	1,788.00	5,185,200
平河ヒューテック	9,500	1,341.00	12,739,500
リョービ	21,000	1,687.00	35,427,000

アーレスティ	21,200	502.00	10,642,400
アサヒホールディングス	63,800	2,359.00	150,504,200
稲葉製作所	9,600	1,495.00	14,352,000
宮地エンジニアリンググループ	5,500	2,348.00	12,914,000
トーカロ	43,800	1,552.00	67,977,600
アルファC o	6,000	1,259.00	7,554,000
SUMCO	217,400	2,649.00	575,892,600
川田テクノロジーズ	3,500	4,375.00	15,312,500
RS Technologies	5,500	6,280.00	34,540,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,830.00	5,377,000
信和	9,000	806.00	7,254,000
東洋製罐グループホールディングス	108,200	1,391.00	150,506,200
ホッカカンホールディングス	8,600	1,442.00	12,401,200
コロナ	9,400	964.00	9,061,600
横河ブリッジホールディングス	29,200	2,141.00	62,517,200
駒井ハルテック	3,400	1,987.00	6,755,800
高田機工	1,600	2,686.00	4,297,600
三和ホールディングス	160,200	1,426.00	228,445,200
文化シャッター	50,100	968.00	48,496,800
三協立山	21,900	859.00	18,812,100
アルインコ	11,200	1,038.00	11,625,600
東洋シャッター	3,700	653.00	2,416,100
LIXIL	234,000	2,935.00	686,790,000
日本フィルコン	11,800	498.00	5,876,400
ノーリツ	35,200	1,721.00	60,579,200
長府製作所	17,300	2,041.00	35,309,300
リンナイ	33,000	11,250.00	371,250,000
ダイニチ工業	8,100	835.00	6,763,500
日東精工	21,300	564.00	12,013,200
三洋工業	2,100	1,847.00	3,878,700
岡部	34,400	754.00	25,937,600
ジーテクト	21,100	1,470.00	31,017,000
東プレ	31,700	1,505.00	47,708,500
高周波熱錬	32,700	581.00	18,998,700
東京製綱	12,100	1,100.00	13,310,000
サンコール	14,500	470.00	6,815,000
モリテック スチール	13,200	451.00	5,953,200
パイオラックス	25,100	1,517.00	38,076,700
エイチワン	16,700	836.00	13,961,200
日本発條	169,200	817.00	138,236,400
中央発條	8,200	1,111.00	9,110,200
アドバネクス	2,400	1,484.00	3,561,600

立川ブラインド工業	7,500	1,375.00	10,312,500
三益半導体工業	13,300	2,729.00	36,295,700
日本ドライケミカル	4,300	1,735.00	7,460,500
日本製鋼所	51,600	2,787.00	143,809,200
三浦工業	73,600	5,910.00	434,976,000
タクマ	57,700	2,280.00	131,556,000
ツガミ	35,300	1,761.00	62,163,300
オークマ	19,800	6,230.00	123,354,000
芝浦機械	17,700	2,718.00	48,108,600
アマダ	249,200	1,235.00	307,762,000
アイダエンジニアリング	44,700	967.00	43,224,900
滝澤鉄工所	5,000	1,169.00	5,845,000
F U J I	67,900	2,966.00	201,391,400
牧野フライス製作所	20,000	4,440.00	88,800,000
オーエスジー	83,900	1,862.00	156,221,800
ダイジェット工業	2,100	1,322.00	2,776,200
旭ダイヤモンド工業	45,000	540.00	24,300,000
D M G 森精機	107,600	1,813.00	195,078,800
ソディック	35,900	1,078.00	38,700,200
ディスコ	23,100	35,100.00	810,810,000
日東工器	8,200	1,962.00	16,088,400
日進工具	13,400	1,551.00	20,783,400
パンチ工業	14,400	590.00	8,496,000
富士ダイス	8,700	666.00	5,794,200
豊和工業	9,600	918.00	8,812,800
O K K	6,500	444.00	2,886,000
東洋機械金属	12,400	531.00	6,584,400
津田駒工業	3,300	930.00	3,069,000
エンシュウ	4,300	980.00	4,214,000
島精機製作所	24,900	2,225.00	55,402,500
オプトラン	21,300	2,820.00	60,066,000
N C ホールディングス	5,300	699.00	3,704,700
イワキポンプ	10,900	1,000.00	10,900,000
フリー	16,700	997.00	16,649,900
ヤマシンフィルタ	34,400	831.00	28,586,400
日阪製作所	21,100	865.00	18,251,500
やまびこ	33,000	1,209.00	39,897,000
平田機工	8,000	7,270.00	58,160,000
ペガサスミシン製造	17,400	508.00	8,839,200
マルマエ	7,000	1,754.00	12,278,000
タツモ	7,300	1,774.00	12,950,200
ナブテスコ	100,200	5,040.00	505,008,000

三井海洋開発	18,100	2,284.00	41,340,400
レオン自動機	16,700	1,232.00	20,574,400
S M C	50,300	65,230.00	3,281,069,000
ホソカワミクロン	6,000	6,380.00	38,280,000
ユニオンツール	6,400	3,545.00	22,688,000
オイレス工業	23,900	1,626.00	38,861,400
日精エー・エス・ピー機械	5,800	5,230.00	30,334,000
サトーホールディングス	22,400	2,775.00	62,160,000
技研製作所	15,000	4,555.00	68,325,000
日本エアージェット	5,600	1,203.00	6,736,800
カワタ	4,700	935.00	4,394,500
日精樹脂工業	13,300	1,041.00	13,845,300
オカダアイヨン	5,500	1,245.00	6,847,500
ワイエイシーホールディングス	6,800	967.00	6,575,600
小松製作所	778,500	3,436.00	2,674,926,000
住友重機械工業	98,400	3,250.00	319,800,000
日立建機	80,400	3,650.00	293,460,000
日工	25,900	731.00	18,932,900
巴工業	6,800	2,108.00	14,334,400
井関農機	17,300	1,636.00	28,302,800
T O W A	16,100	2,193.00	35,307,300
丸山製作所	3,600	1,849.00	6,656,400
北川鉄工所	7,900	1,643.00	12,979,700
ローツェ	7,500	9,750.00	73,125,000
タカキタ	6,100	668.00	4,074,800
クボタ	902,600	2,718.50	2,453,718,100
荏原実業	4,300	4,950.00	21,285,000
三菱化工機	5,600	2,822.00	15,803,200
月島機械	31,800	1,254.00	39,877,200
帝国電機製作所	12,100	1,358.00	16,431,800
新東工業	41,000	778.00	31,898,000
澁谷工業	15,100	3,590.00	54,209,000
アイチ コーポレーション	29,500	907.00	26,756,500
小森コーポレーション	43,800	773.00	33,857,400
鶴見製作所	13,300	1,794.00	23,860,200
住友精密工業	2,600	2,232.00	5,803,200
日本ギア工業	7,200	327.00	2,354,400
酒井重工業	3,100	2,110.00	6,541,000
荏原製作所	71,300	4,890.00	348,657,000
石井鐵工所	2,500	2,949.00	7,372,500
西島製作所	17,600	887.00	15,611,200
北越工業	17,800	1,109.00	19,740,200

ダイキン工業	218,900	23,115.00	5,059,873,500
オルガノ	5,600	7,370.00	41,272,000
トーヨーカネツ	6,600	2,636.00	17,397,600
栗田工業	93,000	5,020.00	466,860,000
椿本チエイン	24,600	3,040.00	74,784,000
大同工業	8,400	867.00	7,282,800
木村化工機	14,600	771.00	11,256,600
アネスト岩田	29,100	1,057.00	30,758,700
ダイフク	94,600	11,240.00	1,063,304,000
サムコ	4,300	3,255.00	13,996,500
加藤製作所	9,600	1,089.00	10,454,400
油研工業	3,000	1,703.00	5,109,000
タダノ	83,100	1,170.00	97,227,000
フジテック	59,200	2,592.00	153,446,400
C K D	39,900	2,463.00	98,273,700
キトー	14,500	1,824.00	26,448,000
平和	48,000	1,931.00	92,688,000
理想科学工業	13,300	1,394.00	18,540,200
S A N K Y O	40,900	2,936.00	120,082,400
日本金銭機械	19,200	602.00	11,558,400
マースグループホールディングス	11,000	1,618.00	17,798,000
フクシマガリレイ	11,800	4,165.00	49,147,000
オーイズミ	7,500	404.00	3,030,000
ダイコク電機	8,000	943.00	7,544,000
竹内製作所	28,800	3,075.00	88,560,000
アマノ	45,000	2,956.00	133,020,000
J U K I	23,900	863.00	20,625,700
蛇の目ミシン工業	15,800	801.00	12,655,800
マックス	23,100	1,665.00	38,461,500
グローリー	44,200	2,391.00	105,682,200
新晃工業	16,000	2,376.00	38,016,000
大和冷機工業	27,700	1,120.00	31,024,000
セガサミーホールディングス	156,300	1,604.00	250,705,200
日本ピストンリング	6,400	1,130.00	7,232,000
リケン	8,000	2,395.00	19,160,000
T P R	23,200	1,675.00	38,860,000
ツバキ・ナカシマ	33,000	1,710.00	56,430,000
ホシザキ	54,100	10,240.00	553,984,000
大豊工業	14,100	1,018.00	14,353,800
日本精工	353,000	1,071.00	378,063,000
N T N	397,600	344.00	136,774,400
ジェイテクト	164,900	1,097.00	180,895,300



不二越	16,000	4,360.00	69,760,000
日本トムソン	47,200	703.00	33,181,600
T H K	107,100	3,875.00	415,012,500
ユーシン精機	11,500	875.00	10,062,500
前澤給装工業	12,100	1,117.00	13,515,700
イーグル工業	21,300	1,200.00	25,560,000
前澤工業	10,500	666.00	6,993,000
日本ピラー工業	17,400	1,889.00	32,868,600
キッツ	53,200	725.00	38,570,000
マキタ	224,100	5,120.00	1,147,392,000
日立造船	136,500	826.00	112,749,000
三菱重工業	270,000	3,502.00	945,540,000
I H I	115,600	2,320.00	268,192,000
スター精密	26,500	1,692.00	44,838,000
日清紡ホールディングス	105,400	873.00	92,014,200
イビデン	82,900	4,875.00	404,137,500
コニカミノルタ	350,300	638.00	223,491,400
ブラザー工業	210,300	2,168.00	455,930,400
ミネベアミツミ	296,600	2,865.00	849,759,000
日立製作所	826,100	5,384.00	4,447,722,400
東芝	340,100	4,515.00	1,535,551,500
三菱電機	1,718,200	1,696.00	2,914,067,200
富士電機	103,600	5,150.00	533,540,000
東洋電機製造	7,000	1,288.00	9,016,000
安川電機	185,000	5,170.00	956,450,000
シンフォニアテクノロジー	22,400	1,520.00	34,048,000
明電舎	29,300	2,419.00	70,876,700
オリジン	4,900	1,354.00	6,634,600
山洋電気	8,500	7,900.00	67,150,000
デンヨー	14,800	2,046.00	30,280,800
東芝テック	18,500	4,430.00	81,955,000
芝浦メカトロニクス	3,200	6,070.00	19,424,000
マブチモーター	47,800	4,445.00	212,471,000
日本電産	413,600	12,490.00	5,165,864,000
トレックス・セミコンダクター	9,900	1,846.00	18,275,400
東光高岳	9,400	1,434.00	13,479,600
ダイヘン	18,900	4,930.00	93,177,000
ヤーマン	28,800	1,512.00	43,545,600
J V C ケンウッド	153,400	236.00	36,202,400
ミマキエンジニアリング	17,100	679.00	11,610,900
I - P E X	8,600	1,980.00	17,028,000
日新電機	40,500	1,242.00	50,301,000

大崎電気工業	34,700	613.00	21,271,100
オムロン	143,100	8,530.00	1,220,643,000
日東工業	25,400	1,988.00	50,495,200
I D E C	23,200	1,736.00	40,275,200
正興電機製作所	6,000	1,732.00	10,392,000
不二電機工業	3,700	1,289.00	4,769,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62,100	3,005.00	186,610,500
サクサホールディングス	4,200	1,491.00	6,262,200
メルコホールディングス	6,200	4,320.00	26,784,000
テクノメディカ	4,500	1,630.00	7,335,000
日本電気	218,400	6,350.00	1,386,840,000
富士通	154,600	16,775.00	2,593,415,000
沖電気工業	70,000	1,197.00	83,790,000
岩崎通信機	7,500	922.00	6,915,000
電気興業	8,400	2,586.00	21,722,400
サンケン電気	20,100	5,060.00	101,706,000
ナカヨ	3,500	1,524.00	5,334,000
アイホン	9,900	2,085.00	20,641,500
ルネサスエレクトロニクス	740,400	1,241.00	918,836,400
セイコーエプソン	213,300	1,891.00	403,350,300
ワコム	125,900	688.00	86,619,200
アルバック	31,700	5,040.00	159,768,000
アクセル	8,300	1,075.00	8,922,500
E I Z O	14,600	4,160.00	60,736,000
日本信号	40,400	962.00	38,864,800
京三製作所	37,600	417.00	15,679,200
能美防災	23,200	2,108.00	48,905,600
ホーチキ	13,300	1,311.00	17,436,300
星和電機	10,400	610.00	6,344,000
エレコム	39,800	2,327.00	92,614,600
パナソニック	1,832,500	1,290.50	2,364,841,250
シャープ	228,700	1,822.00	416,691,400
アンリツ	103,400	2,236.00	231,202,400
富士通ゼネラル	52,600	2,916.00	153,381,600
ソニーグループ	1,076,300	10,780.00	11,602,514,000
T D K	83,000	14,820.00	1,230,060,000
帝国通信工業	8,600	1,109.00	9,537,400
タムラ製作所	62,400	527.00	32,884,800
アルプスアルパイン	141,200	1,284.00	181,300,800
池上通信機	5,400	888.00	4,795,200
鈴木	8,600	1,204.00	10,354,400
日本トリム	4,000	3,845.00	15,380,000

ローランド ディー・ジー・	10,800	1,867.00	20,163,600
フォスター電機	17,600	1,194.00	21,014,400
S M K	4,500	2,838.00	12,771,000
ヨコオ	13,700	2,638.00	36,140,600
ホシデン	48,000	1,089.00	52,272,000
ヒロセ電機	26,500	15,500.00	410,750,000
日本航空電子工業	39,500	1,930.00	76,235,000
T O A	20,600	918.00	18,910,800
マクセルホールディングス	34,900	1,340.00	46,766,000
古野電気	23,200	1,117.00	25,914,400
ユニデンホールディングス	4,500	2,626.00	11,817,000
スミダコーポレーション	15,700	1,039.00	16,312,300
アイコム	7,200	2,656.00	19,123,200
リオン	7,600	2,715.00	20,634,000
本多通信工業	15,600	510.00	7,956,000
横河電機	172,100	2,066.00	355,558,600
新電元工業	6,700	3,610.00	24,187,000
アズビル	116,200	4,595.00	533,939,000
東亜ディーケーケー	9,800	857.00	8,398,600
日本光電工業	71,300	3,330.00	237,429,000
チノー	5,700	1,369.00	7,803,300
共和電業	18,700	385.00	7,199,500
日本電子材料	6,800	2,000.00	13,600,000
堀場製作所	34,100	7,550.00	257,455,000
アドバンテスト	127,800	10,200.00	1,303,560,000
小野測器	9,200	527.00	4,848,400
エスベック	15,800	1,928.00	30,462,400
キーエンス	168,700	53,490.00	9,023,763,000
日置電機	8,500	5,400.00	45,900,000
シスメックス	134,200	11,160.00	1,497,672,000
日本マイクロニクス	30,500	1,698.00	51,789,000
メガチップス	17,500	3,785.00	66,237,500
O B A R A G R O U P	10,300	3,820.00	39,346,000
澤藤電機	2,300	2,312.00	5,317,600
原田工業	8,200	904.00	7,412,800
コーセル	22,000	1,075.00	23,650,000
イリソ電子工業	14,600	5,370.00	78,402,000
オブテックスグループ	28,900	1,732.00	50,054,800
千代田インテグレ	7,800	1,830.00	14,274,000
アイ・オー・データ機器	7,400	1,104.00	8,169,600
レーザーテック	75,500	18,790.00	1,418,645,000
スタンレー電気	120,600	3,195.00	385,317,000

岩崎電気	7,000	1,509.00	10,563,000
ウシオ電機	88,800	1,483.00	131,690,400
岡谷電機産業	15,300	398.00	6,089,400
ハリオス テクノ ホールディング	18,900	361.00	6,822,900
エノモト	5,300	1,830.00	9,699,000
日本セラミック	17,900	2,768.00	49,547,200
遠藤照明	10,400	771.00	8,018,400
古河電池	12,900	1,640.00	21,156,000
双信電機	10,800	508.00	5,486,400
山一電機	11,900	1,590.00	18,921,000
図研	11,500	2,971.00	34,166,500
日本電子	31,500	6,130.00	193,095,000
カシオ計算機	138,300	1,984.00	274,387,200
ファナック	150,800	26,580.00	4,008,264,000
日本シイエムケイ	39,500	457.00	18,051,500
エンプラス	8,000	4,175.00	33,400,000
大真空	6,300	2,585.00	16,285,500
ローム	71,500	10,600.00	757,900,000
浜松ホトニクス	123,400	6,380.00	787,292,000
三井ハイテック	17,100	4,225.00	72,247,500
新光電気工業	58,000	3,330.00	193,140,000
京セラ	262,000	6,901.00	1,808,062,000
太陽誘電	76,600	5,000.00	383,000,000
村田製作所	504,800	8,699.00	4,391,255,200
双葉電子工業	30,700	912.00	27,998,400
北陸電気工業	7,600	936.00	7,113,600
ニチコン	55,100	1,084.00	59,728,400
日本ケミコン	17,300	1,768.00	30,586,400
K O A	24,500	1,665.00	40,792,500
市光工業	27,300	714.00	19,492,200
小糸製作所	103,100	6,990.00	720,669,000
ミツバ	31,600	675.00	21,330,000
S C R E E Nホールディングス	29,800	10,420.00	310,516,000
キャノン電子	16,400	1,787.00	29,306,800
キャノン	853,900	2,621.50	2,238,498,850
リコー	437,300	1,232.00	538,753,600
象印マホービン	47,100	1,738.00	81,859,800
M U T O Hホールディングス	2,900	1,571.00	4,555,900
東京エレクトロン	100,600	50,060.00	5,036,036,000
トヨタ紡織	50,100	2,071.00	103,757,100
芦森工業	3,300	1,018.00	3,359,400
ユニプレス	28,200	1,110.00	31,302,000

豊田自動織機	139,100	9,020.00	1,254,682,000
モリタホールディングス	27,600	1,605.00	44,298,000
三櫻工業	23,800	1,209.00	28,774,200
デンソー	378,300	7,274.00	2,751,754,200
東海理化電機製作所	45,300	1,776.00	80,452,800
三井E & Sホールディングス	66,500	597.00	39,700,500
川崎重工業	133,700	2,807.00	375,295,900
名村造船所	51,600	188.00	9,700,800
日本車輛製造	6,300	2,446.00	15,409,800
三菱ロジスネクスト	22,700	1,200.00	27,240,000
近畿車輛	2,900	1,296.00	3,758,400
日産自動車	2,026,300	582.40	1,180,117,120
いすゞ自動車	456,200	1,156.00	527,367,200
トヨタ自動車	1,740,500	8,506.00	14,804,693,000
日野自動車	214,500	960.00	205,920,000
三菱自動車工業	636,000	311.00	197,796,000
エフテック	12,100	744.00	9,002,400
レシップホールディングス	6,800	552.00	3,753,600
G M B	3,200	962.00	3,078,400
ファルテック	3,100	889.00	2,755,900
武蔵精密工業	38,300	1,968.00	75,374,400
日産車体	25,200	736.00	18,547,200
新明和工業	48,500	1,032.00	50,052,000
極東開発工業	29,600	1,707.00	50,527,200
トピー工業	14,200	1,398.00	19,851,600
ティラド	5,400	1,968.00	10,627,200
曙ブレーキ工業	94,300	188.00	17,728,400
タチエス	26,400	1,185.00	31,284,000
N O K	83,200	1,452.00	120,806,400
フタバ産業	43,200	548.00	23,673,600
K Y B	19,200	3,195.00	61,344,000
大同メタル工業	35,600	589.00	20,968,400
プレス工業	85,400	337.00	28,779,800
ミクニ	22,100	317.00	7,005,700
太平洋工業	36,000	1,262.00	45,432,000
河西工業	23,400	472.00	11,044,800
アイシン	125,800	4,320.00	543,456,000
マツダ	539,200	900.00	485,280,000
今仙電機製作所	15,200	740.00	11,248,000
本田技研工業	1,352,700	3,431.00	4,641,113,700
スズキ	340,500	4,297.00	1,463,128,500
S U B A R U	492,300	2,128.00	1,047,614,400

安永	8,400	1,223.00	10,273,200
ヤマハ発動機	242,800	2,875.00	698,050,000
T B K	20,600	416.00	8,569,600
エクセディ	23,400	1,610.00	37,674,000
豊田合成	55,500	2,713.00	150,571,500
愛三工業	27,000	789.00	21,303,000
盟和産業	2,700	862.00	2,327,400
日本プラスト	14,700	588.00	8,643,600
ヨロズ	14,800	1,268.00	18,766,400
エフ・シー・シー	28,100	1,794.00	50,411,400
シマノ	64,300	25,205.00	1,620,681,500
テイ・エス テック	79,900	1,536.00	122,726,400
ジャムコ	10,000	910.00	9,100,000
テルモ	526,700	4,241.00	2,233,734,700
クリエートメディック	5,700	1,018.00	5,802,600
日機装	55,500	1,161.00	64,435,500
日本エム・ディ・エム	9,900	2,250.00	22,275,000
島津製作所	221,100	3,985.00	881,083,500
J M S	14,600	991.00	14,468,600
長野計器	12,500	1,241.00	15,512,500
ブイ・テクノロジー	8,100	5,520.00	44,712,000
東京計器	11,000	1,079.00	11,869,000
愛知時計電機	2,300	4,295.00	9,878,500
インターアクション	8,600	2,377.00	20,442,200
オーバル	15,500	286.00	4,433,000
東京精密	29,000	5,260.00	152,540,000
マニー	68,500	2,562.00	175,497,000
ニコン	262,400	1,077.00	282,604,800
トプコン	86,600	1,591.00	137,780,600
オリンパス	950,700	2,279.00	2,166,645,300
理研計器	15,200	2,888.00	43,897,600
タムロン	13,900	2,413.00	33,540,700
H O Y A	338,100	13,155.00	4,447,705,500
シード	7,300	720.00	5,256,000
ノーリツ鋼機	15,500	2,519.00	39,044,500
エー・アンド・デイ	14,500	1,355.00	19,647,500
朝日インテック	180,900	2,968.00	536,911,200
シチズン時計	218,100	392.00	85,495,200
リズム	5,400	813.00	4,390,200
大研医器	13,700	578.00	7,918,600
メニコン	26,400	6,850.00	180,840,000
シンシア	1,900	888.00	1,687,200

松風	7,900	2,137.00	16,882,300
セイコーホールディングス	24,300	2,107.00	51,200,100
ニプロ	128,100	1,386.00	177,546,600
中本パックス	4,400	1,604.00	7,057,600
スノーピーク	10,200	4,165.00	42,483,000
パラマウントベッドホールディングス	32,900	2,240.00	73,696,000
トランザクション	9,400	1,362.00	12,802,800
粧美堂	5,000	415.00	2,075,000
ニホンフラッシュ	14,700	1,338.00	19,668,600
前田工織	18,900	3,415.00	64,543,500
永大産業	22,500	347.00	7,807,500
アートネイチャー	16,500	679.00	11,203,500
バンダイナムコホールディングス	142,100	8,091.00	1,149,731,100
アイフィスジャパン	4,400	743.00	3,269,200
共立印刷	28,700	134.00	3,845,800
SHOEI	16,100	4,025.00	64,802,500
フランスベッドホールディングス	22,100	931.00	20,575,100
パイロットコーポレーション	29,000	3,585.00	103,965,000
萩原工業	9,500	1,454.00	13,813,000
トッパン・フォームズ	30,700	1,155.00	35,458,500
フジシールインターナショナル	35,300	2,479.00	87,508,700
タカラトミー	77,000	965.00	74,305,000
廣済堂	12,000	1,026.00	12,312,000
エステールホールディングス	4,600	627.00	2,884,200
タカノ	5,900	641.00	3,781,900
プロネクサス	13,800	1,169.00	16,132,200
ホクシン	10,600	249.00	2,639,400
ウッドワン	5,800	1,684.00	9,767,200
大建工業	11,600	2,125.00	24,650,000
凸版印刷	261,200	1,953.00	510,123,600
大日本印刷	207,500	2,297.00	476,627,500
共同印刷	5,300	2,779.00	14,728,700
NISSHA	35,300	1,337.00	47,196,100
光村印刷	1,500	1,769.00	2,653,500
TAKARA & COMPANY	8,400	1,904.00	15,993,600
アシックス	151,900	1,824.00	277,065,600
ツツミ	4,300	2,392.00	10,285,600
ローランド	13,400	5,320.00	71,288,000
小松ウオール工業	5,200	2,059.00	10,706,800
ヤマハ	102,200	6,290.00	642,838,000
河合楽器製作所	4,800	3,490.00	16,752,000
クリナップ	16,000	557.00	8,912,000

ピジョン	110,300	3,700.00	408,110,000
オリバー	3,600	2,562.00	9,223,200
兼松サステック	1,100	1,779.00	1,956,900
キングジム	14,300	952.00	13,613,600
リンテック	36,800	2,507.00	92,257,600
イトーキ	34,100	391.00	13,333,100
任天堂	98,300	62,220.00	6,116,226,000
三菱鉛筆	28,300	1,487.00	42,082,100
タカラスタANDARD	35,500	1,610.00	57,155,000
コクヨ	82,400	1,702.00	140,244,800
ナカバヤシ	16,900	607.00	10,258,300
グローブライド	8,300	4,420.00	36,686,000
オカムラ	59,000	1,361.00	80,299,000
美津濃	17,000	2,312.00	39,304,000
東京電力ホールディングス	1,457,300	345.00	502,768,500
中部電力	525,600	1,362.50	716,130,000
関西電力	651,000	1,098.00	714,798,000
中国電力	247,800	1,243.00	308,015,400
北陸電力	157,100	679.00	106,670,900
東北電力	402,400	976.00	392,742,400
四国電力	142,800	817.00	116,667,600
九州電力	379,400	1,012.00	383,952,800
北海道電力	160,800	536.00	86,188,800
沖縄電力	33,400	1,490.00	49,766,000
電源開発	136,700	1,692.00	231,296,400
エフオン	10,400	1,031.00	10,722,400
イーレックス	25,200	1,961.00	49,417,200
レノバ	29,200	3,140.00	91,688,000
東京瓦斯	330,400	2,334.50	771,318,800
大阪瓦斯	311,200	2,152.00	669,702,400
東邦瓦斯	84,500	6,330.00	534,885,000
北海道瓦斯	9,200	1,568.00	14,425,600
広島ガス	35,400	388.00	13,735,200
西部ガスホールディングス	19,300	2,553.00	49,272,900
静岡ガス	48,800	982.00	47,921,600
メタウォーター	19,300	2,100.00	40,530,000
SBSホールディングス	12,700	2,816.00	35,763,200
東武鉄道	179,100	2,948.00	527,986,800
相鉄ホールディングス	58,900	2,253.00	132,701,700
東急	433,300	1,460.00	632,618,000
京浜急行電鉄	220,600	1,445.00	318,767,000
小田急電鉄	275,200	2,998.00	825,049,600



京王電鉄	96,000	7,210.00	692,160,000
京成電鉄	128,800	3,320.00	427,616,000
富士急行	23,400	5,260.00	123,084,000
新京成電鉄	4,400	2,178.00	9,583,200
東日本旅客鉄道	302,400	7,683.00	2,323,339,200
西日本旅客鉄道	153,100	6,221.00	952,435,100
東海旅客鉄道	142,800	16,270.00	2,323,356,000
西武ホールディングス	207,000	1,167.00	241,569,000
鴻池運輸	27,300	1,177.00	32,132,100
西日本鉄道	47,600	2,849.00	135,612,400
ハマキョウレックス	13,200	3,180.00	41,976,000
サカイ引越センター	7,900	5,660.00	44,714,000
近鉄グループホールディングス	162,700	4,070.00	662,189,000
阪急阪神ホールディングス	217,000	3,525.00	764,925,000
南海電気鉄道	77,100	2,385.00	183,883,500
京阪ホールディングス	72,400	3,850.00	278,740,000
神戸電鉄	3,900	3,620.00	14,118,000
名古屋鉄道	133,800	2,560.00	342,528,000
山陽電気鉄道	11,600	1,890.00	21,924,000
アルプス物流	11,400	953.00	10,864,200
日本通運	56,300	8,940.00	503,322,000
ヤマトホールディングス	228,000	3,105.00	707,940,000
山九	41,700	4,930.00	205,581,000
丸運	9,300	282.00	2,622,600
丸全昭和運輸	13,200	3,270.00	43,164,000
センコーグループホールディングス	89,700	1,040.00	93,288,000
トナミホールディングス	3,900	5,350.00	20,865,000
ニッコンホールディングス	54,600	2,335.00	127,491,000
日本石油輸送	1,800	2,649.00	4,768,200
福山通運	20,800	4,335.00	90,168,000
セイノーホールディングス	121,900	1,567.00	191,017,300
エスライン	4,400	921.00	4,052,400
神奈川中央交通	4,000	3,695.00	14,780,000
日立物流	35,800	3,470.00	124,226,000
丸和運輸機関	34,400	1,929.00	66,357,600
C & F ロジホールディングス	16,400	1,758.00	28,831,200
九州旅客鉄道	125,900	2,530.00	318,527,000
S Gホールディングス	307,400	2,504.00	769,729,600
日本郵船	136,500	4,415.00	602,647,500
商船三井	96,900	4,680.00	453,492,000
川崎汽船	50,100	3,165.00	158,566,500
N S ユナイテッド海運	8,500	2,385.00	20,272,500

飯野海運	78,600	561.00	44,094,600
共栄タンカー	4,700	1,001.00	4,704,700
乾汽船	11,100	1,146.00	12,720,600
日本航空	396,400	2,317.00	918,458,800
A N Aホールディングス	439,200	2,568.00	1,127,865,600
パスコ	3,200	1,410.00	4,512,000
トランコム	5,000	9,020.00	45,100,000
日新	13,000	1,422.00	18,486,000
三菱倉庫	56,300	3,355.00	188,886,500
三井倉庫ホールディングス	17,300	2,371.00	41,018,300
住友倉庫	58,400	1,478.00	86,315,200
澁澤倉庫	8,900	2,160.00	19,224,000
東陽倉庫	27,300	332.00	9,063,600
日本トランスシティ	35,800	538.00	19,260,400
ケイヒン	3,100	1,400.00	4,340,000
中央倉庫	9,900	1,102.00	10,909,800
川西倉庫	3,000	1,169.00	3,507,000
安田倉庫	13,400	953.00	12,770,200
ファイズホールディングス	2,900	933.00	2,705,700
東洋埠頭	5,000	1,505.00	7,525,000
宇徳	11,600	503.00	5,834,800
上組	90,600	2,225.00	201,585,000
サンリツ	4,200	717.00	3,011,400
キムラユニティー	4,300	1,282.00	5,512,600
キューソー流通システム	4,100	1,635.00	6,703,500
近鉄エクスプレス	30,700	2,727.00	83,718,900
東海運	9,300	355.00	3,301,500
エーアイティー	10,200	1,068.00	10,893,600
内外トランスライン	5,700	1,858.00	10,590,600
日本コンセプト	5,200	1,599.00	8,314,800
N E C ネットズエスアイ	56,000	1,893.00	106,008,000
クロスキャット	4,800	1,022.00	4,905,600
システナ	60,300	2,280.00	137,484,000
デジタルアーツ	9,800	8,740.00	85,652,000
日鉄ソリューションズ	25,300	3,325.00	84,122,500
キューブシステム	9,300	1,099.00	10,220,700
エイジア	2,800	1,927.00	5,395,600
コア	7,400	1,504.00	11,129,600
ラクーンホールディングス	12,000	3,195.00	38,340,000
ソリトンシステムズ	8,600	1,772.00	15,239,200
ソフトクリエイトホールディングス	6,800	2,511.00	17,074,800
T I S	168,700	2,681.00	452,284,700

J N S ホールディングス	8,300	545.00	4,523,500
電算システム	6,400	3,340.00	21,376,000
グリー	104,100	586.00	61,002,600
G M O ペパボ	1,500	5,930.00	8,895,000
コーエーテクモホールディングス	44,900	4,665.00	209,458,500
三菱総合研究所	7,300	4,140.00	30,222,000
電算	2,000	2,402.00	4,804,000
A G S	9,000	805.00	7,245,000
ファインデックス	14,500	1,205.00	17,472,500
ブレインパッド	4,400	5,160.00	22,704,000
K L a b	30,900	780.00	24,102,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	22,700	1,158.00	26,286,600
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	2,722.00	7,893,800
ネクソン	426,700	3,470.00	1,480,649,000
アイスタイル	52,200	502.00	26,204,400
エムアップホールディングス	4,500	2,841.00	12,784,500
エイチーム	11,800	1,632.00	19,257,600
エニグモ	16,200	1,310.00	21,222,000
テクノスジャパン	13,600	658.00	8,948,800
コロプラ	55,800	814.00	45,421,200
ブロードリーフ	84,300	573.00	48,303,900
クロス・マーケティンググループ	8,200	526.00	4,313,200
デジタルハーツホールディングス	7,900	1,589.00	12,553,100
システム情報	13,000	999.00	12,987,000
メディアドゥ	6,600	5,270.00	34,782,000
じげん	42,700	408.00	17,421,600
ブイキューブ	9,300	2,828.00	26,300,400
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	655.00	2,358,000
サイバーリンクス	5,800	1,639.00	9,506,200
フィックスターズ	18,300	1,006.00	18,409,800
C A R T A H O L D I N G S	7,100	1,520.00	10,792,000
オブティム	11,900	2,751.00	32,736,900
セレス	5,600	3,800.00	21,280,000
S H I F T	8,500	15,370.00	130,645,000
ティーガイア	18,100	1,929.00	34,914,900
セック	2,600	2,735.00	7,111,000
日本アジアグループ	16,300	940.00	15,322,000
テクマトリックス	26,300	2,076.00	54,598,800
プロシップ	5,200	1,412.00	7,342,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,800	2,111.00	86,128,800
G M O ペイメントゲートウェイ	32,300	13,350.00	431,205,000
ザッパラス	7,300	516.00	3,766,800

システムリサーチ	5,100	2,150.00	10,965,000
インターネットイニシアティブ	45,000	2,436.00	109,620,000
さくらインターネット	18,600	665.00	12,369,000
ヴィンクス	5,100	1,047.00	5,339,700
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,800	5,600.00	21,280,000
SRAホールディングス	9,100	2,632.00	23,951,200
システムインテグレータ	5,300	671.00	3,556,300
朝日ネット	14,200	752.00	10,678,400
eBASE	20,500	990.00	20,295,000
アバント	18,300	1,647.00	30,140,100
アドソル日進	6,100	2,675.00	16,317,500
ODKソリューションズ	4,000	844.00	3,376,000
フリービット	10,400	925.00	9,620,000
コムチュア	15,600	2,607.00	40,669,200
サイバーコム	3,300	1,550.00	5,115,000
アステリア	12,600	824.00	10,382,400
アイル	9,600	1,764.00	16,934,400
マークラインズ	7,200	3,210.00	23,112,000
メディカル・データ・ビジョン	19,400	1,936.00	37,558,400
gumi	23,700	1,401.00	33,203,700
ショーケース	4,000	839.00	3,356,000
モバイルファクトリー	4,000	1,437.00	5,748,000
テラスカイ	5,600	2,783.00	15,584,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	2,179.00	16,560,400
PCIホールディングス	6,600	1,459.00	9,629,400
パイプドHD	3,700	1,673.00	6,190,100
アイビーシー	3,100	996.00	3,087,600
ネオジャパン	3,400	1,773.00	6,028,200
PR TIMES	3,700	3,145.00	11,636,500
ラクス	50,900	2,068.00	105,261,200
ランドコンピュータ	2,900	1,105.00	3,204,500
ダブルスタンダード	2,300	3,580.00	8,234,000
オープンドア	10,200	2,073.00	21,144,600
マイネット	5,500	864.00	4,752,000
アカツキ	6,800	4,035.00	27,438,000
ベネフィットジャパン	1,500	1,924.00	2,886,000
Ubicomホールディングス	4,500	3,155.00	14,197,500
カナミックネットワーク	18,500	651.00	12,043,500
ノムラシステムコーポレーション	8,600	312.00	2,683,200
チェンジ	31,100	3,315.00	103,096,500
シンクロ・フード	11,100	378.00	4,195,800
オークネット	9,200	1,285.00	11,822,000

キャピタル・アセット・プランニング	3,700	1,273.00	4,710,100
セグエグループ	4,600	1,332.00	6,127,200
エイトレッド	3,300	2,617.00	8,636,100
A O I T Y O H o l d i n g s	17,700	636.00	11,257,200
マクロミル	34,900	875.00	30,537,500
ビーグリー	3,600	1,404.00	5,054,400
オロ	5,400	3,760.00	20,304,000
ユーザーローカル	2,600	4,700.00	12,220,000
テモナ	4,000	906.00	3,624,000
ニーズウェル	4,000	635.00	2,540,000
サインポスト	4,400	932.00	4,100,800
ソルクシーズ	6,900	915.00	6,313,500
フェイス	5,600	918.00	5,140,800
プロトコーポレーション	20,400	1,189.00	24,255,600
ハイマックス	5,100	1,139.00	5,808,900
野村総合研究所	293,000	3,380.00	990,340,000
サイバネットシステム	12,400	836.00	10,366,400
C E ホールディングス	9,600	592.00	5,683,200
日本システム技術	3,200	1,592.00	5,094,400
インテージホールディングス	21,300	1,370.00	29,181,000
東邦システムサイエンス	4,900	928.00	4,547,200
ソースネクスト	81,200	331.00	26,877,200
インフォコム	15,500	2,767.00	42,888,500
H E R O Z	4,900	2,783.00	13,636,700
ラクスル	18,400	4,905.00	90,252,000
I P S	4,100	2,509.00	10,286,900
F I G	19,600	286.00	5,605,600
システムサポート	5,200	1,520.00	7,904,000
イーソル	9,500	1,196.00	11,362,000
アルテリア・ネットワークス	18,900	1,587.00	29,994,300
E d u L a b	1,700	6,330.00	10,761,000
東海ソフト	3,000	1,227.00	3,681,000
ウイングアーク1st	8,900	2,590.00	23,051,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,080.00	8,320,000
サーバーワークス	1,700	4,365.00	7,420,500
東名	1,900	1,132.00	2,150,800
ヴィッツ	1,700	2,073.00	3,524,100
トビラシステムズ	2,500	1,338.00	3,345,000
S a n s a n	15,000	8,660.00	129,900,000
L i n k - U	3,300	1,181.00	3,897,300
ギフティ	10,300	3,140.00	32,342,000
ベース	2,000	6,070.00	12,140,000

フォーカスシステムズ	11,700	929.00	10,869,300
クレスコ	11,300	1,697.00	19,176,100
フジ・メディア・ホールディングス	175,200	1,340.00	234,768,000
オービック	53,100	19,960.00	1,059,876,000
ジャストシステム	24,000	6,500.00	156,000,000
TDCソフト	15,100	1,053.00	15,900,300
Zホールディングス	2,316,800	475.20	1,100,943,360
トレンドマイクロ	90,100	5,350.00	482,035,000
IDホールディングス	6,700	1,365.00	9,145,500
日本オラクル	34,200	10,850.00	371,070,000
アルファシステムズ	4,600	3,640.00	16,744,000
フューチャー	20,500	2,104.00	43,132,000
CAC Holdings	11,200	1,426.00	15,971,200
S Bテクノロジー	6,200	3,160.00	19,592,000
トーセ	5,000	801.00	4,005,000
オービックビジネスコンサルタント	17,300	6,340.00	109,682,000
伊藤忠テクノソリューションズ	76,900	3,825.00	294,142,500
アイティフォー	22,500	793.00	17,842,500
東計電算	2,600	4,330.00	11,258,000
エクスネット	3,000	1,020.00	3,060,000
大塚商会	91,300	5,660.00	516,758,000
サイボウズ	19,900	2,357.00	46,904,300
電通国際情報サービス	21,000	4,015.00	84,315,000
ACCESS	21,500	892.00	19,178,000
デジタルガレージ	27,900	4,605.00	128,479,500
EMシステムズ	28,300	825.00	23,347,500
ウェザーニューズ	5,100	5,420.00	27,642,000
C I J	11,900	869.00	10,341,100
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,495.00	6,291,000
日本エンタープライズ	18,900	228.00	4,309,200
WOWOW	8,200	2,705.00	22,181,000
スカラ	15,500	759.00	11,764,500
インテリジェント ウェイブ	10,400	680.00	7,072,000
IMAGICA GROUP	15,100	503.00	7,595,300
ネットワンシステムズ	68,900	3,405.00	234,604,500
システムソフト	38,100	163.00	6,210,300
アルゴグラフィックス	13,200	3,075.00	40,590,000
マーベラス	27,000	821.00	22,167,000
エイベックス	29,300	1,501.00	43,979,300
日本ユニシス	58,600	3,560.00	208,616,000
兼松エレクトロニクス	9,300	3,760.00	34,968,000
都築電気	7,800	1,833.00	14,297,400

TBSホールディングス	112,000	2,185.00	244,720,000
日本テレビホールディングス	141,000	1,441.00	203,181,000
朝日放送グループホールディングス	17,300	706.00	12,213,800
テレビ朝日ホールディングス	52,300	2,011.00	105,175,300
スカパーJ S A Tホールディングス	111,800	464.00	51,875,200
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,282.00	28,296,800
日本BS放送	6,100	1,094.00	6,673,400
ビジョン	21,300	1,070.00	22,791,000
スマートバリュー	4,800	870.00	4,176,000
ワイヤレスゲート	7,800	467.00	3,642,600
コネクシオ	9,800	1,474.00	14,445,200
クロップス	3,500	896.00	3,136,000
日本電信電話	1,972,000	2,854.00	5,628,088,000
KDDI	1,352,100	3,440.00	4,651,224,000
ソフトバンク	1,532,400	1,449.00	2,220,447,600
光通信	19,900	22,180.00	441,382,000
エムティーアイ	16,800	776.00	13,036,800
GMOインターネット	59,800	3,160.00	188,968,000
ファイバーゲート	5,700	1,571.00	8,954,700
アйдママーケティングコミュニケーション	5,300	413.00	2,188,900
KADOKAWA	43,700	3,920.00	171,304,000
学研ホールディングス	24,100	1,407.00	33,908,700
ゼンリン	30,900	1,162.00	35,905,800
昭文社ホールディングス	7,600	477.00	3,625,200
インプレスホールディングス	14,000	240.00	3,360,000
アイネット	8,900	1,477.00	13,145,300
松竹	11,200	12,430.00	139,216,000
東宝	99,600	4,410.00	439,236,000
東映	5,500	25,090.00	137,995,000
エヌ・ティ・ティ・データ	449,100	1,751.00	786,374,100
ピー・シー・エー	2,500	4,440.00	11,100,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,814.00	10,884,000
DTS	35,100	2,610.00	91,611,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,000	6,130.00	441,360,000
シーイーシー	18,300	1,394.00	25,510,200
カブコン	144,600	3,360.00	485,856,000
アイ・エス・ビー	8,100	1,353.00	10,959,300
ジャステック	11,000	1,286.00	14,146,000
SCSK	39,000	6,330.00	246,870,000
日本システムウエア	5,800	2,215.00	12,847,000
アイネス	16,800	1,436.00	24,124,800
TKC	28,600	3,590.00	102,674,000

富士ソフト	18,000	5,520.00	99,360,000
N S D	54,400	1,810.00	98,464,000
コナミホールディングス	61,300	6,740.00	413,162,000
福井コンピュータホールディングス	7,800	4,140.00	32,292,000
J B C Cホールディングス	11,700	1,387.00	16,227,900
ミロク情報サービス	16,900	1,868.00	31,569,200
ソフトバンクグループ	1,337,700	10,170.00	13,604,409,000
ハウスイ	1,400	986.00	1,380,400
高千穂交易	6,600	1,121.00	7,398,600
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,723.00	4,824,400
伊藤忠食品	4,100	5,090.00	20,869,000
エレマテック	13,600	1,215.00	16,524,000
J A L U X	4,800	1,633.00	7,838,400
あらた	13,500	4,600.00	62,100,000
トーメンデバイス	2,200	4,160.00	9,152,000
東京エレクトロン デバイス	5,600	6,610.00	37,016,000
フィールズ	14,800	525.00	7,770,000
双日	934,600	343.00	320,567,800
アルフレッサ ホールディングス	175,500	2,048.00	359,424,000
横浜冷凍	47,500	895.00	42,512,500
ラサ商事	9,000	903.00	8,127,000
アルコニックス	18,000	1,649.00	29,682,000
神戸物産	116,800	2,916.00	340,588,800
ハイパー	3,500	559.00	1,956,500
あい ホールディングス	24,200	2,242.00	54,256,400
ディーブイエックス	5,200	980.00	5,096,000
ダイワボウホールディングス	77,100	1,815.00	139,936,500
マクニカ・富士エレホールディングス	40,400	2,331.00	94,172,400
ラクト・ジャパン	7,400	2,893.00	21,408,200
グリムス	5,000	1,845.00	9,225,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,500	737.00	21,741,500
八洲電機	13,100	971.00	12,720,100
メディアスホールディングス	9,600	982.00	9,427,200
レスターホールディングス	17,600	2,037.00	35,851,200
ジュテックホールディングス	3,900	1,000.00	3,900,000
大光	6,500	704.00	4,576,000
O C H Iホールディングス	4,900	1,295.00	6,345,500
T O K A Iホールディングス	82,000	916.00	75,112,000
黒谷	4,600	1,202.00	5,529,200
C o m i n i x	3,000	772.00	2,316,000
三洋貿易	17,100	1,120.00	19,152,000
ビューティガレージ	2,700	3,615.00	9,760,500



ウイン・パートナーズ	12,200	1,014.00	12,370,800
ミタチ産業	4,700	689.00	3,238,300
シップヘルスケアホールディングス	59,700	2,935.00	175,219,500
明治電機工業	5,800	1,408.00	8,166,400
デリカフーズホールディングス	6,600	629.00	4,151,400
スターティアホールディングス	3,300	1,115.00	3,679,500
コメダホールディングス	36,900	2,052.00	75,718,800
ピーバンドットコム	2,400	807.00	1,936,800
アセンテック	4,400	1,464.00	6,441,600
富士興産	5,200	1,296.00	6,739,200
協栄産業	1,900	1,375.00	2,612,500
小野建	15,200	1,390.00	21,128,000
南陽	3,500	1,801.00	6,303,500
佐島電機	10,600	804.00	8,522,400
エコートレーディング	3,600	606.00	2,181,600
伯東	10,300	1,544.00	15,903,200
コンドーテック	13,100	1,031.00	13,506,100
中山福	9,800	475.00	4,655,000
ナガイレーベン	22,500	2,574.00	57,915,000
三菱食品	18,600	3,050.00	56,730,000
松田産業	12,400	2,372.00	29,412,800
第一興商	33,600	4,250.00	142,800,000
メディパルホールディングス	169,600	2,115.00	358,704,000
S P K	7,300	1,323.00	9,657,900
萩原電気ホールディングス	6,300	2,669.00	16,814,700
アズワン	12,100	13,910.00	168,311,000
スズデン	5,900	1,346.00	7,941,400
尾家産業	5,000	1,227.00	6,135,000
シモジマ	10,400	1,162.00	12,084,800
ドウシシャ	16,000	1,884.00	30,144,000
小津産業	3,700	2,151.00	7,958,700
高速	9,000	1,457.00	13,113,000
たけびし	6,000	1,488.00	8,928,000
リックス	3,800	1,505.00	5,719,000
丸文	15,000	524.00	7,860,000
ハピネット	14,100	1,521.00	21,446,100
橋本総業ホールディングス	3,400	2,622.00	8,914,800
日本ライフライン	54,700	1,489.00	81,448,300
タカショー	11,000	762.00	8,382,000
マルカ	5,500	2,150.00	11,825,000
I D O M	57,100	619.00	35,344,900
進和	10,000	2,084.00	20,840,000

エスケイジャパン	4,200	456.00	1,915,200
ダイترون	7,200	2,043.00	14,709,600
シークス	21,500	1,555.00	33,432,500
田中商事	5,200	667.00	3,468,400
オーハシテクニカ	8,700	1,487.00	12,936,900
白銅	6,100	1,822.00	11,114,200
ダイコー通産	2,000	1,795.00	3,590,000
伊藤忠商事	1,183,600	3,564.00	4,218,350,400
丸紅	1,668,700	992.60	1,656,351,620
高島	2,700	1,780.00	4,806,000
長瀬産業	92,900	1,706.00	158,487,400
蝶理	10,800	1,552.00	16,761,600
豊田通商	170,000	5,110.00	868,700,000
三共生興	25,700	527.00	13,543,900
兼松	67,600	1,514.00	102,346,400
ツカモトコーポレーション	2,800	1,396.00	3,908,800
三井物産	1,373,900	2,539.50	3,489,019,050
日本紙パルプ商事	8,800	3,670.00	32,296,000
カメイ	22,100	1,165.00	25,746,500
東都水産	1,900	4,255.00	8,084,500
OUGホールディングス	2,700	2,798.00	7,554,600
スターゼン	12,500	2,288.00	28,600,000
山善	66,100	1,025.00	67,752,500
椿本興業	3,100	3,565.00	11,051,500
住友商事	1,067,900	1,560.00	1,665,924,000
内田洋行	7,200	4,870.00	35,064,000
三菱商事	1,030,300	3,011.00	3,102,233,300
第一実業	7,700	4,210.00	32,417,000
キャノンマーケティングジャパン	42,000	2,602.00	109,284,000
西華産業	8,900	1,720.00	15,308,000
佐藤商事	14,000	1,091.00	15,274,000
菱洋エレクトロ	12,900	2,719.00	35,075,100
東京産業	15,400	636.00	9,794,400
ユアサ商事	17,300	3,135.00	54,235,500
神鋼商事	3,800	2,549.00	9,686,200
トルク	10,300	253.00	2,605,900
阪和興業	33,900	3,605.00	122,209,500
正栄食品工業	11,000	4,115.00	45,265,000
カナデン	13,800	1,170.00	16,146,000
菱電商事	12,200	1,684.00	20,544,800
フルサト工業	8,600	1,641.00	14,112,600
岩谷産業	40,600	7,220.00	293,132,000

ナイス	6,700	2,015.00	13,500,500
ニチモウ	2,600	1,981.00	5,150,600
極東貿易	4,900	1,407.00	6,894,300
イワキ	22,700	759.00	17,229,300
三愛石油	41,700	1,272.00	53,042,400
稲畑産業	40,700	1,665.00	67,765,500
G S Iクレオス	8,300	1,225.00	10,167,500
明和産業	15,700	489.00	7,677,300
クワザワホールディングス	6,100	598.00	3,647,800
ヤマエ久野	12,400	1,090.00	13,516,000
ワキタ	33,300	1,100.00	36,630,000
東邦ホールディングス	54,300	1,917.00	104,093,100
サンゲツ	45,700	1,630.00	74,491,000
ミツウロコグループホールディングス	25,000	1,358.00	33,950,000
シナネンホールディングス	6,300	3,065.00	19,309,500
伊藤忠エネクス	37,500	1,094.00	41,025,000
サンリオ	47,500	1,754.00	83,315,000
サンワテクノス	11,200	1,283.00	14,369,600
リョーサン	18,700	2,278.00	42,598,600
新光商事	22,900	762.00	17,449,800
トーヨー	7,700	1,747.00	13,451,900
三信電気	9,100	2,049.00	18,645,900
東陽テクニカ	18,100	1,114.00	20,163,400
モスフードサービス	23,900	3,075.00	73,492,500
加賀電子	15,300	2,488.00	38,066,400
ソーダニッカ	16,200	593.00	9,606,600
立花エレテック	12,500	1,599.00	19,987,500
フォーバル	6,000	817.00	4,902,000
P A L T A C	27,100	5,480.00	148,508,000
三谷産業	22,300	417.00	9,299,100
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,800	2,696.00	10,244,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,500	2,211.00	3,316,500
コア商事ホールディングス	12,700	816.00	10,363,200
国際紙パルプ商事	36,200	247.00	8,941,400
ヤマタネ	7,300	1,489.00	10,869,700
丸紅建材リース	1,700	1,870.00	3,179,000
日鉄物産	12,100	4,685.00	56,688,500
泉州電業	4,800	3,480.00	16,704,000
トラスコ中山	38,700	3,015.00	116,680,500
オートバックスセブン	62,800	1,495.00	93,886,000
モリト	12,400	614.00	7,613,600
加藤産業	24,400	3,305.00	80,642,000

北恵	4,300	942.00	4,050,600
イノテック	9,500	1,342.00	12,749,000
イエローハット	32,000	1,937.00	61,984,000
J Kホールディングス	15,300	849.00	12,989,700
日伝	14,100	2,083.00	29,370,300
北沢産業	11,600	257.00	2,981,200
杉本商事	8,500	2,268.00	19,278,000
因幡電機産業	45,200	2,617.00	118,288,400
東テク	5,600	2,985.00	16,716,000
ミスミグループ本社	212,300	3,470.00	736,681,000
アルテック	12,500	325.00	4,062,500
タキヒヨー	5,700	1,859.00	10,596,300
蔵王産業	3,300	1,432.00	4,725,600
スズケン	71,700	4,085.00	292,894,500
ジェコス	11,700	918.00	10,740,600
グローセル	18,400	431.00	7,930,400
ローソン	42,800	5,100.00	218,280,000
サンエー	12,900	4,310.00	55,599,000
カワチ薬品	12,000	2,396.00	28,752,000
エービーシー・マート	26,500	5,990.00	158,735,000
ハードオフコーポレーション	7,900	795.00	6,280,500
アスクル	14,800	3,875.00	57,350,000
ゲオホールディングス	23,000	1,208.00	27,784,000
アダストリア	23,600	1,888.00	44,556,800
くら寿司	20,000	3,900.00	78,000,000
キャンドゥ	8,200	2,168.00	17,777,600
アイケイ	5,300	826.00	4,377,800
パルグループホールディングス	15,100	1,592.00	24,039,200
エディオン	72,000	1,188.00	85,536,000
サーラコーポレーション	35,000	618.00	21,630,000
ワッツ	8,600	902.00	7,757,200
ハローズ	6,900	3,010.00	20,769,000
フジオフードグループ本社	14,300	1,447.00	20,692,100
あみやき亭	3,800	2,864.00	10,883,200
大黒天物産	5,500	8,690.00	47,795,000
ハニーズホールディングス	13,800	1,076.00	14,848,800
ファーマライズホールディングス	4,600	782.00	3,597,200
アルペン	13,100	2,508.00	32,854,800
ハブ	6,000	655.00	3,930,000
クオールホールディングス	23,100	1,364.00	31,508,400
ジーンズホールディングス	11,600	7,800.00	90,480,000
ビックカメラ	100,700	1,145.00	115,301,500

D C Mホールディングス	104,700	1,091.00	114,227,700
Monotaro	240,800	2,550.00	614,040,000
東京一番フーズ	4,900	584.00	2,861,600
きちりホールディングス	4,500	576.00	2,592,000
アークランドサービスホールディングス	14,300	2,287.00	32,704,100
J.フロント リテイリング	202,400	1,050.00	212,520,000
ドトール・日レスホールディングス	27,000	1,649.00	44,523,000
マツモトキヨシホールディングス	70,000	4,455.00	311,850,000
ブロンコピリー	9,000	2,435.00	21,915,000
Z O Z O	99,800	3,595.00	358,781,000
トレジャー・ファクトリー	5,300	1,160.00	6,148,000
物語コーポレーション	9,100	6,650.00	60,515,000
ココカラファイン	15,100	7,550.00	114,005,000
三越伊勢丹ホールディングス	296,600	784.00	232,534,400
Hamee	4,600	1,583.00	7,281,800
マーケットエンタープライズ	1,300	1,524.00	1,981,200
ウエルシアホールディングス	89,600	3,475.00	311,360,000
クリエイティブSDホールディングス	25,100	3,400.00	85,340,000
丸善CHIホールディングス	19,700	393.00	7,742,100
ティーライフ	2,800	1,358.00	3,802,400
チムニー	5,200	1,255.00	6,526,000
シュッピン	11,800	1,122.00	13,239,600
オイシックス・ラ・大地	22,400	3,050.00	68,320,000
ネクステージ	30,000	1,762.00	52,860,000
ジョイフル本田	49,800	1,365.00	67,977,000
鳥貴族ホールディングス	6,400	1,632.00	10,444,800
ホットランド	12,900	1,369.00	17,660,100
すかいらーくホールディングス	189,900	1,642.00	311,815,800
SFPホールディングス	8,300	1,324.00	10,989,200
綿半ホールディングス	13,000	1,305.00	16,965,000
ヨシックス	3,500	2,009.00	7,031,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	49,500	1,107.00	54,796,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	1,492.00	13,428,000
B E E N O S	8,700	3,490.00	30,363,000
あさひ	12,900	1,490.00	19,221,000
日本調剤	10,500	1,770.00	18,585,000
コスモス薬品	17,100	15,790.00	270,009,000
トーエル	8,700	842.00	7,325,400
オンリー	3,700	465.00	1,720,500
セブン&アイ・ホールディングス	662,000	4,703.00	3,113,386,000
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	90,900	803.00	72,992,700

ツルハホールディングス	36,900	13,010.00	480,069,000
サンマルクホールディングス	13,600	1,700.00	23,120,000
フェリシモ	4,100	1,340.00	5,494,000
トリドールホールディングス	42,100	1,754.00	73,843,400
TOKYO BASE	15,800	736.00	11,628,800
ウイルプラスホールディングス	2,900	1,320.00	3,828,000
JMホールディングス	13,000	2,143.00	27,859,000
サツドラホールディングス	2,700	2,285.00	6,169,500
アレンザホールディングス	13,200	1,230.00	16,236,000
串カツ田中ホールディングス	4,700	1,712.00	8,046,400
パロックジャパンリミテッド	12,200	768.00	9,369,600
クスリのアオキホールディングス	16,900	7,990.00	135,031,000
力の源ホールディングス	7,700	614.00	4,727,800
FOOD & LIFE COMPANIES	99,100	4,725.00	468,247,500
メディカルシステムネットワーク	15,200	715.00	10,868,000
はるやまホールディングス	8,500	669.00	5,686,500
ノジマ	30,200	3,265.00	98,603,000
カッパ・クリエイト	23,700	1,495.00	35,431,500
ライトオン	12,600	705.00	8,883,000
良品計画	194,900	2,336.00	455,286,400
三城ホールディングス	22,400	283.00	6,339,200
アドヴァン	17,600	975.00	17,160,000
アルビス	5,600	2,336.00	13,081,600
コナカ	19,900	341.00	6,785,900
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,662.00	3,822,600
G-7ホールディングス	10,100	2,873.00	29,017,300
イオン北海道	22,500	1,130.00	25,425,000
コジマ	29,500	887.00	26,166,500
ヒマラヤ	6,300	991.00	6,243,300
コーナン商事	24,200	3,070.00	74,294,000
エコス	6,400	1,878.00	12,019,200
ワタミ	22,200	984.00	21,844,800
マルシェ	4,400	481.00	2,116,400
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	338,400	2,361.00	798,962,400
西松屋チェーン	37,300	1,733.00	64,640,900
ゼンショーホールディングス	91,000	2,823.00	256,893,000
幸楽苑ホールディングス	10,700	1,636.00	17,505,200
ハークスレイ	4,000	914.00	3,656,000
サイゼリヤ	25,300	2,461.00	62,263,300
VTホールディングス	64,600	429.00	27,713,400
魚力	5,500	1,902.00	10,461,000

フジ・コーポレーション	9,200	1,316.00	12,107,200
ユナイテッドアローズ	19,500	2,015.00	39,292,500
ハイデイ日高	24,600	1,736.00	42,705,600
京都きもの友禅	12,200	267.00	3,257,400
コロワイド	56,200	1,862.00	104,644,400
ピーシーデポコーポレーション	20,500	465.00	9,532,500
壱番屋	12,000	4,900.00	58,800,000
P L A N T	4,800	734.00	3,523,200
スギホールディングス	33,800	8,630.00	291,694,000
薬王堂ホールディングス	7,500	2,406.00	18,045,000
スクロール	24,600	892.00	21,943,200
ヨンドシーホールディングス	15,800	1,892.00	29,893,600
木曽路	22,300	2,280.00	50,844,000
S R S ホールディングス	22,200	830.00	18,426,000
リテールパートナーズ	20,800	1,208.00	25,126,400
ケーヨー	31,500	723.00	22,774,500
上新電機	20,000	2,827.00	56,540,000
日本瓦斯	83,800	1,889.00	158,298,200
ロイヤルホールディングス	29,500	1,957.00	57,731,500
いなげや	19,000	1,569.00	29,811,000
チヨダ	18,200	893.00	16,252,600
ライフコーポレーション	17,200	3,535.00	60,802,000
リンガーハット	20,900	2,267.00	47,380,300
M r M a x H D	23,800	647.00	15,398,600
A O K I ホールディングス	34,500	639.00	22,045,500
オークワ	26,700	1,171.00	31,265,700
コメリ	26,300	2,868.00	75,428,400
青山商事	38,100	863.00	32,880,300
しまむら	19,700	10,990.00	216,503,000
はせがわ	10,200	292.00	2,978,400
高島屋	123,400	1,230.00	151,782,000
松屋	37,200	945.00	35,154,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	80,400	864.00	69,465,600
近鉄百貨店	6,600	3,145.00	20,757,000
丸井グループ	143,300	2,097.00	300,500,100
アクシアル リテイリング	14,100	4,245.00	59,854,500
イオン	651,200	3,088.00	2,010,905,600
イズミ	34,400	4,375.00	150,500,000
平和堂	31,300	2,290.00	71,677,000
フジ	20,500	2,130.00	43,665,000
ヤオコー	19,200	6,980.00	134,016,000
ゼビオホールディングス	20,900	916.00	19,144,400

ケーズホールディングス	144,300	1,466.00	211,543,800
Olympicグループ	9,200	782.00	7,194,400
日産東京販売ホールディングス	26,500	247.00	6,545,500
シルバーライフ	3,600	2,559.00	9,212,400
Genky DrugStores	7,500	3,415.00	25,612,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	1,228.00	4,420,800
ブックオフグループホールディングス	9,900	1,006.00	9,959,400
ギフト	2,300	2,148.00	4,940,400
アインホールディングス	24,600	6,350.00	156,210,000
元気寿司	4,900	2,452.00	12,014,800
ヤマダホールディングス	567,800	562.00	319,103,600
アークランドサカモト	26,700	1,547.00	41,304,900
ニトリホールディングス	67,200	19,710.00	1,324,512,000
グルメ杵屋	12,500	960.00	12,000,000
愛眼	13,500	227.00	3,064,500
ケーユーホールディングス	9,200	989.00	9,098,800
吉野家ホールディングス	55,800	2,070.00	115,506,000
松屋フーズホールディングス	8,200	3,525.00	28,905,000
サガミホールディングス	24,100	1,039.00	25,039,900
関西スーパーマーケット	13,100	1,037.00	13,584,700
王将フードサービス	11,200	5,690.00	63,728,000
プレナス	19,100	2,045.00	39,059,500
ミニストップ	12,700	1,459.00	18,529,300
アークス	32,400	2,431.00	78,764,400
パローホールディングス	34,700	2,349.00	81,510,300
ベルク	8,400	5,920.00	49,728,000
大庄	9,400	1,004.00	9,437,600
ファーストリテイリング	22,600	87,660.00	1,981,116,000
サンドラッグ	63,800	3,880.00	247,544,000
サクスパー ホールディングス	15,000	638.00	9,570,000
ヤマザワ	4,200	1,702.00	7,148,400
やまや	3,500	2,326.00	8,141,000
ベルーナ	36,600	1,201.00	43,956,600
島根銀行	5,800	724.00	4,199,200
じもとホールディングス	11,400	713.00	8,128,200
めぶきフィナンシャルグループ	880,500	249.00	219,244,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,300	1,254.00	26,710,200
九州フィナンシャルグループ	346,000	442.00	152,932,000
ゆうちょ銀行	480,100	1,042.00	500,264,200
富山第一銀行	40,400	291.00	11,756,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,032,400	437.00	451,158,800
西日本フィナンシャルホールディングス	112,500	733.00	82,462,500



三十三フィナンシャルグループ	14,700	1,361.00	20,006,700
第四北越フィナンシャルグループ	27,600	2,419.00	66,764,400
ひろぎんホールディングス	249,900	620.00	154,938,000
新生銀行	138,200	1,623.00	224,298,600
あおぞら銀行	101,000	2,437.00	246,137,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,591,700	607.90	7,046,594,430
りそなホールディングス	1,955,500	468.20	915,565,100
三井住友トラスト・ホールディングス	320,300	3,857.00	1,235,397,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,172,700	3,970.00	4,655,619,000
千葉銀行	565,500	716.00	404,898,000
群馬銀行	348,800	378.00	131,846,400
武蔵野銀行	25,200	1,683.00	42,411,600
千葉興業銀行	43,100	279.00	12,024,900
筑波銀行	70,500	177.00	12,478,500
七十七銀行	53,200	1,436.00	76,395,200
青森銀行	13,100	2,346.00	30,732,600
秋田銀行	10,100	1,404.00	14,180,400
山形銀行	19,000	1,059.00	20,121,000
岩手銀行	11,100	2,161.00	23,987,100
東邦銀行	151,500	223.00	33,784,500
東北銀行	8,100	1,064.00	8,618,400
みちのく銀行	10,900	1,025.00	11,172,500
ふくおかフィナンシャルグループ	152,900	1,972.00	301,518,800
静岡銀行	412,700	867.00	357,810,900
十六銀行	21,200	2,093.00	44,371,600
スルガ銀行	148,600	415.00	61,669,000
八十二銀行	381,700	400.00	152,680,000
山梨中央銀行	19,700	857.00	16,882,900
大垣共立銀行	33,500	2,047.00	68,574,500
福井銀行	14,500	1,770.00	25,665,000
北國銀行	15,700	2,483.00	38,983,100
清水銀行	7,000	1,638.00	11,466,000
富山銀行	3,300	2,791.00	9,210,300
滋賀銀行	34,000	2,195.00	74,630,000
南都銀行	24,700	1,880.00	46,436,000
百五銀行	152,500	330.00	50,325,000
京都銀行	60,700	6,000.00	364,200,000
紀陽銀行	60,000	1,500.00	90,000,000
ほくほくフィナンシャルグループ	112,800	981.00	110,656,800
山陰合同銀行	106,800	523.00	55,856,400
中国銀行	145,800	910.00	132,678,000
鳥取銀行	5,400	1,147.00	6,193,800

伊予銀行	224,500	635.00	142,557,500
百十四銀行	18,000	1,570.00	28,260,000
四国銀行	24,000	735.00	17,640,000
阿波銀行	25,900	2,309.00	59,803,100
大分銀行	9,700	1,940.00	18,818,000
宮崎銀行	10,600	2,305.00	24,433,000
佐賀銀行	9,600	1,394.00	13,382,400
沖縄銀行	15,500	2,757.00	42,733,500
琉球銀行	36,800	734.00	27,011,200
セブン銀行	566,200	234.00	132,490,800
みずほフィナンシャルグループ	2,302,600	1,622.50	3,735,968,500
高知銀行	6,100	829.00	5,056,900
山口フィナンシャルグループ	211,500	674.00	142,551,000
長野銀行	5,600	1,199.00	6,714,400
名古屋銀行	13,600	2,811.00	38,229,600
北洋銀行	255,400	295.00	75,343,000
愛知銀行	5,700	2,928.00	16,689,600
中京銀行	6,100	1,726.00	10,528,600
大光銀行	5,800	1,481.00	8,589,800
愛媛銀行	23,700	936.00	22,183,200
トマト銀行	6,500	1,057.00	6,870,500
京葉銀行	72,300	435.00	31,450,500
栃木銀行	81,900	183.00	14,987,700
北日本銀行	5,300	1,842.00	9,762,600
東和銀行	29,700	633.00	18,800,100
福島銀行	19,400	236.00	4,578,400
大東銀行	8,100	638.00	5,167,800
トモニホールディングス	131,000	309.00	40,479,000
フィデアホールディングス	164,500	131.00	21,549,500
池田泉州ホールディングス	194,900	178.00	34,692,200
F P G	57,400	742.00	42,590,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,600	1,685.00	19,546,000
マーキュリアインベストメント	6,900	808.00	5,575,200
S B Iホールディングス	208,900	3,030.00	632,967,000
ジャフコ グループ	26,100	7,840.00	204,624,000
大和証券グループ本社	1,269,500	625.10	793,564,450
野村ホールディングス	2,587,600	580.50	1,502,101,800
岡三証券グループ	144,900	479.00	69,407,100
丸三証券	50,700	668.00	33,867,600
東洋証券	57,300	176.00	10,084,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	181,300	428.00	77,596,400
光世証券	4,400	712.00	3,132,800

水戸証券	46,000	312.00	14,352,000
いちよし証券	34,300	633.00	21,711,900
松井証券	83,200	872.00	72,550,400
マネックスグループ	152,200	918.00	139,719,600
極東証券	23,000	852.00	19,596,000
岩井コスモホールディングス	17,500	1,781.00	31,167,500
藍澤証券	30,700	1,044.00	32,050,800
マネーパートナーズグループ	19,000	257.00	4,883,000
スパークス・グループ	79,100	295.00	23,334,500
かんぽ生命保険	210,100	2,205.00	463,270,500
S O M P Oホールディングス	298,700	4,255.00	1,270,968,500
アニコム ホールディングス	47,700	1,047.00	49,941,900
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	411,500	3,296.00	1,356,304,000
第一生命ホールディングス	895,200	2,056.50	1,840,978,800
東京海上ホールディングス	558,100	5,472.00	3,053,923,200
T & Dホールディングス	506,500	1,397.00	707,580,500
アドバンスクリエイト	8,000	1,047.00	8,376,000
全国保証	44,100	4,935.00	217,633,500
イントラスト	5,100	660.00	3,366,000
日本モーゲージサービス	8,800	1,022.00	8,993,600
C a s a	5,000	928.00	4,640,000
アルヒ	25,100	1,827.00	45,857,700
プレミアグループ	7,900	2,411.00	19,046,900
クレディセゾン	99,100	1,298.00	128,631,800
芙蓉総合リース	17,800	7,540.00	134,212,000
みずほリース	26,200	3,360.00	88,032,000
東京センチュリー	39,400	6,710.00	264,374,000
日本証券金融	71,900	823.00	59,173,700
アイフル	285,000	324.00	92,340,000
リコーリース	13,400	3,495.00	46,833,000
イオンフィナンシャルサービス	103,900	1,271.00	132,056,900
アコム	341,000	472.00	160,952,000
ジャックス	18,800	2,193.00	41,228,400
オリエントコーポレーション	459,800	148.00	68,050,400
オリックス	1,028,900	1,821.00	1,873,626,900
三菱H C キャピタル	586,400	641.00	375,882,400
九州リースサービス	8,600	679.00	5,839,400
日本取引所グループ	457,800	2,647.50	1,212,025,500
イー・ギャランティ	19,600	2,120.00	41,552,000
アサックス	9,100	695.00	6,324,500
N E C キャピタルソリューション	7,000	2,071.00	14,497,000
いちご	193,100	349.00	67,391,900

日本駐車場開発	195,000	159.00	31,005,000
スター・マイカ・ホールディングス	10,000	1,110.00	11,100,000
S R Eホールディングス	2,700	5,010.00	13,527,000
A Dワークスグループ	33,600	163.00	5,476,800
ヒューリック	360,600	1,267.00	456,880,200
三栄建築設計	7,500	1,985.00	14,887,500
野村不動産ホールディングス	103,500	2,818.00	291,663,000
三重交通グループホールディングス	37,400	492.00	18,400,800
サムティ	24,800	2,055.00	50,964,000
ディア・ライフ	27,100	482.00	13,062,200
日本商業開発	11,600	1,743.00	20,218,800
プレサンスコーポレーション	28,800	1,704.00	49,075,200
ハウスコム	4,100	1,246.00	5,108,600
日本管理センター	10,300	1,286.00	13,245,800
サンセイランディック	6,700	849.00	5,688,300
フージャースホールディングス	27,600	691.00	19,071,600
オープンハウス	54,100	4,540.00	245,614,000
東急不動産ホールディングス	463,100	643.00	297,773,300
飯田グループホールディングス	141,900	2,780.00	394,482,000
イーランド	4,300	942.00	4,050,600
ムゲンエステート	13,400	502.00	6,726,800
ハウズドゥ	8,300	1,068.00	8,864,400
シーアールイー	5,400	1,475.00	7,965,000
グッドコムアセット	9,100	1,470.00	13,377,000
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,455.00	12,438,000
テンポイノベーション	6,400	886.00	5,670,400
フェイスネットワーク	2,500	1,311.00	3,277,500
パーク24	91,700	2,230.00	204,491,000
パラカ	5,300	1,700.00	9,010,000
三井不動産	772,900	2,515.00	1,943,843,500
三菱地所	1,114,000	1,872.50	2,085,965,000
平和不動産	29,400	3,910.00	114,954,000
東京建物	168,300	1,727.00	290,654,100
ダイビル	44,700	1,278.00	57,126,600
京阪神ビルディング	30,200	1,520.00	45,904,000
住友不動産	381,300	3,913.00	1,492,026,900
テ-オーシー	35,300	741.00	26,157,300
東京楽天地	3,100	4,245.00	13,159,500
スターツコーポレーション	20,700	2,756.00	57,049,200
フジ住宅	21,800	666.00	14,518,800
空港施設	19,400	635.00	12,319,000
明和地所	10,200	668.00	6,813,600

ゴールドクレスト	16,200	1,630.00	26,406,000
エスリード	7,500	1,678.00	12,585,000
日神グループホールディングス	28,100	501.00	14,078,100
日本エスコン	30,700	759.00	23,301,300
タカラレーベン	71,000	369.00	26,199,000
A V A N T I A	11,100	907.00	10,067,700
イオンモール	85,800	1,757.00	150,750,600
毎日コムネット	7,700	775.00	5,967,500
ファースト住建	8,400	1,244.00	10,449,600
カチタス	42,400	3,340.00	141,616,000
トーセイ	24,700	1,123.00	27,738,100
穴吹興産	4,400	2,127.00	9,358,800
サンフロンティア不動産	22,300	1,024.00	22,835,200
エフ・ジェー・ネクスト	18,000	1,053.00	18,954,000
インテリックス	3,800	862.00	3,275,600
ランドビジネス	7,100	402.00	2,854,200
サンネクスタグループ	6,800	991.00	6,738,800
グランディハウス	14,700	465.00	6,835,500
日本空港ビルデング	59,200	4,870.00	288,304,000
明豊ファシリティワークス	7,900	789.00	6,233,100
日本工営	10,300	3,095.00	31,878,500
L I F U L L	57,800	409.00	23,640,200
ミクシィ	41,800	2,706.00	113,110,800
ジェイエシーリクルートメント	11,400	1,792.00	20,428,800
日本M&Aセンター	269,400	2,771.00	746,507,400
メンバーズ	5,000	2,976.00	14,880,000
中広	3,100	349.00	1,081,900
UTグループ	23,800	3,720.00	88,536,000
アイティメディア	5,600	1,993.00	11,160,800
タケエイ	18,500	1,284.00	23,754,000
E・Jホールディングス	8,800	1,135.00	9,988,000
夢真ビーネックスグループ	43,700	1,428.00	62,403,600
コシダカホールディングス	44,400	567.00	25,174,800
アルトナー	4,300	813.00	3,495,900
パソナグループ	17,900	1,941.00	34,743,900
C D S	4,200	1,568.00	6,585,600
リンクアンドモチベーション	30,200	690.00	20,838,000
G C A	21,800	850.00	18,530,000
エス・エム・エス	55,800	3,060.00	170,748,000
サニーサイドアップグループ	6,000	756.00	4,536,000
パーソルホールディングス	164,300	2,118.00	347,987,400
リニカル	9,600	741.00	7,113,600

クックパッド	52,500	282.00	14,805,000
アイ・ケイ・ケイ	8,400	670.00	5,628,000
学情	6,000	1,375.00	8,250,000
スタジオアリス	8,400	2,400.00	20,160,000
シミックホールディングス	9,300	1,577.00	14,666,100
エプロ	4,300	981.00	4,218,300
N J S	4,200	2,013.00	8,454,600
総合警備保障	65,400	4,875.00	318,825,000
カカクコム	121,400	2,882.00	349,874,800
アイロムグループ	5,900	2,364.00	13,947,600
セントケア・ホールディング	12,200	1,194.00	14,566,800
サイネックス	3,200	666.00	2,131,200
ルネサンス	10,500	1,161.00	12,190,500
ディップ	25,800	3,230.00	83,334,000
デジタルホールディングス	11,600	1,931.00	22,399,600
新日本科学	20,400	733.00	14,953,200
キャリアデザインセンター	4,400	1,069.00	4,703,600
ベネフィット・ワン	59,800	2,742.00	163,971,600
エムスリー	289,700	7,462.00	2,161,741,400
ツカダ・グローバルホールディング	13,100	347.00	4,545,700
アウトソーシング	94,200	1,904.00	179,356,800
ウェルネット	17,000	521.00	8,857,000
ワールドホールディングス	5,700	2,781.00	15,851,700
ディー・エヌ・エー	69,600	2,100.00	146,160,000
博報堂D Yホールディングス	228,600	1,838.00	420,166,800
ぐるなび	29,000	592.00	17,168,000
タカミヤ	20,400	524.00	10,689,600
ジャパンベストレスキューシステム	12,900	730.00	9,417,000
ファンコミュニケーションズ	45,800	398.00	18,228,400
ライク	4,500	2,315.00	10,417,500
ビジネス・ブレークスルー	7,500	449.00	3,367,500
エスプール	42,400	958.00	40,619,200
W D Bホールディングス	7,600	2,357.00	17,913,200
手間いらず	2,100	5,570.00	11,697,000
ティア	10,100	491.00	4,959,100
C D G	1,700	1,594.00	2,709,800
アドウェイズ	27,000	861.00	23,247,000
バリューコマース	11,100	3,350.00	37,185,000
インフォマート	166,300	900.00	149,670,000
J Pホールディングス	47,800	317.00	15,152,600
エコナックホールディングス	32,600	92.00	2,999,200
E P Sホールディングス	24,900	1,400.00	34,860,000

レグス	4,200	2,488.00	10,449,600
プレステージ・インターナショナル	61,900	744.00	46,053,600
アミューズ	9,100	2,361.00	21,485,100
ドリームインキュベータ	5,300	1,014.00	5,374,200
クイック	10,400	1,246.00	12,958,400
T A C	10,000	245.00	2,450,000
電通グループ	184,700	3,535.00	652,914,500
イオンファンタジー	6,500	2,026.00	13,169,000
シーティーエス	18,800	888.00	16,694,400
ネクシィーズグループ	6,000	996.00	5,976,000
H . U . グループホールディングス	46,000	3,655.00	168,130,000
アルプス技研	14,700	2,042.00	30,017,400
ダイオーズ	3,500	990.00	3,465,000
日本空調サービス	17,500	743.00	13,002,500
オリエンタルランド	174,600	15,265.00	2,665,269,000
ダスキン	38,200	2,654.00	101,382,800
明光ネットワークジャパン	21,200	589.00	12,486,800
ファルコホールディングス	8,000	1,698.00	13,584,000
ラウンドワン	56,200	1,239.00	69,631,800
リゾートトラスト	75,400	1,698.00	128,029,200
ビー・エム・エル	21,200	3,835.00	81,302,000
りらいあコミュニケーションズ	25,200	1,334.00	33,616,800
リソー教育	84,200	292.00	24,586,400
早稲田アカデミー	7,300	926.00	6,759,800
ユー・エス・エス	183,900	2,001.00	367,983,900
東京個別指導学院	15,000	592.00	8,880,000
サイバーエージェント	404,800	2,190.00	886,512,000
楽天グループ	766,100	1,334.00	1,021,977,400
クリーク・アンド・リバー社	8,800	1,581.00	13,912,800
モーニングスター	24,500	461.00	11,294,500
テー・オー・ダブリュー	29,600	326.00	9,649,600
山田コンサルティンググループ	9,800	1,238.00	12,132,400
セントラルスポーツ	6,200	2,430.00	15,066,000
フルキャストホールディングス	14,100	1,979.00	27,903,900
エン・ジャパン	29,300	3,440.00	100,792,000
リソルホールディングス	1,900	4,000.00	7,600,000
テクノプロ・ホールディングス	32,800	8,470.00	277,816,000
アトラグループ	3,800	335.00	1,273,000
インターワークス	5,400	390.00	2,106,000
アイ・アールジャパンホールディングス	6,700	13,130.00	87,971,000
K e e P e r 技研	10,700	2,308.00	24,695,600
ファーストロジック	3,500	775.00	2,712,500

三機サービス	3,400	1,076.00	3,658,400
Gunosy	10,500	1,022.00	10,731,000
デザインワン・ジャパン	5,900	255.00	1,504,500
イー・ガーディアン	7,300	2,786.00	20,337,800
リブセンス	10,200	231.00	2,356,200
ジャパンマテリアル	50,700	1,275.00	64,642,500
ベクトル	20,700	958.00	19,830,600
ウチヤマホールディングス	8,800	378.00	3,326,400
チャーム・ケア・コーポレーション	12,400	1,263.00	15,661,200
キャリアリンク	5,500	2,236.00	12,298,000
I B J	13,700	912.00	12,494,400
アサンテ	6,100	1,823.00	11,120,300
バリューHR	6,700	1,660.00	11,122,000
M&Aキャピタルパートナーズ	13,500	4,690.00	63,315,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,500	1,696.00	11,024,000
E R Iホールディングス	5,100	588.00	2,998,800
アビスト	2,600	3,060.00	7,956,000
シグマクシス	9,100	2,139.00	19,464,900
ウィルグループ	12,300	1,018.00	12,521,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	25,400	253.00	6,426,200
メドピア	12,700	5,730.00	72,771,000
レアジョブ	3,200	2,045.00	6,544,000
リクルートホールディングス	1,176,100	5,257.00	6,182,757,700
エラン	22,800	1,372.00	31,281,600
土木管理総合試験所	8,800	406.00	3,572,800
ネットマーケティング	8,300	591.00	4,905,300
日本郵政	1,242,400	949.40	1,179,534,560
ベルシステム24ホールディングス	27,700	1,694.00	46,923,800
鎌倉新書	16,700	1,365.00	22,795,500
S M N	3,800	805.00	3,059,000
グローバルキッズCOMPANY	3,200	1,013.00	3,241,600
エアトリ	10,300	2,246.00	23,133,800
アトラエ	11,600	1,679.00	19,476,400
ストライク	6,300	4,280.00	26,964,000
ソラスト	40,500	1,410.00	57,105,000
セラク	5,300	2,311.00	12,248,300
インソース	16,000	2,456.00	39,296,000
ベイカレント・コンサルティング	10,800	34,000.00	367,200,000
Orchestra Holdings	3,700	2,787.00	10,311,900
アイモバイル	6,000	1,368.00	8,208,000
キャリアインデックス	7,200	602.00	4,334,400
MS - Japan	6,900	1,039.00	7,169,100



船場	3,600	854.00	3,074,400
グレイステクノロジー	16,800	2,553.00	42,890,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,400	2,242.00	106,270,800
フルテック	2,500	1,474.00	3,685,000
グリーンズ	6,200	592.00	3,670,400
GameWith	5,300	665.00	3,524,500
ソウルドアウト	4,100	1,587.00	6,506,700
MS&Consulting	3,100	607.00	1,881,700
ウェルビー	6,200	1,482.00	9,188,400
エル・ティー・エス	1,600	4,445.00	7,112,000
ミダック	3,600	5,430.00	19,548,000
日総工産	13,200	776.00	10,243,200
キュービーネットホールディングス	7,700	1,773.00	13,652,100
RPAホールディングス	19,200	765.00	14,688,000
スプリックス	4,900	1,067.00	5,228,300
マネジメントソリューションズ	8,100	1,976.00	16,005,600
プロレド・パートナーズ	3,100	2,964.00	9,188,400
テノ・ホールディングス	2,000	1,130.00	2,260,000
フロンティア・マネジメント	3,900	1,659.00	6,470,100
ピアラ	1,300	1,582.00	2,056,600
コプロ・ホールディングス	2,300	1,326.00	3,049,800
ギークス	3,000	1,709.00	5,127,000
カーブスホールディングス	45,400	821.00	37,273,400
フォーラムエンジニアリング	11,700	1,043.00	12,203,100
ダイレクトマーケティングミックス	8,600	3,485.00	29,971,000
ポピンズホールディングス	4,400	4,600.00	20,240,000
LITALICO	6,700	4,620.00	30,954,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,700	730.00	6,351,000
リログループ	89,900	2,291.00	205,960,900
東祥	10,400	1,679.00	17,461,600
エイチ・アイ・エス	25,200	2,289.00	57,682,800
ラックランド	4,800	2,498.00	11,990,400
共立メンテナンス	27,300	3,535.00	96,505,500
イチネンホールディングス	17,300	1,299.00	22,472,700
建設技術研究所	10,700	2,563.00	27,424,100
スペース	10,900	903.00	9,842,700
長大	6,700	1,774.00	11,885,800
燦ホールディングス	7,400	1,065.00	7,881,000
スバル興業	1,000	8,170.00	8,170,000
東京テアトル	6,400	1,256.00	8,038,400
タナベ経営	3,300	1,396.00	4,606,800
ナガワ	5,300	8,250.00	43,725,000

東京都競馬	10,800	5,420.00	58,536,000	
カナモト	29,000	2,775.00	80,475,000	
西尾レントオール	15,200	3,215.00	48,868,000	
トランス・コスモス	15,700	3,115.00	48,905,500	
乃村工藝社	70,700	831.00	58,751,700	
藤田観光	6,500	1,937.00	12,590,500	
KNT-CTホールディングス	8,700	1,074.00	9,343,800	
日本管財	17,700	2,245.00	39,736,500	
トーカイ	16,000	2,462.00	39,392,000	
セコム	161,800	9,317.00	1,507,490,600	
セントラル警備保障	8,000	2,990.00	23,920,000	
丹青社	31,300	860.00	26,918,000	
メイテック	20,100	6,130.00	123,213,000	
応用地質	18,700	1,328.00	24,833,600	
船井総研ホールディングス	33,700	2,269.00	76,465,300	
進学会ホールディングス	7,100	423.00	3,003,300	
オオバ	11,900	859.00	10,222,100	
いであ	4,100	1,866.00	7,650,600	
学究社	5,000	1,311.00	6,555,000	
ベネッセホールディングス	60,300	2,443.00	147,312,900	
イオンディライト	20,300	3,385.00	68,715,500	
ナック	8,100	947.00	7,670,700	
ダイセキ	27,600	4,115.00	113,574,000	
ステップ	6,200	1,609.00	9,975,800	
合 計	180,192,000		460,742,957,170	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,882,204,414
コール・ローン	1,318,330,516
株式	492,170,999,091
投資信託受益証券	310,449,285
投資証券	10,950,105,288
派生商品評価勘定	322,384,565
未収入金	27,731,317
未収配当金	553,123,772
差入委託証拠金	3,078,760,313
流動資産合計	513,614,088,561
資産合計	513,614,088,561
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	519,068
前受金	322,316,967
未払解約金	1,083,786,846
未払利息	1,021
流動負債合計	1,406,623,902
負債合計	1,406,623,902
純資産の部	
元本等	
元本	137,665,256,872
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	374,542,207,787
元本等合計	512,207,464,659
純資産合計	512,207,464,659
負債純資産合計	513,614,088,561

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2021年 5月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2021年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,665,256,872口

	2021年 5月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,7207円 (37,207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 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2021年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	152,201,958,636円
期中追加設定元本額	5,111,723,733円
期中一部解約元本額	19,648,425,497円
期末元本額	137,665,256,872円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,025,595,498円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,989,142円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,144,706,368円
世界経済インデックスファンド	8,197,835,659円
外国株式インデックス・オープン	822,084,955円
D C マイセレクション 2 5	836,889,650円

区分	2021年 5月10日現在
D Cマイセレクション5 0	4,114,945,534円
D Cマイセレクション7 5	4,542,390,980円
D C外国株式インデックス・オープン	10,733,322,573円
D CマイセレクションS 2 5	383,598,122円
D CマイセレクションS 5 0	1,890,840,585円
D CマイセレクションS 7 5	1,416,017,250円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	67,346,708円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	174,648,329円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	124,506,498円
D C世界経済インデックスファンド	9,882,386,055円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,852,474,641円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,361,961円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	6,247,966円
外国株式インデックス・オープンV A 1（適格機関投資家専用）	31,737,507円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,582,046円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	92,579,914円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	15,436,678円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	48,976,172円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	417,591,535円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	225,520,861円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,613,226,997円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	797,662,679円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	43,460,989円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	225,305,939円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	76,547,469円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,357,336,899円
F O F s用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,510,793,254円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,078,640,974円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,326,916,742円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,740,937,338円
分散投資コア戦略ファンドA	1,991,958,160円
分散投資コア戦略ファンドS	9,758,316,514円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,238,262,063円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,116,664,979円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,119,546,807円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	643,651,254円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,849,509円
S M T インデックスバランス・オープン	171,693,954円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	746,195,230円
外国株式S M T Bセレクション（SMA専用）	26,821,979,295円
S M T 世界経済インデックス・オープン	155,785,906円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	507,726,433円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	90,169,093円

区分	2021年 5月10日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,146,186円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	94,941,701円
グローバル経済コア	707,955,113円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,674,601円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,875,695円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	704,356,644円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	68,895,460円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	2,059,102円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	2,079,468円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	893,725円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	2,024,530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)	627,091,183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)	876,377,720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)	1,437,113,120円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	816,695,870円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	123,681,833円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	5,394,645円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	286,317,818円
SMTAMバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	441,289,364円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	316,266,245円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	305,396,245円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	303,279,781円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	275,209,159円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	128,875,186,471
投資信託受益証券	21,805,554
投資証券	1,822,970,486
合計	130,676,351,403

(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 5月10日現在)

--	--	--	--



区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		
			時価 (円)	評価損益 (円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,285,823,213	-	8,608,140,180	322,316,967
合計		8,285,823,213	-	8,608,140,180	322,316,967

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2021年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		
			時価 (円)	評価損益 (円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	199,498,200	-	199,046,730	451,470
	アメリカドル	199,498,200	-	199,046,730	451,470
合計		199,498,200	-	199,046,730	451,470

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	24.63	1,428,047.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	17.39	623,935.81	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	82.65	1,573,160.10	
	CHEVRON CORP	167,685	110.02	18,448,703.70	
	CONOCOPHILLIPS	117,327	57.10	6,699,371.70	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	26.22	1,494,540.00	
	EOG RESOURCES INC	51,325	83.10	4,265,107.50	

EXXON MOBIL	368,497	62.43	23,005,267.71
HALLIBURTON CO	77,539	22.95	1,779,520.05
HESS CORP	24,844	82.53	2,050,375.32
KINDER MORGAN INC	179,427	17.84	3,200,977.68
MARATHON PETROLEUM CORP	57,189	60.00	3,431,340.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	27.39	2,166,713.34
ONEOK INC	37,709	53.38	2,012,906.42
PHILLIPS 66	38,113	86.04	3,279,242.52
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	167.83	3,013,219.82
SCHLUMBERGER	122,666	31.89	3,911,818.74
VALERO ENERGY CORP	34,683	80.49	2,791,634.67
WILLIAMS COS	104,984	25.30	2,656,095.20
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,118	290.55	5,554,734.90
ALBEMARLE CORP	10,180	162.72	1,656,489.60
AMCOR PLC	132,975	12.45	1,655,538.75
AVERY DENNISON CORP	7,457	221.46	1,651,427.22
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	33.71	593,498.26
BALL CORP	27,925	90.70	2,532,797.50
CELANESE CORP-SERIES A	9,842	168.63	1,659,656.46
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	55.10	1,050,812.10
CORTEVA INC	64,900	48.86	3,171,014.00
CROWN HOLDINGS INC	11,212	113.54	1,273,010.48
DOW INC	66,007	69.04	4,557,123.28
DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	82.85	3,822,616.15
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,641	124.97	1,579,745.77
ECOLAB INC	22,189	228.43	5,068,633.27
FMC CORP	12,118	120.41	1,459,128.38
FREEMONT-MCMORAN INC	125,342	43.97	5,511,287.74
INT'L PAPER CO	33,803	61.64	2,083,616.92
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,145	146.45	2,803,785.25
LINDE PLC	45,667	298.93	13,651,236.31
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	114.06	2,586,082.38
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	378.28	2,012,827.88
MOSAIC CO/THE	31,911	37.00	1,180,707.00
NEWMONT CORPORATION	71,834	67.33	4,836,583.22
NUCOR CORP	25,565	98.76	2,524,799.40
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	153.16	1,361,592.40
PPG INDUSTRIES INC	20,538	179.49	3,686,365.62
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	97.47	1,211,552.10
SEALED AIR CORP	14,689	57.06	838,154.34
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,206	287.23	6,090,999.38
STEEL DYNAMICS INC	18,273	63.36	1,157,777.28

VULCAN MATERIALS CO	11,347	191.71	2,175,333.37
WESTROCK CO	24,734	59.74	1,477,609.16
3 M COMPANY	50,115	203.07	10,176,853.05
ALLEGION PLC	7,601	141.25	1,073,641.25
AMETEK INC	19,666	137.33	2,700,731.78
BOEING CO	46,647	235.47	10,983,969.09
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	44.84	3,165,838.52
CATERPILLAR	47,231	240.99	11,382,198.69
CUMMINS INC	12,914	266.39	3,440,160.46
DEERE&CO	25,864	394.22	10,196,106.08
DOVER CORP	12,202	152.91	1,865,807.82
EATON CORP	34,431	147.52	5,079,261.12
EMERSON ELECTRIC CO	53,460	95.05	5,081,373.00
FASTENAL CO	51,828	53.25	2,759,841.00
FORTIVE CORP	25,722	72.82	1,873,076.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	111.56	1,429,083.60
GENERAC HOLDINGS INC	5,800	327.38	1,898,804.00
GENERAL DYNAMICS CORP	21,212	194.82	4,132,521.84
GENERAL ELECTRIC CO	761,269	13.30	10,124,877.70
GRAINGER (WW) INC	3,846	465.64	1,790,851.44
HEICO CORP	3,640	141.63	515,533.20
HEICO CORP-CLASS A	6,449	131.00	844,819.00
HONEYWELL INTL INC	60,714	228.79	13,890,756.06
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	33.57	1,226,983.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	216.99	764,238.78
IDEX CORP	6,916	226.00	1,563,016.00
ILLINOIS TOOL WORKS	27,403	238.28	6,529,586.84
INGERSOLL-RAND INC	31,562	50.53	1,594,827.86
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	66.75	1,341,675.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	63,375	65.70	4,163,737.50
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	219.25	3,965,355.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	348.00	1,065,576.00
LOCKHEED MARTIN CORP	21,652	390.34	8,451,641.68
MASCO CORP	23,467	66.86	1,569,003.62
NORDSON CORP	4,880	208.83	1,019,090.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,146	370.63	5,242,931.98
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	78.19	2,933,610.61
OWENS CORNING	10,458	106.92	1,118,169.36
PACCAR INC	30,155	94.50	2,849,647.50
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	319.26	3,586,566.84
PENTAIR PLC	14,533	67.94	987,372.02
PLUG POWER INC	41,884	23.05	965,426.20

RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	131,986	85.71	11,312,520.06
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	270.68	2,690,017.84
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,326	444.46	4,145,033.96
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	58.84	813,639.52
SMITH (A.O.) CORP	12,146	71.13	863,944.98
SNAP-ON INC	4,900	251.56	1,232,644.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	219.69	3,013,707.42
SUNRUN INC	11,100	45.64	506,604.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,087	435.99	1,345,901.13
TEXTRON	21,534	68.08	1,466,034.72
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	183.68	3,791,522.56
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	607.99	2,690,355.75
UNITED RENTALS INC	6,643	347.33	2,307,313.19
WABTEC CORP	15,024	81.87	1,230,014.88
XYLEM INC	16,718	119.34	1,995,126.12
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	84.11	955,826.04
CINTAS CORP	7,572	360.67	2,730,993.24
COPART INC	18,067	124.56	2,250,425.52
COSTAR GROUP INC	3,403	850.67	2,894,830.01
EQUIFAX INC	10,409	239.56	2,493,580.04
IHS MARKIT LTD	32,602	107.87	3,516,777.74
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	139.95	1,683,038.70
LEIDOS HOLDINGS	12,829	104.03	1,334,600.87
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	110.88	2,218,376.16
ROBERT HALF INTL INC	9,566	90.32	864,001.12
ROLLINS INC	21,849	37.12	811,034.88
TRANSUNION	17,091	106.21	1,815,235.11
VERISK ANALYTICS INC	13,390	178.77	2,393,730.30
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	123.34	2,769,476.36
WASTE MANAGEMENT INC	37,767	141.38	5,339,498.46
AMERCO	1,000	620.41	620,410.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	99.51	1,123,666.92
CSX CORP	65,822	103.13	6,788,222.86
DELTA AIR LINES INC	14,609	46.11	673,620.99
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	118.67	1,693,658.24
FEDEX CORP	21,597	314.69	6,796,359.93
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	178.27	1,257,160.04
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	305.22	2,431,077.30
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	49.37	528,259.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,987	289.81	6,372,052.47
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	269.57	2,157,368.71
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	61.66	834,444.78

UBER TECHNOLOGIES INC	84,980	47.03	3,996,609.40
UNION PACIFIC CORP	58,466	229.48	13,416,777.68
UNITED PARCEL SERVICE B	62,170	217.50	13,521,975.00
XPO LOGISTICS INC	8,001	147.00	1,176,147.00
APTIV PLC	23,540	148.77	3,502,045.80
AUTOLIV INC	6,776	103.84	703,619.84
BORGWARNER INC	23,790	53.80	1,279,902.00
FORD MOTOR COMPANY	348,612	11.82	4,120,593.84
GENERAL MOTORS CO	114,044	58.99	6,727,455.56
LEAR CORP	5,287	195.12	1,031,599.44
TESLA INC	66,189	672.37	44,503,497.93
DR HORTON INC	29,632	103.87	3,077,875.84
GARMIN LTD	12,854	143.56	1,845,320.24
HASBRO INC	12,468	99.15	1,236,202.20
LENNAR CORP-CL A	24,928	108.05	2,693,470.40
LULULEMON ATHLETICA INC	10,777	330.24	3,558,996.48
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	229.74	1,162,943.88
NEWELL BRANDS INC	37,563	29.07	1,091,956.41
NIKE B	109,235	137.81	15,053,675.35
NVR INC	297	5,211.38	1,547,779.86
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	83.81	1,821,694.16
PULTE GROUP INC	24,818	61.73	1,532,015.14
VF CORP	28,638	89.88	2,573,983.44
WHIRLPOOL CORP	5,220	252.95	1,320,399.00
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	151.21	705,394.65
ARAMARK	20,955	38.09	798,175.95
BOOKING HOLDINGS INC	3,556	2,327.08	8,275,096.48
CARNIVAL CORPORATION	70,520	26.76	1,887,115.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,284	1,426.05	3,257,098.20
DARDEN RESTAURANTS INC	12,063	142.38	1,717,529.94
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	432.47	1,609,220.87
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	48.42	758,935.08
EXPEDIA GROUP INC	11,638	173.46	2,018,727.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	123.44	2,936,390.72
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	57.70	1,694,649.00
MARRIOTT INTL A	24,361	146.69	3,573,515.09
MCDONALD'S CORP	64,866	234.84	15,233,131.44
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	18.21	321,625.02
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,847	39.92	1,630,612.24
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,923	84.29	1,426,439.67
STARBUCKS CORP	102,054	114.34	11,668,854.36
VAIL RESORTS INC	3,574	312.80	1,117,947.20

WYNN RESORTS LTD	9,302	126.29	1,174,749.58
YUM BRANDS INC	25,844	121.23	3,133,068.12
ACTIVISION BLIZZARD INC	66,954	94.80	6,347,239.20
ALPHABET INC-CL A	26,249	2,351.93	61,735,810.57
ALPHABET INC-CL C	25,920	2,398.69	62,174,044.80
ALTICE USA INC- A	22,505	37.14	835,835.70
CABLE ONE INC	445	1,756.23	781,522.35
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	12,405	693.44	8,602,123.20
COMCAST CORP-CL A	397,973	58.11	23,126,211.03
DISCOVERY INC - A	12,804	37.56	480,918.24
DISCOVERY INC-C	28,190	32.62	919,557.80
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	46.53	1,121,512.59
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	142.42	3,552,524.48
FACEBOOK INC-A	209,903	319.08	66,975,849.24
FOX CORP - CLASS A	27,658	38.32	1,059,854.56
FOX CORP- CLASS B	15,092	37.17	560,969.64
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	241.40	1,622,449.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	33.47	1,132,423.98
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	161.65	416,895.35
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	166.37	2,248,656.92
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	44.25	827,165.25
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	42.85	739,762.40
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	42.61	272,022.24
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	79.96	1,112,083.68
MATCH GROUP INC	21,851	146.19	3,194,397.69
NETFLIX INC	38,504	503.84	19,399,855.36
NEWS CORP-CLASS A	33,479	27.44	918,663.76
OMNICOM GROUP	18,031	84.96	1,531,913.76
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	59.86	2,739,612.62
ROKU INC	9,741	317.00	3,087,897.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.04	601,269.92
SNAP INC - A	81,742	54.70	4,471,287.40
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	170.07	1,656,141.66
THE WALT DISNEY CO	157,918	184.84	29,189,563.12
TWITTER INC	70,140	53.79	3,772,830.60
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	39.39	1,913,802.54
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	119.40	656,341.80
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	118.54	1,591,703.71
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	204.47	1,264,851.42
AMAZON.COM	37,255	3,291.61	122,628,930.55
AUTOZONE INC	1,986	1,507.20	2,993,299.20
BEST BUY COMPANY INC	19,870	122.34	2,430,895.80

BURLINGTON STORES INC	5,808	331.01	1,922,506.08
CARMAX INC	13,891	129.99	1,805,691.09
CARVANA CO	5,700	247.81	1,412,517.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	71.00	488,338.00
DOLLAR GENERAL CORP	21,836	220.20	4,808,287.20
DOLLAR TREE INC	20,151	116.25	2,342,553.75
EBAY	59,339	59.78	3,547,285.42
ETSY INC	11,000	165.51	1,820,610.00
GENUINE PARTS CO	12,119	133.46	1,617,401.74
HOME DEPOT	93,905	339.25	31,857,271.25
LKQ CORP	26,705	49.78	1,329,374.90
LOWES COMPANIES	63,738	208.40	13,282,999.20
MERCADOLIBRE INC	3,877	1,481.26	5,742,845.02
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,541	562.32	3,678,135.12
POOL CORP	3,700	444.01	1,642,837.00
ROSS STORES INC	31,643	132.96	4,207,253.28
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,484	214.71	9,336,449.64
TJX COMPANIES INC	106,288	73.78	7,841,928.64
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	195.46	1,941,308.72
ULTA BEAUTY INC	4,520	322.74	1,458,784.80
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	305.49	1,832,940.00
COSTCO WHOLESALE CORP	38,401	384.32	14,758,272.32
KROGER CO	66,103	37.73	2,494,066.19
SYSCO CORP	41,867	86.26	3,611,447.42
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	54.53	3,452,294.30
WALMART INC	123,412	140.20	17,302,362.40
ALTRIA GROUP INC	161,290	49.95	8,056,435.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	67.02	3,239,679.78
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	76.68	2,010,549.60
BUNGE LIMITED	13,606	91.32	1,242,499.92
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	49.55	786,308.95
COCA-COLA CO	355,696	54.51	19,388,988.96
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	19,221	56.81	1,091,945.01
CONAGRA BRANDS INC	41,157	37.95	1,561,908.15
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,911	240.92	3,592,358.12
GENERAL MILLS INC	53,282	63.05	3,359,430.10
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	168.49	2,111,516.68
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.14	1,280,180.98
JM SMUCKER CO	10,802	136.60	1,475,553.20
KELLOGG CO	24,092	66.95	1,612,959.40
KEURIG DR PEPPER INC	52,280	36.60	1,913,448.00
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	43.48	2,493,056.24

LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	78.97	1,020,608.28
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	89.33	1,883,791.04
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	59.51	1,083,260.53
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	126,700	61.85	7,836,395.00
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	91.25	3,126,042.50
PEPSICO INC	120,371	145.56	17,521,202.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,448	97.41	13,193,989.68
TYSON FOODS INC	25,074	78.82	1,976,332.68
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	87.43	1,840,838.65
CLOROX COMPANY	10,830	183.01	1,981,998.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,441	82.18	5,788,841.38
ESTEE LAUDER CO-CL A	20,159	303.35	6,115,232.65
KIMBERLY-CLARK CORP	30,423	135.50	4,122,316.50
PROCTER & GAMBLE CO	216,277	135.15	29,229,836.55
ABBOTT LABORATORIES	154,411	118.95	18,367,188.45
ABIOMED INC	3,781	296.81	1,122,238.61
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,653	598.34	3,980,756.02
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	120.86	1,558,610.56
ANTHEM INC	22,016	396.57	8,730,885.12
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	86.62	3,813,358.88
BECTON DICKINSON & CO	25,112	239.39	6,011,561.68
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,665	43.13	5,333,671.45
CARDINAL HEALTH	24,692	58.16	1,436,086.72
CENTENE CORP	51,303	70.45	3,614,296.35
CERNER CORP	27,382	76.68	2,099,651.76
CIGNA CORP	31,982	261.18	8,353,058.76
CVS HEALTH CORP	113,622	85.11	9,670,368.42
DANAHER CORP	55,620	258.48	14,376,657.60
DAVITA INC	7,259	126.80	920,441.20
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	68.47	1,382,272.36
DEXCOM INC	8,405	358.74	3,015,209.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	55,706	92.17	5,134,422.02
HCA HEALTHCARE INC	24,127	210.52	5,079,216.04
HENRY SCHEIN INC	14,096	80.61	1,136,278.56
HOLOGIC INC	21,687	65.63	1,423,317.81
HUMANA INC	11,427	465.08	5,314,469.16
IDEXX LABORATORIES INC	7,438	544.26	4,048,205.88
INSULET CORP	5,923	234.19	1,387,107.37
INTUITIVE SURGICAL INC	10,199	857.09	8,741,460.91
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	278.14	2,304,389.90
MASIMO CORP	4,835	224.16	1,083,813.60
MCKESSON CORP	13,893	197.61	2,745,395.73



MEDTRONIC PLC	117,112	126.70	14,838,090.40
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	267.84	1,323,129.60
NOVOCURE LTD	7,933	192.45	1,526,705.85
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	138.95	1,574,998.25
RESMED INC	12,370	195.16	2,414,129.20
STERIS PLC	7,163	211.50	1,514,974.50
STRYKER CORP	29,983	254.78	7,639,068.74
TELADOC HEALTH INC	10,065	151.04	1,520,217.60
TELEFLEX INC	3,934	412.55	1,622,971.70
THE COOPER COS INC	4,556	404.34	1,842,173.04
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,765	417.65	34,566,802.25
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	155.19	1,124,817.12
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	259.96	3,061,029.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	333.68	2,107,856.56
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,277	172.49	3,152,599.73
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	146.36	827,665.80
ABBVIE INC	153,747	115.75	17,796,215.25
AGILENT TECHNOLOGIES	27,421	133.90	3,671,671.90
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,936	170.43	3,227,262.48
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	131.30	1,400,314.50
AMGEN	50,649	254.21	12,875,482.29
AVANTOR INC	47,985	31.22	1,498,091.70
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	608.01	1,301,749.41
BIOGEN INC	13,488	274.04	3,696,251.52
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	77.77	1,335,388.67
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	196,574	64.44	12,667,228.56
CATALENT INC	15,232	107.56	1,638,353.92
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	32.88	1,185,685.68
EXACT SCIENCES CORP	14,756	104.50	1,542,002.00
GILEAD SCIENCES INC	111,105	66.54	7,392,926.70
HORIZON THERAPEUTICS PLC	20,300	87.93	1,784,979.00
ILLUMINA INC	12,945	383.94	4,970,103.30
INCYTE CORP	17,504	82.74	1,448,280.96
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	36.54	468,333.18
IQVIA HOLDINGS INC	16,726	234.39	3,920,407.14
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	174.59	867,886.89
JOHNSON & JOHNSON	229,713	168.50	38,706,640.50
LILLY (ELI) & CO	74,927	195.42	14,642,234.34
MERCK & CO	220,359	78.41	17,278,349.19
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,278.56	2,622,326.56
MODERNA INC	25,034	163.15	4,084,297.10
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	91.04	771,472.96

PERKINELMER INC	10,645	140.97	1,500,625.65
PFIZER	484,175	39.58	19,163,646.50
PPD INC	11,027	46.10	508,344.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,176	496.75	4,558,178.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	40.97	636,427.98
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	74.57	532,951.79
SEAGEN INC	11,471	139.49	1,600,089.79
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	10.40	836,170.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,513	468.45	16,167,614.85
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	215.01	4,828,694.58
VIATRIS INC	114,289	14.08	1,609,189.12
WATERS CORP	5,228	314.65	1,644,990.20
ZOETIS INC	42,095	171.55	7,221,397.25
BANK OF AMERICA CORP	678,967	42.18	28,638,828.06
CITIGROUP	181,157	75.08	13,601,267.56
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	49.44	1,781,867.04
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	42.35	2,598,638.35
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	187.87	2,981,872.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,482	15.80	1,350,615.60
JPMORGAN CHASE & CO	266,016	161.24	42,892,419.84
KEY CORP	83,212	23.07	1,919,700.84
M & T BANK CORP	11,721	163.15	1,912,281.15
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,707	198.91	7,301,389.37
REGIONS FINL CORP	81,824	22.89	1,872,951.36
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	587.98	2,582,996.14
TRUIST FINANCIAL CORP	119,435	61.57	7,353,612.95
US BANCORP	117,465	61.37	7,208,827.05
WELLS FARGO & CO	341,799	46.54	15,907,325.46
ALLY FINANCIAL INC	31,445	54.10	1,701,174.50
AMERICAN EXPRESS	59,420	158.98	9,446,591.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	265.65	2,705,645.25
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	58.22	882,207.66
BANK NEW YORK CO	68,501	51.82	3,549,721.82
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	119,592	290.93	34,792,900.56
BLACKROCK INC	13,255	873.83	11,582,616.65
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,302	157.71	6,356,028.42
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	44.98	566,523.10
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	108.10	959,387.50
CME GROUP INC	31,096	202.92	6,310,000.32
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	119.46	3,309,519.84
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	35.01	1,148,853.15
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	337.05	1,224,502.65

FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	34.10	888,987.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,388	370.89	10,528,825.32
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,552	114.81	5,574,255.12
INVESCO LTD	35,765	28.38	1,015,010.70
KKR & CO INC	43,643	58.72	2,562,716.96
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	437.17	1,402,004.19
MOODY'S CORP	14,787	334.50	4,946,251.50
MORGAN STANLEY	122,211	87.70	10,717,904.70
MSCI INC	7,235	482.31	3,489,512.85
NASDAQ INC	9,657	164.56	1,589,155.92
NORTHERN TRUST CORP	17,625	119.28	2,102,310.00
PRICE T ROWE GROUP INC	20,087	189.23	3,801,063.01
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	136.64	1,410,671.36
S&P GLOBAL INC	21,321	390.71	8,330,327.91
SCHWAB (CHARLES) CORP	132,850	71.75	9,531,987.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	63.27	775,753.47
STATE STREET CORP	31,754	87.23	2,769,901.42
SYNCHRONY FINANCIAL	46,378	45.90	2,128,750.20
THE BLACKSTONE GROUP INC	58,748	90.04	5,289,669.92
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	82.53	747,804.33
VOYA FINANCIAL INC	12,505	70.00	875,350.00
AFLAC	58,037	56.11	3,256,456.07
ALLEGHANY CORP	1,276	729.80	931,224.80
ALLSTATE CORP	26,425	132.26	3,494,970.50
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	128.70	813,255.30
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	51.19	3,850,870.13
AON PLC	20,358	258.52	5,262,950.16
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	40.79	1,388,124.49
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	151.16	2,472,826.44
ASSURANT INC	5,819	160.71	935,171.49
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	63.05	643,551.35
BROWN & BROWN INC	22,945	53.69	1,231,917.05
CHUBB LTD	39,962	176.39	7,048,897.18
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	120.35	1,539,396.85
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	210.33	455,574.78
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	273.10	1,072,190.60
FNF GROUP	24,961	46.19	1,152,948.59
GLOBE LIFE INC	8,106	105.99	859,154.94
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	66.65	2,024,227.15
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	69.30	1,134,025.20
LOEWS CORP	23,338	58.44	1,363,872.72
MARKEL CORP	1,156	1,220.37	1,410,747.72

MARSH & MCLENNAN COS	44,622	137.97	6,156,497.34
METLIFE INC	68,534	67.16	4,602,743.44
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	66.66	1,537,979.52
PROGRESSIVE CORP	50,582	105.18	5,320,214.76
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,851	105.95	3,692,463.45
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	126.26	839,881.52
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	164.88	801,976.32
TRAVELERS COS INC/THE	22,437	160.81	3,608,093.97
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	270.07	2,976,441.47
WR BERKLEY CORP	11,715	81.45	954,186.75
CBRE GROUP INC-A	30,111	86.90	2,616,645.90
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.86	479,682.00
WEYERHAEUSER CO	63,665	40.00	2,546,600.00
ACCENTURE PLC-CL A	55,165	291.53	16,082,252.45
ADOBE INC	41,807	488.73	20,432,335.11
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	110.81	1,515,105.13
ANSYS INC	7,474	332.38	2,484,208.12
AUTODESK INC	18,964	285.76	5,419,152.64
AUTOMATIC DATA PROCESS	37,957	194.89	7,397,439.73
AVALARA INC	7,698	125.63	967,099.74
BLACK KNIGHT INC	14,413	75.15	1,083,136.95
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	164.20	1,599,636.40
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,740	129.05	3,192,697.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	87.40	1,074,670.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	119.87	1,256,956.82
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	121.03	1,264,037.32
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	71.62	1,272,114.44
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	74.81	3,442,013.70
COUPA SOFTWARE INC	6,059	237.84	1,441,072.56
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,694	189.18	2,968,990.92
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	120.23	372,713.00
DATADOG INC - CLASS A	15,807	77.29	1,221,723.03
DOCUSIGN INC	15,540	195.28	3,034,651.20
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	24.70	712,471.50
DYNATRACE INC	17,890	46.78	836,894.20
EPAM SYSTEMS INC	4,753	460.20	2,187,330.60
FAIR ISAAC CORP	2,615	496.17	1,297,484.55
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	53,834	151.59	8,160,696.06
FISERV INC	49,334	117.65	5,804,145.10
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,154	285.66	2,043,611.64
FORTINET INC	12,295	211.77	2,603,712.15
GARTNER INC	7,500	234.00	1,755,000.00

GLOBAL PAYMENTS INC	26,387	201.41	5,314,605.67
GODADDY INC - CLASS A	15,914	81.06	1,289,988.84
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	98.70	782,000.10
HUBSPOT INC	4,000	509.66	2,038,640.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,449	145.46	11,265,731.54
INTUIT INC	22,819	401.04	9,151,331.76
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	156.13	1,149,116.80
MASTERCARD INC-CLASS A	77,591	375.40	29,127,661.40
MICROSOFT CORP	627,464	252.46	158,409,561.44
MONGODB INC	4,623	260.32	1,203,459.36
NORTONLIFELOCK INC	50,376	21.09	1,062,681.72
OKTA INC	10,230	237.27	2,427,272.10
ORACLE CORP	170,258	80.40	13,688,743.20
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	342.34	2,845,187.74
PAYCHEX INC	27,703	101.01	2,798,280.03
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	327.58	1,387,301.30
PAYPAL HOLDINGS INC	97,048	253.36	24,588,081.28
PTC INC	9,984	131.16	1,309,501.44
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	257.04	1,643,256.72
SALESFORCE.COM INC	79,266	216.50	17,161,089.00
SERVICENOW INC	16,939	483.51	8,190,175.89
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	41,035	41.23	1,691,873.05
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	206.04	403,838.40
SPLUNK INC	14,752	117.82	1,738,080.64
SQUARE INC - A	33,292	233.35	7,768,688.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	73.35	1,418,222.25
SYNOPSYS INC	13,492	241.84	3,262,905.28
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,578	661.43	2,366,596.54
TWILIO INC - A	12,576	307.15	3,862,718.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	399.87	1,484,717.31
VERISIGN INC	8,760	222.89	1,952,516.40
VISA INC-CLASS A SHARES	147,639	232.12	34,269,964.68
VMWARE INC-CLASS A	7,867	163.41	1,285,546.47
WESTERN UNION CO	38,757	25.11	973,188.27
WIX.COM LTD	5,010	288.79	1,446,837.90
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	236.71	3,670,188.55
ZENDESK INC	10,500	135.67	1,424,535.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,843	295.24	4,972,727.32
ZSCALER INC	6,234	169.32	1,055,540.88
AMPHENOL CORPORATION	51,451	68.11	3,504,327.61
APPLE INC	1,485,374	130.21	193,410,548.54
ARISTA NETWORKS INC	5,179	328.52	1,701,405.08

ARROW ELECTRONICS INC	6,100	117.50	716,750.00
CDW CORP/DE	11,982	174.87	2,095,292.34
CISCO SYSTEMS	368,180	53.43	19,671,857.40
COGNEX CORP	16,230	77.58	1,259,123.40
CORNING	64,989	46.00	2,989,494.00
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	101.06	2,175,821.80
F5 NETWORKS INC	5,350	184.28	985,898.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	16.48	1,798,775.52
HP INC	118,260	35.57	4,206,508.20
IPG PHOTONICS CORP	3,207	197.30	632,741.10
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.20	851,468.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	143.41	2,295,133.64
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,918	199.07	2,969,726.26
NETAPP INC	20,586	79.52	1,636,998.72
SEAGATE TECHNOLOGY	21,474	91.56	1,966,159.44
TE CONNECTIVITY LTD	29,387	138.00	4,055,406.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	79.33	1,679,892.08
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	71.65	1,847,853.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	488.58	2,253,330.96
AT&T INC	620,884	32.16	19,967,629.44
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	27.72	430,103.52
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	27.80	936,304.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	13.99	1,204,972.69
T-MOBILE US INC	48,374	139.12	6,729,790.88
VERIZON COMMUNICATIONS	360,661	58.72	21,178,013.92
AES CORP	61,761	25.79	1,592,816.19
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	56.74	1,178,943.72
AMEREN CORPORATION	20,898	84.98	1,775,912.04
AMERICAN ELECTRIC POWER	44,128	87.19	3,847,520.32
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	152.77	2,362,435.28
ATMOS ENERGY CORP	11,419	103.00	1,176,157.00
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	24.49	1,179,487.38
CMS ENERGY CORP	26,742	63.99	1,711,220.58
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	78.09	2,244,697.05
DOMINION ENERGY INC	71,961	78.45	5,645,340.45
DTE ENERGY COMPANY	16,240	141.69	2,301,045.60
DUKE ENERGY CORP	63,724	100.86	6,427,202.64
EDISON INTL	32,117	58.58	1,881,413.86
ENTERGY CORP	16,926	108.31	1,833,255.06
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	46.64	971,697.76
EVERGY INC	21,330	63.82	1,361,280.60
EVERSOURCE ENERGY	29,303	84.07	2,463,503.21

EXELON CORP	86,723	44.68	3,874,783.64	
FIRSTENERGY CORP	50,559	37.52	1,896,973.68	
NEXTERA ENERGY INC	170,459	74.53	12,704,309.27	
NISOURCE INC	35,781	25.98	929,590.38	
NRG ENERGY INC	23,078	34.76	802,191.28	
OGE ENERGY CORP	19,225	33.93	652,304.25	
PG&E CORP	135,327	10.94	1,480,477.38	
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	86.12	927,684.64	
PPL CORPORATION	69,904	29.25	2,044,692.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	63.15	2,731,742.70	
SEMPRA ENERGY	25,041	137.82	3,451,150.62	
SOUTHERN CO	91,389	66.26	6,055,435.14	
UGI CORP	18,019	45.62	822,026.78	
VISTRA CORP	37,797	16.05	606,641.85	
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	97.64	2,618,802.44	
XCEL ENERGY INC	46,423	71.32	3,310,888.36	
ADVANCED MICRO DEVICES	104,401	78.81	8,227,842.81	
ANALOG DEVICES	31,938	157.26	5,022,569.88	
APPLIED MATERIALS	79,412	132.95	10,557,825.40	
BROADCOM INC	35,233	452.58	15,945,751.14	
ENPHASE ENERGY INC	11,000	122.96	1,352,560.00	
INTEL CORP	357,270	57.67	20,603,760.90	
KLA CORP	13,649	319.70	4,363,585.30	
LAM RESEARCH CORP	12,499	630.54	7,881,119.46	
MARVELL TECHNOLOGY INC	70,440	45.96	3,237,422.40	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,641	96.58	2,186,667.78	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	149.75	3,354,999.00	
MICRON TECHNOLOGY	96,673	85.98	8,311,944.54	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,953	342.79	1,355,048.87	
NVIDIA CORP	53,994	592.49	31,990,905.06	
NXP SEMICONDUCTORS NV	24,180	197.92	4,785,705.60	
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	38.63	1,390,525.48	
QORVO INC	9,678	184.18	1,782,494.04	
QUALCOMM	98,431	137.85	13,568,713.35	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	175.12	2,514,548.08	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	220.40	1,013,840.00	
TERADYNE INC	14,398	128.17	1,845,391.66	
TEXAS INSTRUMENTS	79,929	187.76	15,007,469.04	
XILINX INC	20,982	124.43	2,610,790.26	
アメリカドル 小計	27,462,914		3,239,572,201.28 (352,368,268,333)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	24.44	656,947.20

CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	41.70	4,286,176.20
CENOVUS ENERGY INC	96,666	9.57	925,093.62
ENBRIDGE	173,165	48.09	8,327,504.85
IMPERIAL OIL	24,763	38.09	943,222.67
INTER PIPELINE LTD	35,455	17.94	636,062.70
KEYERA CORP	18,607	28.89	537,556.23
PARKLAND CORP	14,075	39.82	560,466.50
PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	38.06	1,738,047.96
SUNCOR ENERGY	132,181	28.66	3,788,307.46
TC ENERGY CORP	82,366	61.94	5,101,750.04
AGNICO EAGLE MINES	20,293	83.93	1,703,191.49
B2GOLD CORP	90,243	6.28	566,726.04
BARRICK GOLD CORP	160,886	29.02	4,668,911.72
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	71.41	938,255.99
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	33.70	1,853,500.00
FRANCO-NEVADA CORP	16,953	179.58	3,044,419.74
KINROSS GOLD CORP	125,340	9.39	1,176,942.60
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	49.60	1,162,028.80
LUNDIN MINING CORP	62,243	14.84	923,686.12
NUTRIEN LTD	48,966	74.54	3,649,925.64
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	42.50	782,467.50
SSR MINING INC	21,000	21.07	442,470.00
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	31.09	1,420,097.93
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	104.96	818,688.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	53.16	2,101,308.48
YAMANA GOLD INC	81,672	6.16	503,099.52
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	18.69	368,641.56
CAE INC	25,999	38.07	989,781.93
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	105.30	811,336.50
WSP GLOBAL INC	10,656	127.83	1,362,156.48
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	17,694	39.65	701,567.10
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	81.42	834,147.90
THOMSON REUTERS CORP	16,323	118.04	1,926,766.92
AIR CANADA	13,805	24.92	344,020.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	136.42	8,303,885.40
CP RAILWAY LIMITED	12,047	483.02	5,818,941.94
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	119.52	2,782,664.64
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,923	44.47	930,445.81
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	84.38	1,946,899.74
QUEBECOR INC -CL B	15,200	34.12	518,624.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	35.92	1,272,358.24
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	199.44	1,078,770.96



DOLLARAMA INC	26,700	54.10	1,444,470.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	41.86	3,104,044.58
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.91	608,747.23
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	70.61	911,786.93
METRO INC	18,840	57.52	1,083,676.80
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	111.73	769,037.59
SAPUTO INC	24,489	39.70	972,213.30
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	34.08	947,424.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	30.68	643,942.52
BANK MONTREAL	57,280	117.84	6,749,875.20
BANK NOVA SCOTIA	107,218	79.43	8,516,325.74
CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	130.70	5,069,853.00
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	90.88	2,480,024.32
ROYAL BANK OF CANADA	122,804	120.26	14,768,409.04
TORONTO-DOMINION BANK	156,322	86.10	13,459,324.20
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	114,488	56.33	6,449,109.04
IGM FINANCIAL INC	7,685	44.79	344,211.15
ONEX CORP	6,603	84.91	560,660.73
TMX GROUP LTD	4,685	134.91	632,053.35
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	575.50	1,227,541.50
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.26	862,552.88
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	70.83	715,312.17
INTACT FINANCIAL CORP	13,043	164.94	2,151,312.42
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	25.85	4,214,997.60
POWER CORP OF CANADA	51,551	36.69	1,891,406.19
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	66.20	3,356,472.40
FIRSTSERVICE CORP	3,690	198.36	731,948.40
BLACKBERRY LIMITED	39,400	10.28	405,032.00
CGI INC - CL A	18,428	110.56	2,037,399.68
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	1,802.86	2,994,550.46
OPEN TEXT CORP	24,643	58.17	1,433,483.31
SHOPIFY INC - CLASS A	9,494	1,345.36	12,772,847.84
BCE INC	15,355	59.11	907,634.05
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	33,271	61.64	2,050,824.44
TELUS CORP	32,908	26.29	865,151.32
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.29	999,569.22
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	23.99	585,236.05
ATCO LTD -CLASS I	5,241	42.47	222,585.27
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	48.44	547,129.80
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.94	360,720.56
EMERA INC	23,704	56.12	1,330,268.48
FORTIS INC	42,633	54.97	2,343,536.01

	HYDRO ONE LTD	32,299	29.81	962,833.19
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.24	700,590.96
	カナダドル 小計	3,485,535		199,433,989.64 (17,895,211,890)
ユーロ	ENI	218,529	10.32	2,255,219.28
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	10.14	499,073.13
	NESTE OIL OYJ	37,233	51.72	1,925,690.76
	OMV AG	14,984	44.16	661,693.44
	REPSOL SA	127,332	10.80	1,375,440.26
	TENARIS SA	40,648	9.54	387,863.21
	TOTAL SE	217,070	39.05	8,476,583.50
	VOPAK	6,360	37.89	240,980.40
	AIR LIQUIDE	40,492	143.28	5,801,693.76
	AKZO NOBEL	15,301	103.45	1,582,888.45
	ARCELORMITTAL	66,229	26.99	1,787,520.71
	ARKEMA	5,949	108.20	643,681.80
	BASF SE	78,752	70.38	5,542,565.76
	COVESTRO AG	17,254	58.02	1,001,077.08
	CRH PLC	64,773	41.94	2,716,579.62
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	30.04	593,410.16
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	43.92	253,067.04
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	74.60	972,858.60
	KONINKLIJKE DSM NV	14,947	152.25	2,275,680.75
	LANXESS	7,293	64.44	469,960.92
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	23,039	44.02	1,014,176.78
	SOLVAY SA	6,906	112.45	776,579.70
	STORA ENSO OYJ R	54,792	16.03	878,315.76
	SYMRISE AG	11,456	107.20	1,228,083.20
	UMICORE	17,605	51.48	906,305.40
	UPM KYMMENE OYJ	45,603	33.07	1,508,091.21
	VOESTALPINE AG	7,152	38.10	272,491.20
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,765	28.37	674,213.05
	AIRBUS SE	50,151	98.37	4,933,353.87
	ALSTOM	24,388	46.66	1,137,944.08
	BOUYGUES ORD	21,446	35.07	752,111.22
	BRENTAG SE	12,514	76.20	953,566.80
	CNH INDUSTRIAL NV	93,026	13.72	1,276,781.85
	DASSAULT AVIATION SA	213	966.50	205,864.50
	EIFFAGE	7,964	94.34	751,323.76
	FERROVIAL SA	47,178	24.97	1,178,034.66
	GEA GROUP AG	13,382	36.43	487,506.26
	HOCHTIEF AG	2,222	75.60	167,983.20

KINGSPAN GROUP PLC	14,482	76.46	1,107,293.72
KION GROUP AG	5,887	84.10	495,096.70
KNORR-BREMSE AG	6,822	104.25	711,193.50
KONE OYJ-B	29,051	68.10	1,978,373.10
LEGRAND SA	21,768	85.76	1,866,823.68
MTU AERO ENGINES AG	4,753	212.40	1,009,537.20
PRYSMIAN SPA	21,155	26.45	559,549.75
RATIONAL AG	483	774.40	374,035.20
SAFRAN SA	28,410	125.20	3,556,932.00
SAINT-GOBAIN	43,973	56.38	2,479,197.74
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,768	134.96	6,446,769.28
SIEMENS	66,090	144.28	9,535,465.20
SIEMENS ENERGY AG	36,181	26.23	949,027.63
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	27.70	621,449.50
THALES SA	9,665	86.04	831,576.60
VINCI S.A.	44,183	95.69	4,227,871.27
WARTSILA OYJ	41,917	10.71	448,931.07
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.13	630,084.49
RANDSTAD NV	11,218	61.80	693,272.40
TELEPERFORMANCE	4,734	322.70	1,527,661.80
WOLTERS KLUWER	22,949	79.00	1,812,971.00
ADP	2,382	115.55	275,240.10
AENA SME SA	6,542	150.30	983,262.60
ATLANTIA SPA	46,597	16.29	759,065.13
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	11.23	261,530.73
DEUTSCHE POST AG-REG	88,114	51.00	4,493,814.00
GETLINK	44,101	13.69	603,963.19
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	83.64	2,399,129.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	69.25	345,626.75
CONTINENTAL AG	9,928	114.62	1,137,947.36
DAIMLER AG	73,367	73.41	5,385,871.47
FAURECIA	10,948	44.80	490,470.40
FERRARI NV	10,170	165.50	1,683,135.00
MICHELIN	13,839	123.70	1,711,884.30
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	87.50	1,227,450.00
RENAULT SA	17,362	34.15	592,912.30
STELLANTIS NV	183,437	14.94	2,740,915.65
VALEO SA	21,538	27.74	597,464.12
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,304	210.75	3,436,068.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	261.40	649,840.40
ADIDAS AG	16,242	280.60	4,557,505.20
ESSILORLUXOTTICA	25,177	140.70	3,542,403.90

HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,073.00	2,930,363.00
KERING	6,743	695.10	4,687,059.30
LVMH	24,043	631.40	15,180,750.20
MONCLER SPA	18,219	51.26	933,905.94
PUMA SE	9,220	89.82	828,140.40
SEB SA	2,282	154.40	352,340.80
ACCOR	17,931	33.47	600,150.57
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	168.65	2,448,460.70
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	43.02	348,806.16
SODEXO	8,135	86.24	701,562.40
BOLLORE	83,646	4.26	356,331.96
PUBLICIS GROUPE	17,077	55.84	953,579.68
SCOUT24 AG	9,470	70.38	666,498.60
SES	31,369	6.71	210,611.46
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	62.82	444,200.22
VIVENDI	71,967	29.82	2,146,055.94
DELIVERY HERO SE	12,154	125.25	1,522,288.50
HELLOFRESH SE	13,805	65.48	903,951.40
INDITEX	95,060	30.78	2,925,946.80
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	81.86	930,911.92
PROSUS	43,038	89.74	3,862,230.12
ZALANDO SE	13,985	86.68	1,212,219.80
CARREFOUR	59,235	16.52	978,562.20
COLRUYT SA	5,424	49.75	269,844.00
JERONIMO MARTINS	24,901	15.49	385,716.49
KESKO OYJ-B SHS	25,583	26.00	665,158.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	95,504	23.05	2,201,844.72
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	61.28	3,908,928.64
DANONE (GROUPE)	54,643	59.16	3,232,679.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.28	504,511.56
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	84.75	906,909.75
HEINEKEN NV	22,407	99.44	2,228,152.08
JDE PEET'S BV	7,000	32.50	227,500.00
KERRY GROUP PLC-A	14,641	109.50	1,603,189.50
PERNOD-RICARD	18,224	174.15	3,173,709.60
REMY COINTREAU	2,382	166.00	395,412.00
BEIERSDORF AG	9,190	96.06	882,791.40
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	83.00	845,770.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	95.92	1,384,988.88
LOREAL	21,631	349.90	7,568,686.90
AMPLIFON SPA	11,650	35.83	417,419.50
BIOMERIEUX	4,175	96.94	404,724.50

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	145.05	497,521.50
DIASORIN SPA	2,070	140.80	291,456.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	64.64	1,291,830.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	41.66	1,403,652.18
KONINKLIJKE PHILIPS	81,047	48.07	3,895,929.29
ORPEA	4,336	106.50	461,784.00
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	448.10	1,454,532.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	48.79	1,197,599.34
ARGENX SE	4,178	219.10	915,399.80
BAYER	83,832	54.13	4,537,826.16
EUROFINS SCIENTIFIC	12,420	82.63	1,026,264.60
GALAPAGOS NV	4,368	63.14	275,795.52
GRIFOLS SA	27,685	23.32	645,614.20
IPSEN	3,532	80.46	284,184.72
MERCK KGAA	10,555	142.75	1,506,726.25
ORION OYJ-CLASS B	9,854	36.52	359,868.08
QIAGEN N.V.	21,801	39.77	867,025.77
RECORDATI SPA	9,859	45.02	443,852.18
SANOFI	97,536	85.44	8,333,475.84
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	374.50	905,915.50
UCB (GROUPE)	11,875	76.66	910,337.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.94	436,895.42
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	4.82	2,781,725.85
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.21	4,728,764.59
BNP PARIBAS	99,381	54.78	5,444,091.18
CAIXABANK	328,697	2.69	884,852.32
COMMERZBANK AG	94,388	5.61	529,894.23
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	12.87	1,383,048.81
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	31.20	859,872.00
FINECOBANK SPA	53,120	14.14	751,382.40
ING GROEP NV-CVA	343,429	10.81	3,713,841.20
INTESA SANPAOLO	1,441,455	2.36	3,404,716.71
KBC GROEP NV	21,052	66.32	1,396,168.64
MEDIOBANCA	53,990	9.52	514,308.74
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	18.70	233,563.00
SOCIETE GENERALE	67,846	24.91	1,690,043.86
UNICREDIT SPA	169,030	9.35	1,580,430.50
AMUNDI SA	6,226	77.60	483,137.60
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,094	11.48	1,850,003.49
DEUTSCHE BOERSE	16,510	141.10	2,329,561.00
EURAZEO SA	3,357	70.15	235,493.55
EXOR NV	10,345	69.04	714,218.80

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,615	91.14	967,451.10
NATIXIS	89,751	4.06	364,837.81
SOFINA	1,238	317.60	393,188.80
WENDEL	2,023	114.70	232,038.10
AEGON	166,267	3.95	657,752.25
AGEAS	16,065	51.44	826,383.60
ALLIANZ SE-REG	35,536	214.35	7,617,141.60
ASSICURAZIONI GENERALI	87,567	17.37	1,521,038.79
AXA SA	171,687	22.73	3,902,445.51
CNP ASSURANCES	16,287	15.00	244,305.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	152.75	884,269.75
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,376	248.70	3,077,911.20
NN GROUP NV	27,631	42.65	1,178,462.15
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.00	506,385.00
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	40.49	1,744,106.75
SCOR SE	13,354	28.16	376,048.64
AROUNDTOWN SA	94,068	6.62	622,730.16
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	43.18	1,213,012.56
LEG IMMOBILIEN SE	6,992	115.50	807,576.00
VONOVIA SE	45,080	51.82	2,336,045.60
ADYEN NV	1,604	1,913.00	3,068,452.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	59.02	2,307,327.88
ATOS SE	9,750	56.24	548,340.00
BECHTLE AG	2,553	163.20	416,649.60
CAPGEMINI SA	13,914	155.10	2,158,061.40
DASSAULT SYSTEMES SA	11,425	188.55	2,154,183.75
EDENRED	22,756	46.98	1,069,076.88
NEMETSCHKE SE	5,455	57.96	316,171.80
NEXI SPA	41,348	15.62	645,855.76
SAP SE	90,249	117.36	10,591,622.64
TEAMVIEWER AG	14,174	34.52	489,286.48
WORLDLINE SA	20,332	78.38	1,593,622.16
NOKIA OYJ	450,608	4.26	1,922,519.03
CELLNEX TELECOM SA	41,435	47.67	1,975,206.45
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	16.53	4,712,752.15
ELISA A	13,387	47.80	639,898.60
ILIAD SA	1,253	147.90	185,318.70
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.52	289,413.00
KPN (KON.)	282,927	2.80	793,327.30
ORANGE	171,535	10.48	1,798,029.87
PROXIMUS	13,141	17.42	228,981.92
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.41	356,622.50

	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.46	216,408.66
	TELEFONICA	434,645	3.91	1,700,331.24
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.45	242,740.18
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	35.43	337,045.59
	E.ON SE	185,377	10.57	1,959,434.89
	ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	11.80	723,564.20
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	89.75	262,518.75
	ENAGAS	25,299	18.79	475,368.21
	ENDESA	25,972	22.35	580,474.20
	ENEL	692,930	8.26	5,729,145.24
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	260,788	4.62	1,204,840.56
	ENGIE	158,224	12.61	1,995,521.08
	FORTUM OYJ	41,901	23.00	963,723.00
	IBERDROLA SA	542,124	11.52	6,245,268.48
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	21.48	500,698.80
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.75	624,402.16
	RWE STAMM	55,390	32.16	1,781,342.40
	SNAM SPA	189,497	4.78	907,501.13
	SUEZ	32,549	19.85	646,097.65
	TERNA SPA	130,230	6.18	805,342.32
	UNIPER SE	20,192	30.92	624,336.64
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	26.31	1,142,564.37
	VERBUND AG	6,430	69.40	446,242.00
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	262.30	1,106,119.10
	ASML HOLDING NV	36,915	543.90	20,078,068.50
	INFINEON TECHNOLOGIES	116,532	32.50	3,787,290.00
	STMICROELECTRONICS	55,076	30.94	1,704,051.44
	ユーロ 小計	16,413,585		407,614,630.14 (53,935,567,860)
イギリスポンド	BP PLC	1,795,634	3.13	5,630,210.40
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	363,509	14.30	5,198,905.71
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	327,858	13.68	4,486,408.87
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	33.81	3,684,008.99
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	18.74	671,941.44
	BHP GROUP PLC	186,498	23.37	4,359,390.75
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,112	67.32	882,699.84
	EVRAZ PLC	43,000	6.89	296,356.00
	FRESNILLO PLC	17,490	9.11	159,333.90
	GLENCORE PLC	875,677	3.22	2,826,247.51
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	32.73	551,435.04
	MONDI PLC	36,710	19.64	720,984.40
	RIO TINTO PLC REG	96,096	65.35	6,279,873.60

ASHTREAD GROUP PLC	37,034	48.10	1,781,335.40
BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.08	1,321,328.32
BUNZL PLC	24,880	23.48	584,182.40
DCC PLC	9,127	61.78	563,866.06
FERGUSON PLC	20,559	94.32	1,939,124.88
MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.67	765,530.13
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786,119	1.06	839,103.42
SMITHS GROUP PLC	37,146	16.19	601,579.47
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	120.55	664,712.70
EXPERIAN PLC	82,684	28.09	2,322,593.56
INTERTEK GROUP PLC	15,404	61.90	953,507.60
RELX PLC	172,179	19.13	3,293,784.27
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	4.90	688,632.96
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.80	753,037.01
BURBERRY GROUP PLC	29,776	21.91	652,392.16
PERSIMMON PLC	25,686	31.99	821,695.14
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.80	643,350.70
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	47.50	561,877.50
COMPASS GROUP PLC	155,632	16.25	2,529,020.00
ENTAIN PLC	49,630	16.59	823,609.85
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	51.16	820,657.56
WHITBREAD PLC	17,434	32.92	573,927.28
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.75	559,595.75
INFORMA PLC	141,175	5.75	812,038.60
PEARSON	66,305	8.46	561,072.91
WPP PLC	113,065	9.89	1,119,117.37
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	9.21	381,137.11
KINGFISHER PLC	198,587	3.63	721,863.74
NEXT PLC	11,468	82.64	947,715.52
OCADO GROUP PLC	44,612	19.75	881,087.00
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.79	375,290.34
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.51	372,617.52
TESCO PLC	666,000	2.27	1,515,150.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	23.50	787,015.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	196,527	28.38	5,578,418.89
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.46	457,261.60
DIAGEO	200,801	32.84	6,594,304.84
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	16.03	1,298,205.58
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	63.55	3,846,935.70
UNILEVER PLC	227,095	42.73	9,703,769.35
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	15.83	1,085,858.85
ASTRAZENECA	113,182	77.35	8,754,627.70



	GLAXOSMITHKLINE	430,042	13.55	5,829,649.35	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	23.50	386,669.00	
	BARCLAYS	1,516,252	1.81	2,752,603.88	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,754,485	4.51	7,916,236.32	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,190,268	0.46	2,881,879.26	
	NATWEST GROUP PLC	369,149	2.00	738,298.00	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.16	1,097,496.03	
	3I GROUP PLC	88,121	12.48	1,099,750.08	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	17.48	578,386.31	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	71.70	1,978,346.40	
	M&G PLC	229,107	2.17	498,307.72	
	SCHRODERS PLC	11,794	36.11	425,881.34	
	ST JAMES' S PLACE PLC	50,535	13.85	699,909.75	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	210,980	2.78	588,212.24	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	29.78	484,073.90	
	AVIVA PIC	332,730	4.09	1,362,862.08	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.92	332,730.09	
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.84	1,566,906.94	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	7.35	374,959.35	
	PRUDENTIAL	232,591	15.79	3,672,611.89	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	97,285	6.84	665,429.40	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	33.48	365,501.16	
	SAGE GROUP PLC	95,210	6.35	605,345.18	
	HALMA PLC	31,069	25.97	806,861.93	
	BT GROUP PLC	817,227	1.69	1,386,016.99	
	VODAFONE GROUP PLC	2,359,596	1.41	3,346,379.04	
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.31	2,858,082.92	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	25.07	563,272.76	
	SSE PLC	92,294	14.87	1,372,411.78	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	9.90	664,804.80	
	イギリスポンド 小計	25,797,041		154,499,604.08 (23,584,364,562)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.55	340,130.90	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	852.50	693,082.50	
	GIVAUDAN-REG	795	3,884.00	3,087,780.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	45,387	55.48	2,518,070.76	
	SIKA AG-BR	12,505	282.30	3,530,161.50	
	ABB LTD	164,413	30.61	5,032,681.93	
	GEBERIT AG-REG	2,964	632.00	1,873,248.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	255.40	539,404.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	261.60	985,708.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	61.14	890,993.22	

	SGS SA	506	2,751.00	1,392,006.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	278.40	1,410,652.80
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	45,940	95.66	4,394,620.40
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	293.10	727,767.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	57.45	226,238.10
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,050.00	574,000.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	91,000.00	910,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	8,470.00	694,540.00
	NESTLE SA - REGISTERED	250,200	109.12	27,301,824.00
	ALCON INC	42,603	64.24	2,736,816.72
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	273.00	1,402,674.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,377.00	1,175,958.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,536	577.40	3,773,886.40
	NOVARTIS	191,990	79.49	15,261,285.10
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	321.80	900,718.20
	ROCHE HOLDING GENUSS	60,854	303.20	18,450,932.80
	VIFOR PHARMA AG	4,486	125.80	564,338.80
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	88.90	253,720.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.25	1,974,276.12
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	57.80	1,224,030.60
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,498	1,340.50	2,008,069.00
	UBS GROUP AG	327,092	14.13	4,621,809.96
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	151.10	659,098.20
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	459.80	1,309,970.20
	SWISS RE LTD	24,674	87.74	2,164,896.76
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	385.70	4,913,818.00
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	90.00	671,220.00
	TEMENOS AG - REG	6,511	130.50	849,685.50
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	103.80	1,524,406.80
	SWISSCOM	2,441	494.80	1,207,806.80
	スイスフラン 小計	1,530,179		124,772,329.57 (15,061,267,902)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	275.10	4,737,772.20
	BOLIDEN AB	23,903	353.30	8,444,929.90
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	150.20	8,556,443.40
	ALFA LAVAL AB	27,268	301.10	8,210,394.80
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	255.70	22,130,323.60
	ATLAS COPCO A	58,390	522.60	30,514,614.00
	ATLAS COPCO B	31,902	450.50	14,371,851.00
	EPIROC AB-A	58,039	193.50	11,230,546.50
	EPIROC AB-B	37,972	173.30	6,580,547.60
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	261.40	3,660,122.80

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,906	325.00	8,744,450.00	
	SANDVIK AB	96,684	228.60	22,101,962.40	
	SKANSKA B	32,007	236.10	7,556,852.70	
	SKF AB-B	35,405	227.50	8,054,637.50	
	VOLVO B	123,279	217.40	26,800,854.60	
	SECURITAS B	29,533	141.85	4,189,256.05	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	237.50	5,051,387.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	121.35	4,697,701.20	
	EVOLUTION GAMING GROUP	13,192	1,608.60	21,220,651.20	
	HENNES & MAURITZ B	65,999	211.75	13,975,288.25	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	400.70	3,803,845.10	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	74.10	9,430,707.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	287.70	14,233,669.80	
	NORDEA BANK ABP	280,957	85.94	24,145,444.58	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	109.35	15,141,694.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.42	12,909,357.72	
	SWEDBANK AB-A	72,526	150.20	10,893,405.20	
	EQT AB	20,102	276.20	5,552,172.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	328.80	3,325,812.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	309.00	5,188,728.00	
	INVESTOR AB-B SHS	39,416	726.80	28,647,548.80	
	KINNEVIK AB - B	18,792	421.05	7,912,371.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	487.20	3,546,816.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	499.00	4,715,550.00	
	ERICSSON (LM) B	253,862	116.38	29,544,459.56	
	HEXAGON AB-B SHS	24,244	816.60	19,797,650.40	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	111.95	5,598,843.40	
	TELIA CO AB	230,643	36.29	8,370,034.47	
	スウェーデンクローナ 小計	2,385,263		453,588,697.73 (5,942,011,940)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	76,370	178.20	13,609,134.00	
	NORSK HYDRO	126,800	55.00	6,974,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	427.50	7,014,420.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	144.75	2,767,185.75	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	367.20	3,405,412.80	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	414.50	2,935,489.00	
	MOWI ASA	40,968	218.70	8,959,701.60	
	ORKLA	69,804	84.74	5,915,190.96	
	DNB ASA	85,517	183.25	15,670,990.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	190.10	3,530,917.40	
	TELENOR ASA	65,744	146.60	9,638,070.40	
		535,658		80,420,512.16	

ノルウェークローネ 小計				(1,066,375,991)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	559.20	5,786,042.40
	NOVOZYMES A/S	19,125	448.30	8,573,737.50
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	2,989.00	2,256,695.00
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	245.00	21,406,875.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	15,200.00	4,544,800.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	577	15,985.00	9,223,345.00
	DSV PANALPINA A S	18,142	1,405.50	25,498,581.00
	PANDORA A/S	9,401	780.20	7,334,660.20
	CARLSBERG AS-B	9,672	1,122.00	10,851,984.00
	AMBU A/S-B	13,555	329.50	4,466,372.50
	COLOPLAST-B	9,208	985.20	9,071,721.60
	DEMANT A/S	11,604	324.00	3,759,696.00
	GN STORE NORD A/S	11,967	520.00	6,222,840.00
	GENMAB A/S	5,192	2,295.00	11,915,640.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	192.00	935,232.00
	NOVO NORDISK A/S-B	147,877	463.60	68,555,777.20
	DANSKE BANK A/S	64,813	120.40	7,803,485.20
TRYG A/S	29,772	146.25	4,354,155.00	
ORSTED A/S	15,439	892.40	13,777,763.60	
デンマーククローネ 小計		469,991		226,339,403.20 (4,026,577,982)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	26.52	547,081.08
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.94	733,300.98
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.14	685,563.30
	SANTOS	156,437	7.05	1,102,880.85
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	29.86	382,596.18
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	23.26	1,730,637.04
	BHP GROUP LTD	252,353	50.09	12,640,361.77
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	22.66	1,117,772.48
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.80	586,339.20
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	22.97	3,555,204.72
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	43.33	1,600,956.84
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	27.33	2,025,098.34
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.88	1,105,712.64
	ORICA LTD	38,288	13.95	534,117.60
	RIO TINTO LTD	32,028	127.11	4,071,079.08
	SOUTH32 LTD	341,133	3.00	1,023,399.00
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	18.93	174,534.60
BRAMBLES LTD	137,883	10.57	1,457,423.31	
AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.73	714,261.43	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.77	405,450.00	

	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.00	3,268,902.00
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	37.63	1,985,057.76
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.12	367,575.36
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.09	926,446.17
	REA GROUP LTD	5,276	156.05	823,319.80
	SEEK LTD	31,593	30.00	947,790.00
	WESFARMERS LTD	100,575	54.26	5,457,199.50
	COLES GROUP LTD	115,478	16.13	1,862,660.14
	WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	39.42	4,332,297.42
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	13.30	613,529.00
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	10.16	716,666.08
	COCHLEAR LIMITED	6,220	218.00	1,355,960.00
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	62.96	1,022,974.08
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	34.84	1,396,247.84
	CSL LIMITED	38,878	274.51	10,672,399.78
	AUST AND NZ BANKING GROUP	252,912	27.75	7,018,308.00
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	152,346	93.92	14,308,336.32
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	26.78	7,461,925.64
	WESTPAC BANKING	318,928	26.09	8,320,831.52
	AMP LTD	343,649	1.07	369,422.67
	ASX LTD	18,195	71.90	1,308,220.50
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	158.45	4,723,869.85
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	46.90	511,772.80
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	5.13	1,176,857.91
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.06	825,771.60
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	10.63	1,467,694.73
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	10.98	1,310,506.92
	AFTERPAY LTD	19,934	95.38	1,901,304.92
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	14.06	623,926.56
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	28.23	389,602.23
	XERO LTD	11,340	133.75	1,516,725.00
	TELSTRA CORP	403,126	3.47	1,398,847.22
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.43	170,909.25
	AGL ENERGY LTD	64,235	8.81	565,910.35
	AUSNET SERVICES	187,145	1.89	353,704.05
	オーストラリアドル 小計	6,259,339		127,667,243.41 (10,907,889,276)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.60	895,819.60
	A2 MILK CO LTD	66,854	7.59	507,421.86
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	33.80	1,842,776.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.16	514,248.72
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.58	792,880.44

	MERCURY NZ LTD	64,613	6.88	444,537.44
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.33	589,199.52
	ニュージーランドドル 小計	623,837		5,586,883.58 (442,760,523)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	64.35	14,768,067.60
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	149.30	17,542,750.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	26.55	4,566,600.00
	MTR CORP	151,000	44.20	6,674,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	66.70	11,605,800.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	34.55	6,840,900.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	9.13	1,205,160.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	13.68	1,926,144.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	26.10	3,807,990.00
	WH GROUP LTD	936,500	6.87	6,433,755.00
	BANK EAST ASIA	109,160	16.00	1,746,560.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.15	8,205,725.00
	HANG SENG BANK	59,400	162.30	9,640,620.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	107,000	454.40	48,620,800.00
	AIA GROUP LTD	1,045,200	101.50	106,087,800.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	242,996	49.95	12,137,650.20
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.80	3,893,600.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.20	3,494,600.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	35.60	4,458,116.80
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	41.80	5,700,475.00
	SINO LAND CO	315,400	11.64	3,671,256.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	118.60	14,054,100.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	63.80	2,583,900.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.80	2,193,360.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	46.10	7,237,700.00
	PCCW LTD	357,000	4.60	1,642,200.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	49.35	3,331,125.00
	CLP HOLDINGS	137,500	79.70	10,958,750.00
HONG KONG & CHINA GAS	861,579	13.30	11,459,000.70	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	49.75	6,840,625.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	112.00	2,654,400.00	
	香港ドル 小計	7,146,434		345,983,730.30 (4,847,232,061)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.36	735,928.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.77	555,698.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	4.95	536,243.40
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.85	522,750.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.97	887,642.00

	DBS GROUP	155,200	29.86	4,634,272.00	
	OCBC BANK	291,200	12.56	3,657,472.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.58	2,495,862.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	10.35	810,405.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.64	813,540.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.70	329,560.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.61	361,475.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	19.50	501,150.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.45	1,842,995.35	
	シンガポールドル 小計	2,896,975		18,684,992.75 (1,533,664,204)	
イスラエルシ ケル	ICL LTD	67,756	22.49	1,523,832.44	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	442.20	948,961.20	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	26.69	2,623,893.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.32	3,420,729.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.44	1,536,280.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	93.72	1,171,781.16	
	AZRIELI GROUP	4,323	239.40	1,034,926.20	
	NICE LTD	5,891	758.10	4,465,967.10	
	イスラエルシケル 小計	431,084		16,726,371.60 (559,806,567)	
	合 計	95,437,835		492,170,999,091 (492,170,999,091)	

## (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	1,129,256.31	
		LENDLEASE GROUP	64,786	780,671.30	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	737,341.92	
		オーストラリアドル 小計	303,750	2,647,269.53 (226,182,708)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,739,745.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,275,000.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,014,745.00 (84,266,577)	
		投資信託受益証券合計	899,250	310,449,285 (310,449,285)	
投資証券	アメリカド ル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	847,483.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,030	2,143,024.20	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,586	9,549,649.14	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,150,501.86	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,351,248.25	
	BOSTON PROPERTIES	13,029	1,409,216.64	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,078,199.72	
	CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	6,756,991.88	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,793,257.38	
	DUKE REALTY CORP	31,540	1,448,632.20	
	EQUINIX INC	7,704	5,496,418.80	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,157,657.96	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32,077	2,375,301.85	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,591,728.80	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,600,204.32	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,517,282.80	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,190,324.22	
	INVITATION HOMES INC	51,458	1,802,573.74	
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	1,137,649.80	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,074,773.28	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,507,959.09	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	766,025.50	
	PROLOGIS INC	63,163	7,328,171.26	
	PUBLIC STORAGE	13,912	3,857,380.24	
	REALTY INCOME CORP	29,792	2,028,835.20	
	REGENCY CENTERS CORP	15,605	1,019,942.80	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,586	2,788,663.26	
	SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,520,309.44	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,501,435.95	
	UDR INC	28,059	1,298,851.11	
	VENTAS INC	34,674	1,899,094.98	
	VEREIT INC	21,159	994,684.59	
	VICI PROPERTIES INC	49,459	1,553,012.60	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	708,093.90	
	WELLTOWER INC	35,679	2,665,221.30	
	WP CAREY INC	16,500	1,239,810.00	
	アメリカドル 小計	1,065,081	84,149,611.26 (9,152,953,216)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	507,980.92	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	329,937.00	
	カナダドル 小計	24,377	837,917.92 (75,186,374)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	378,005.16	
	GECINA SA	4,459	569,414.30	
	KLEPIERRE	17,225	383,773.00	



	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	744,082.35
	ユーロ 小計	37,101	2,075,274.81 (274,600,362)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	425,500.21
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	492,442.27
	SEGRO PLC	106,999	1,082,294.88
	イギリスポンド 小計	252,762	2,000,237.36 (305,336,233)
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	965,363.40
	GOODMAN GROUP	139,848	2,690,675.52
	GPT GROUP	167,884	777,302.92
	MIRVAC GROUP	392,919	1,092,314.82
	SCENTRE GROUP	486,663	1,333,456.62
	STOCKLAND	207,412	949,946.96
	VICINITY CENTERS	365,149	562,329.46
	オーストラリアドル 小計	1,853,965	8,371,389.70 (715,251,535)
香港ドル	LINK REIT	170,500	12,634,050.00
	香港ドル 小計	170,500	12,634,050.00 (177,003,040)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	866,620.90
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	908,572.80
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	464,200.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	540,708.30
	SUNTEC REIT	173,000	262,960.00
	シンガポールドル 小計	1,376,783	3,043,062.00 (249,774,528)
	投資証券合計	4,780,569	10,950,105,288 (10,950,105,288)
	合計		11,260,554,573 (11,260,554,573)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 592銘柄	97.5%			70.0%

	投資証券 36銘柄			2.5%	1.8%
カナダドル	株式 87銘柄	99.6%			3.6%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 233銘柄	99.5%			10.7%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 85銘柄	98.7%			4.7%
	投資証券 3銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 38銘柄	100.0%			1.2%
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	94.9%			1.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.0%			0.3%
	投資証券 5銘柄			14.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,598,927,652
コール・ローン	76,904,187

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
株式	89,273,195,822
投資信託受益証券	245,591,397
投資証券	73,414,826
派生商品評価勘定	65,531,206
未収入金	861,610
未収配当金	91,908,368
差入委託証拠金	790,341,056
流動資産合計	96,216,676,124
資産合計	96,216,676,124
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	460,743
前受金	65,170,633
未払金	190
未払解約金	37,335,018
未払利息	59
流動負債合計	102,966,643
負債合計	102,966,643
純資産の部	
元本等	
元本	25,738,059,714
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,375,649,767
元本等合計	96,113,709,481
純資産合計	96,113,709,481
負債純資産合計	96,216,676,124

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2021年 5月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2021年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,738,059,714口

	2021年 5月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,7343円 (37,343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 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2021年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	26,069,398,222円
期中追加設定元本額	1,898,855,757円
期中一部解約元本額	2,230,194,265円
期末元本額	25,738,059,714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	7,414,522,812円
世界経済インデックスファンド	3,879,434,425円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,879,865,305円
DC 世界経済インデックスファンド	4,657,886,727円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	196,908,325円
分散投資コア戦略ファンドA	282,739,656円

区分	2021年 5月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	1,326,986,681円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	590,996,137円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	537,232,980円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	306,500,783円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	15,430,638円
SMT インデックスバランス・オープン	82,712,227円
SMT 世界経済インデックス・オープン	109,869,898円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	363,851,501円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	61,526,991円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,813,997円
グローバル経済コア	349,101,469円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	27,381,111円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	1,000,526円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	997,283円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	437,751円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	958,966円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	558,601,319円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	90,302,206円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,626,792,071
投資信託受益証券	39,113,594
投資証券	15,766,658
合計	9,681,672,323

(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 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,441,804,269	-	6,506,974,902	65,170,633
	合計	6,441,804,269	-	6,506,974,902	65,170,633

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2021年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	29,467,800	-	29,367,630	100,170
	アメリカドル	29,467,800	-	29,367,630	100,170
合計		29,467,800	-	29,367,630	100,170

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	575,861	6.51	3,753,461.99	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	39,446	82.56	3,256,661.76	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,717	192.00	1,865,664.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	7.22	968,811.49	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.79	590,649.56	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	25,084	41.80	1,048,511.20	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	3.99	61,888.89	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	10.36	175,394.80	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,882	36.69	2,453,900.58	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	37.26	730,221.48	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	18.71	501,764.78	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	102.40	812,851.20	



SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	24.72	958,468.56
SOUTHERN COPPER CORP	9,585	76.87	736,798.95
51JOB INC-ADR	2,701	70.50	190,420.50
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	38,964	31.96	1,245,289.44
LI AUTO INC - ADR	16,633	18.26	303,718.58
NIO INC - ADR	126,816	36.94	4,684,583.04
XPENG INC - ADR	16,225	26.69	433,045.25
GSX TECHEDU INC- ADR	7,846	25.87	202,976.02
HUAZHU GROUP LTD-ADR	15,919	57.40	913,750.60
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	156,180	14.93	2,331,767.40
TAL EDUCATION GROUP- ADR	36,569	56.07	2,050,423.83
YUM CHINA HOLDINGS INC	39,507	62.11	2,453,779.77
AUTOHOME INC-ADR	6,571	93.02	611,234.42
BAIDU INC - SPON ADR	26,907	191.55	5,154,035.85
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12,149	101.67	1,235,188.83
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	5,000	8.57	42,850.00
HUYA INC-ADR	8,211	16.37	134,414.07
IQIYI INC-ADR	28,984	13.74	398,240.16
JOYY INC	6,185	87.75	542,733.75
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	10,503	22.18	232,956.54
MOMO INC-SPON ADR	15,529	14.37	223,151.73
NETEASE INC-ADR	40,751	109.86	4,476,904.86
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	39,090	16.07	628,176.30
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	47.91	251,479.59
YANDEX NV-A	30,372	65.60	1,992,555.06
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	188,334	225.31	42,433,533.54
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	32.92	115,483.36
JD.COM INC-ADR	85,581	75.51	6,462,221.31
PINDUODUO INC-ADR	38,981	133.79	5,215,267.99
TRIP.COM GROUP LTD	48,611	39.22	1,906,523.42
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	41,109	28.25	1,161,329.25
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	14.65	584,915.90
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,157	11.04	90,053.28
BEIGENE LTD-ADR	4,248	311.97	1,325,248.56
HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	26.23	189,983.89
ZAI LAB LTD-ADR	6,558	158.14	1,037,082.12
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	141,961	3.67	520,996.87
CREDICORP LTD	6,128	121.12	742,223.36
SBERBANK-SPONSORED ADR	257,781	17.25	4,446,722.25
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	11,906	61.50	732,219.00
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.38	523,959.28
LUFAX HOLDING LTD	12,385	11.15	138,092.75

	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	44.05	89,025.05	
	KE HOLDINGS INC	12,902	50.90	656,711.80	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.87	47,736.86	
	21VIANET GROUP INC-ADR	7,475	25.70	192,107.50	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	9,050	74.39	673,229.50	
	GLOBANT SA	3,899	217.88	849,514.12	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	40.71	226,266.18	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.78	349,918.12	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,716	4.68	68,870.88	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,948	74.70	369,615.60	
	アメリカドル 小計	3,237,592		119,797,576.57 (13,030,382,403)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	17.13	26,468,607.93	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	323,292	100.21	32,397,091.32	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	282.90	4,102,050.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	56.76	5,497,319.52	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	57.71	2,164,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	360.42	8,399,588.10	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	215.58	9,416,534.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	154.97	2,631,390.60	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	223,390	50.67	11,319,171.30	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	73.88	2,319,832.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	511,980	65.08	33,319,658.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	108.93	5,498,241.75	
	BEACLE SAB DE CV	48,100	48.04	2,310,724.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	185,340	158.87	29,444,965.80	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	214.19	5,560,372.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	41.10	7,471,980.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	35.13	6,386,634.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	254,500	119.57	30,430,565.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	19.38	4,893,450.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,435,740	14.75	50,677,165.00	
	TELESITES SAB DE CV	74,800	18.85	1,409,980.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	57,500	87.60	5,037,000.00	
	メキシコペソ 小計	7,616,555		287,156,446.52 (1,568,592,089)	
ブラジルリアル	COSAN SA	73,600	22.22	1,635,392.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	375,100	23.93	8,976,143.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	447,240	24.38	10,903,711.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	20.34	1,537,704.00	
	BRADSPAR SA -PREF	10,000	74.19	741,900.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	50.63	3,189,690.00	

GERDAU SA-PREF	105,000	36.37	3,818,850.00
SUZANO SA	74,079	67.42	4,994,406.18
VALE SA	368,378	115.45	42,529,240.10
WEG SA	171,144	33.42	5,719,632.48
CCR SA	125,600	13.45	1,689,320.00
LOCALIZA RENT A CAR	61,952	63.21	3,915,985.92
RUMO SA	114,200	21.34	2,437,028.00
ALPARGATAS SA - PREF	10,300	46.94	483,482.00
B2W CIA DIGITAL	22,349	62.48	1,396,365.52
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	96,618	20.50	1,980,669.00
LOJAS RENNER S.A.	82,907	43.56	3,611,428.92
MAGAZINE LUIZA SA	305,500	19.89	6,076,395.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	23.63	1,795,880.00
VIA VAREJO SA	135,900	12.16	1,652,544.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	21.49	891,835.00
RAIA DROGASIL SA	122,500	26.99	3,306,275.00
AMBEV SA	476,800	16.21	7,728,928.00
BRF SA	52,500	21.11	1,108,275.00
JBS SA	110,000	31.18	3,429,800.00
NATURA &CO HOLDING SA	80,908	50.10	4,053,490.80
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	100,500	15.32	1,539,660.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	85.10	4,629,440.00
HYPERA SA	35,300	34.72	1,225,616.00
BANCO BRADESCO S.A.	161,367	20.99	3,387,093.33
BANCO BRADESCO SA-PREF	475,802	24.06	11,447,796.12
BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	29.94	2,643,702.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	486,581	27.63	13,444,233.03
ITAUSA SA	503,167	10.34	5,202,746.78
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	193,603	53.34	10,326,784.02
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	23.00	1,587,000.00
TOTVS SA	26,200	33.98	890,276.00
TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	43.53	2,276,619.00
TIM SA	96,100	12.36	1,187,796.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	14,500	38.84	563,180.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	37.80	1,270,080.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	113,867	12.01	1,367,542.67
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	79,000	6.02	475,580.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	41.89	1,453,583.00
CPFL ENERGIA SA	43,700	28.05	1,225,785.00
ENGIE BRASIL SA	29,250	40.18	1,175,265.00
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	80,900	24.51	1,982,859.00
	6,450,812		198,907,008.07

ブラジルレアル 小計				(4,130,144,896)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	7,882.60	352,588,698.00
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,995.40	271,304,561.00
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	12,523	38,107.00	477,213,961.00
	FALABELLA SA	70,837	3,340.00	236,595,580.00
	CENCOSUD SA	137,988	1,481.00	204,360,228.00
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,600.00	48,741,000.00
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,650.00	25,099,800.00
	BANCO DE CHILE	4,862,640	78.91	383,710,922.40
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	33,868.00	184,783,808.00
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	41.00	257,472,661.00
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,326.10	55,165,760.00
	COLBUN SA	1,215,680	118.60	144,179,648.00
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	105.06	366,797,553.90
	ENEL CHILE SA	2,561,278	50.22	128,627,381.16
チリペソ 小計		18,882,430		3,136,641,562.46 (490,809,125)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,288.00	1,118,783,952.00
	BANCOLOMBIA SA	29,376	28,940.00	850,141,440.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	28,930.00	1,107,382,540.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	20,700.00	430,974,000.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	21,240.00	1,072,853,640.00
コロンビアペソ 小計		627,964		4,580,135,572.00 (132,384,238)
ユーロ	OPAP SA	17,668	12.38	218,729.84
	JUMBO SA	7,201	15.20	109,455.20
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.05	368,208.35
ユーロ 小計		51,076		696,393.39 (92,146,773)
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	16.16	431,605.50
イギリスポンド 小計		26,700		431,605.50 (65,884,579)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	96.60	1,120,849.80
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	19.74	2,304,743.70
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	15.04	1,497,472.64
	KOC HOLDING AS	89,884	18.89	1,697,908.76
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	89,157	7.60	677,593.20
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	12.99	807,861.09
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	182.00	1,183,182.00
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	64.70	2,770,712.80
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.15	1,423,053.15
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	7.72	1,852,738.24

	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.08	878,900.96	
	YAPI VE KREDI BANKASI	246,063	2.13	524,114.19	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.68	992,801.04	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	15.17	2,170,690.47	
	トルコリラ 小計	1,711,338		19,902,622.04	(262,965,383)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	675.00	5,037,525.00	
	MONETA MONEY BANK AS	14,764	77.35	1,141,995.40	
	CEZ AS	18,145	602.50	10,932,362.50	
	チェココルナ 小計	40,372		17,111,882.90	(88,314,427)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,198.00	93,096,290.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,510.00	129,164,780.00	
	OTP BANK NYRT	22,061	13,875.00	306,096,375.00	
	ハンガリーフォリント 小計	79,594		528,357,445.00	(195,082,249)
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	70.02	2,150,524.26	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	200,051	6.66	1,333,139.86	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	220.20	2,891,666.40	
	LPP SA	124	10,800.00	1,339,200.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	161.46	1,082,427.84	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	29.14	1,051,895.72	
	ALLEGRO.EU SA	27,362	54.86	1,501,079.32	
	DINO POLSKA SA	5,945	254.10	1,510,624.50	
	BANK PEKAO SA	15,847	83.70	1,326,393.90	
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	35.82	3,342,435.84	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	226.90	820,243.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	33.50	2,078,474.00	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.73	374,856.63	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	9.96	632,420.16	
	ポーランドズロチ 小計	614,101		21,435,381.93	(622,822,170)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.68	1,474,560.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,495,400	4.16	10,380,864.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	331,000	17.20	5,693,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,148,000	3.08	6,615,840.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	10.30	1,462,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.75	1,615,000.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	105,500	48.05	5,069,275.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	13.66	1,386,490.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	5.91	2,765,880.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	11.20	4,614,400.00	

CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	8.57	2,468,160.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	20.25	1,680,750.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	7.27	1,206,820.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	12.30	1,586,700.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	16.52	838,390.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	8.02	725,810.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	12.30	8,966,700.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.90	1,347,500.00
BOC AVIATION LTD	23,800	72.00	1,713,600.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.38	662,480.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	38.05	6,068,975.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	19.28	2,467,840.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.24	2,009,760.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	5.45	926,500.00
CITIC LTD	443,000	8.79	3,893,970.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	11.64	3,352,320.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	31.70	2,472,600.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	19.14	1,043,130.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	211,800	17.00	3,600,600.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	12.34	387,673.44
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	33.65	2,096,395.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	10.18	1,182,916.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	35.00	1,452,500.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.84	1,863,758.16
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	79.55	10,818,800.00
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	64,000	18.04	1,154,560.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	11.90	2,142,000.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	6.15	1,316,100.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.73	1,421,040.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	13.10	2,168,665.70
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.18	911,680.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	398,500	16.52	6,583,220.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	7.21	1,808,080.54
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	9.40	1,466,400.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	13.20	1,688,570.40
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.70	589,600.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.30	2,686,400.00
BYD CO LTD-H	83,000	145.00	12,035,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.05	1,875,300.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	43.15	1,173,680.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	567,000	19.22	10,897,740.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	19.20	6,772,800.00

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	6.64	2,379,404.16
MINTH GROUP LTD	64,000	30.55	1,955,200.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	16.10	1,738,800.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	144.20	16,006,200.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	4.10	795,400.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	188,400	32.10	6,047,640.00
LI NING CO LTD	217,000	68.50	14,864,500.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	177.30	15,035,040.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	17.06	767,700.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	17.98	1,258,600.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	7.13	684,480.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	85,000	43.15	3,667,750.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	30.65	1,747,050.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	22,500	12.56	282,600.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.05	1,522,500.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	76.85	2,474,570.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	20,000	244.20	4,884,000.00
TENCENT HOLDINGS LTD	571,600	600.00	342,960,000.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	39.00	2,106,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	1.24	1,496,627.92
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	26,150	115.30	3,015,095.00
MEITUAN-CLASS B	359,300	282.80	101,610,040.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	18.84	1,288,656.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	10.92	1,244,880.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	57.05	3,879,400.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	6.94	1,797,460.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	104.00	1,580,800.00
CHINA FEIHE LTD	86,000	21.00	1,806,000.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	41.50	11,661,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	148,000	64.95	9,612,600.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.70	1,156,200.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	22,800	39.25	894,900.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	63,000	51.30	3,231,900.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	14.08	3,210,240.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	73.15	3,364,900.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	9.53	762,400.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.80	3,248,000.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	70.55	3,386,400.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	52,500	50.15	2,632,875.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	25.90	647,500.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	30,000	11.44	343,200.00

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	22.90	9,663,800.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	18.34	2,274,160.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	57.75	3,811,500.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	86.45	4,642,365.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	17.54	4,279,760.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	17.48	2,244,432.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	24.20	3,029,840.00
3SBIO INC	119,000	6.95	827,050.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	5,800	303.40	1,759,720.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	17.18	1,718,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	9.50	9,083,520.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	5.09	801,675.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	4.50	747,000.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	17.76	1,456,320.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	142.30	725,730.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	33.05	4,032,100.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	99,000	80.65	7,984,350.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	12,800	151.30	1,936,640.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	50.05	3,653,650.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	7.96	8,859,480.00
SSY GROUP LTD	114,000	4.70	535,800.00
WUXI APPTec CO LTD-H	26,740	165.80	4,433,492.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	318,000	101.80	32,372,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	3.05	8,616,250.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,279,200	3.14	25,996,688.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	5.14	5,646,161.50
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	3.49	1,279,085.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.12	3,918,944.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,450,620	6.25	59,066,375.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	3.16	1,185,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	392,423	66.30	26,017,644.90
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	4.20	2,832,480.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.35	505,850.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,924,515	5.05	29,918,800.75
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.18	5,485,620.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.55	1,289,600.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	9.30	1,246,200.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.57	2,207,310.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.02	945,540.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	18.84	2,486,880.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	19.46	4,835,810.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	8.99	2,157,600.00



GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	11.16	988,776.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.96	2,486,112.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	11.14	1,510,584.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	805,000	15.92	12,815,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	27.75	8,230,650.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	14.00	2,576,336.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	30.10	2,901,640.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.73	2,563,470.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.75	5,341,982.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	588,000	81.60	47,980,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	42.80	1,955,960.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	12.54	1,780,680.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	8.19	1,031,940.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	13.18	2,451,480.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.89	1,670,420.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	331,540	19.54	6,478,291.60
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	8.38	670,400.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	317,111	37.45	11,875,806.95
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	26.95	4,807,880.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.84	1,887,840.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	800,964	9.50	7,609,158.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	9.47	686,575.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	10.14	1,370,928.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	60,000	30.75	1,845,000.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.47	541,320.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	12.36	1,884,900.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	12.42	1,863,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	49.00	9,653,000.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	62.65	501,200.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	8.17	1,666,680.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.77	930,720.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	22.60	2,994,500.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	30.85	7,743,350.00
WHARF HOLDINGS	100,000	23.75	2,375,000.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.87	1,080,860.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	5.37	703,470.00
CHINA YOUZAN LTD	1,456,000	2.21	3,217,760.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	24.05	5,820,100.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	52.15	4,797,800.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	32,000	31.15	996,800.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	16.12	1,273,480.00
WEIMOB INC	149,000	15.14	2,255,860.00

	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	41.55	2,970,825.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	40.10	2,426,050.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	44.15	2,958,050.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	18.32	1,264,080.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	10.62	7,773,840.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	70,500	170.20	11,999,100.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	25.25	35,496,450.00	
	ZTE CORP-H	82,908	19.14	1,586,859.12	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.11	5,068,260.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.05	1,549,975.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.99	1,823,900.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.82	1,439,620.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	255,200	28.05	7,158,360.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	10.72	3,634,080.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.80	1,198,800.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	44.15	4,679,900.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	10.20	1,789,080.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	73,300	138.50	10,152,050.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	11.84	3,788,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	2.82	1,043,400.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	8.63	3,106,800.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	44.70	2,011,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	428,273	10.30	4,411,211.90	
	香港ドル 小計	87,081,826		1,345,312,325.04 (18,847,825,673)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.04	1,257,550.72	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	19.30	484,430.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.30	2,240,170.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	5.38	1,552,668.00	
	GAMUDA BHD	141,520	3.50	495,320.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	8.00	305,600.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.25	756,778.50	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.50	586,267.00	
	MISC BHD	125,040	6.72	840,268.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.32	302,400.00	
	GENTING BHD	188,500	4.94	931,190.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.88	1,064,736.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	28.10	162,980.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	8.77	122,780.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.10	1,108,394.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,146	22.52	791,487.92	

	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,500	135.10	202,650.00
	PPB GROUP BERHAD	73,480	18.70	1,374,076.00
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.07	757,536.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.71	1,163,586.66
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	181,300	9.56	1,733,228.00
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.66	1,297,838.00
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	128,200	4.19	537,158.00
	SUPERMAX CORP BHD	161,715	4.96	802,106.40
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	5.26	2,655,774.00
	AMMB HOLDINGS BHD	30,500	2.91	88,755.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	635,119	4.16	2,642,095.04
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	17.52	1,073,835.84
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	16.72	278,103.76
	MALAYAN BANKING BHD	411,105	8.24	3,387,505.20
	PUBLIC BANK BERHAD	1,481,600	4.10	6,074,560.00
	RHB BANK BHD	206,419	5.19	1,071,314.61
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.68	1,049,863.52
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.19	1,306,023.00
	MAXIS BHD	267,900	4.52	1,210,908.00
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	5.79	408,496.08
	PETRONAS GAS BHD	75,500	15.70	1,185,350.00
	TENAGA NATIONAL BHD	225,575	9.90	2,233,192.50
	マレーシアリングット 小計	8,429,879		45,536,976.55 (1,207,863,749)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	120.00	16,128,000.00
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	40.50	48,494,700.00
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	59.50	7,145,950.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	49.25	10,165,200.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	69.50	15,632,913.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	464.00	37,584,000.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	61.50	26,328,150.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.90	6,454,300.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.90	7,204,550.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.78	3,873,234.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	29.25	10,610,086.50
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	35.00	6,377,000.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	13.90	6,547,386.50
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	29.75	8,597,750.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	35.50	6,304,800.00
	CP ALL PCL-NVDR	592,000	62.50	37,000,000.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	326,300	28.75	9,381,125.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	34.75	2,293,500.00

THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	15.20	2,810,480.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	907,200	21.70	19,686,240.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	132.00	4,329,600.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	45.25	3,330,400.00	
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	119.00	6,176,100.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	125.50	15,863,200.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	55,900	125.00	6,987,500.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	11.30	4,956,745.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	101.50	9,003,050.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	20.00	3,302,000.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	73.50	7,460,250.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	63.75	5,724,750.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	82.50	6,294,750.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	51.75	11,711,025.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.10	7,063,200.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	28,000	402.00	11,256,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	170.00	20,349,000.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	64.00	15,596,800.00	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	31.75	2,095,500.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.24	3,114,965.16	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	42.25	2,256,150.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	177.50	2,999,750.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	129,400	61.25	7,925,750.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	73.25	4,995,650.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	34.00	9,798,800.00	
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	50.25	2,728,575.00	
タイパーツ 小計	12,816,266		463,938,875.16 (1,619,146,674)	
フィリピンペン				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	34.40	8,185,136.00	
AYALA CORPORATION	28,280	721.00	20,389,880.00	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	501.00	3,435,858.00	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	51.10	15,509,514.30	
SM INVESTMENTS CORP	22,805	920.00	20,980,600.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	135.40	13,013,294.00	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	175.70	10,719,457.00	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	87,300	34.05	2,972,565.00	
UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	132.00	12,613,920.00	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	102,805	82.00	8,430,010.00	
BDO UNIBANK INC	219,911	104.00	22,870,744.00	
METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	43.55	7,024,048.85	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.96	9,328,572.00	
AYALA LAND INC	794,100	32.25	25,609,725.00	

	MEGAWORLD CORP	638,000	3.01	1,920,380.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,003,150	33.80	33,906,470.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	1,831.00	8,587,390.00	
	PLDT INC	10,460	1,268.00	13,263,280.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	23.30	2,085,350.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	273.80	7,970,318.00	
	フィリピンペソ 小計	6,348,089		248,816,512.15 (565,037,417)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,185.00	1,705,570,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	21,750.00	4,369,575,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,620.00	2,582,796,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	930.00	2,680,725,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	9,250.00	2,258,850,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	12,250.00	2,327,500,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	604,200	2,660.00	1,607,172,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	9,800.00	3,386,880,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	5,325.00	11,812,980,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	6,600.00	5,229,180,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	35,075.00	2,090,470,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,450.00	1,360,450,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,500.00	2,789,150,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	5,525.00	4,123,860,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,460.00	4,023,614,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	967,700	32,000.00	30,966,400,000.00	
	BANK MANDIRI	1,691,296	5,950.00	10,063,211,200.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	5,600.00	4,537,120,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,531,700	4,050.00	22,403,385,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,100,000	1,140.00	1,254,000,000.00	
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,789,600	3,190.00	15,278,824,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	1,230.00	973,545,000.00		
	インドネシアルピア 小計	29,737,196		137,825,257,700.00 (1,061,254,484)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	46,700.00	307,893,100.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	94,400.00	419,796,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	283,500.00	1,583,631,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	46,800.00	579,430,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	59,500.00	430,899,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	455,500.00	356,656,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	281,000.00	533,338,000.00	
	LG CHEM LTD	4,588	919,000.00	4,216,372,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	435,000.00	381,495,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	309,000.00	596,370,000.00	

POSCO	7,515	398,000.00	2,990,970,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,941	150,000.00	291,150,000.00
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	748	255,500.00	191,114,000.00
CJ CORP	1,230	99,800.00	122,754,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	51,400.00	221,431,200.00
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	17,992	12,650.00	227,598,800.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	45,650.00	308,594,000.00
HANWHA CORPORATION	2,825	31,500.00	88,987,500.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	53,600.00	523,564,800.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	5,180	75,500.00	391,090,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	33,100.00	236,300,900.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	154,500.00	672,693,000.00
LG CORP	9,902	126,500.00	1,252,603,000.00
LOTTE CORP	2,370	35,550.00	84,253,500.00
SAMSUNG C&T CORP	8,727	134,500.00	1,173,781,500.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	17,950.00	332,362,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	6,010.00	356,429,060.00
SK HOLDINGS CO LTD	3,592	282,500.00	1,014,740,000.00
S-1 CORPORATION	840	80,000.00	67,200,000.00
CJ LOGISTICS	862	168,500.00	145,247,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	198,500.00	314,821,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	16,389	27,900.00	457,253,100.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	7,440.00	221,235,840.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	49,500.00	349,767,000.00
HANON SYSTEMS	19,000	16,450.00	312,550,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,328	277,500.00	1,756,020,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	224,000.00	3,336,928,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	111,000.00	338,661,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	113,000.00	389,737,000.00
KIA CORP	26,820	80,700.00	2,164,374,000.00
COWAY CO LTD	5,058	69,400.00	351,025,200.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	49,450.00	201,756,000.00
HLB INC	10,012	33,200.00	332,398,400.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	153,000.00	1,685,907,000.00
KANGWON LAND INC	7,703	25,550.00	196,811,650.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	23,250.00	117,877,500.00
KAKAO CORP	28,895	114,500.00	3,308,477,500.00
NAVER CORP	11,900	361,000.00	4,295,900,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,643	830,000.00	1,363,690,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	130,500.00	321,682,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	57,500.00	264,787,500.00
CJ ENM CO LTD	830	149,100.00	123,753,000.00

HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	92,900.00	283,437,900.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	126,000.00	130,284,000.00
SHINSEGAE CO LTD	881	315,500.00	277,955,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	166,000.00	91,134,000.00
EMART	1,864	161,500.00	301,036,000.00
GS RETAIL CO LTD	4,060	36,250.00	147,175,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	427,000.00	330,925,000.00
KT&G CORP	13,223	83,900.00	1,109,409,700.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,348	120,500.00	162,434,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	540,000.00	36,720,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	277,000.00	795,821,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,571,000.00	1,501,876,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	83	740,000.00	61,420,000.00
PACIFIC CORP	3,393	74,000.00	251,082,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,871	112,900.00	775,735,900.00
ALTEOGEN INC	2,841	77,000.00	218,757,000.00
CELLTRION INC	9,922	266,500.00	2,644,213,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,911	131,800.00	251,869,800.00
HANMI PHARM CO LTD	499	340,500.00	169,909,500.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,638	804,000.00	1,316,952,000.00
SEEGENE INC	3,838	82,100.00	315,099,800.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	64,300.00	196,050,700.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,470	108,000.00	158,760,000.00
YUHAN CORPORATION	5,817	63,100.00	367,052,700.00
HANA FINANCIAL GROUP	29,188	46,300.00	1,351,404,400.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,200.00	288,966,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	38,842	58,300.00	2,264,488,600.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,219	41,500.00	1,876,588,500.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	11,000.00	653,466,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	112,000.00	515,424,000.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,905.00	234,969,120.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	10,200.00	316,353,000.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	13,200.00	159,812,400.00
SAMSUNG CARD CO	1,899	34,250.00	65,040,750.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	43,500.00	251,256,000.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	50,500.00	212,554,500.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	5,513	24,900.00	137,273,700.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	208,000.00	646,464,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	86,400.00	640,828,800.00
DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	83,900.00	121,738,900.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	183,000.00	681,675,000.00
KMW CO LTD	1,901	51,700.00	98,281,700.00

	LG DISPLAY CO LTD	24,071	24,700.00	594,553,700.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	201,000.00	284,415,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	182,000.00	1,019,746,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	474,322	81,900.00	38,846,971,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	83,239	74,800.00	6,226,277,200.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,575	642,000.00	3,579,150,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	14,050.00	310,856,250.00	
	SK TELECOM	3,705	312,000.00	1,155,960,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	24,300.00	642,953,700.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	32,900.00	149,300,200.00	
	SK HYNIX INC	54,927	129,500.00	7,113,046,500.00	
	韓国ウォン 小計	1,551,407		124,639,086,070.00 (12,177,238,709)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	105.00	11,785,200.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	50.30	11,779,052.80	
	CHINA STEEL	1,266,261	41.20	52,169,953.20	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	356,061	90.70	32,294,732.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	105.00	40,826,520.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	501,752	88.60	44,455,227.20	
	TAIWAN CEMENT	486,511	52.30	25,444,525.30	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	1,070.00	12,840,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	33.25	11,571,931.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	22,532	372.00	8,381,904.00	
	EVERGREEN MARINE	266,039	85.00	22,613,315.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	31.00	4,650,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	51.00	9,030,111.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	570.00	11,364,090.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	207.00	8,993,736.00	
	GIANT MANUFACTURING	34,464	328.00	11,304,192.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	379.50	6,072,000.00	
	POU CHEN	273,780	34.20	9,363,276.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	597.00	17,910,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	271.00	16,136,424.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	494,395	74.60	36,881,867.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	235.00	4,700,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	17.85	10,385,951.10	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,786,237	23.10	41,262,074.70	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,122,970	26.65	29,927,150.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,002,216	22.50	22,549,860.00	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	772,097	18.90	14,592,633.30	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,056,339	32.60	34,436,651.40	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	13.65	15,791,534.85	



TAISHIN FINANCIAL HOLDING	965,570	14.90	14,386,993.00
TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	9.99	4,999,505.49
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	823,289	21.50	17,700,713.50
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	44.05	14,574,427.05
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,302	203.50	27,940,957.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	25.90	27,354,518.10
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	55.10	48,935,577.30
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	12.85	16,149,623.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	326,258	26.10	8,515,333.80
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	712,082	70.80	50,415,405.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	10.05	12,015,146.85
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	113,432	44.70	5,070,410.40
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	53.50	7,899,810.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	290.00	13,920,000.00
ACER INC	255,803	34.15	8,735,672.45
ADVANTECH CO LTD	29,336	348.00	10,208,928.00
ASUSTEK COMPUTER INC	59,092	391.00	23,104,972.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	28.15	26,604,283.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	190.50	13,277,850.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	61,792	84.90	5,246,140.80
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	26.75	20,731,250.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	24.55	10,599,708.00
DELTA ELECTRONICS INC	198,903	293.50	58,378,030.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	66.20	6,146,670.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,208,248	117.50	141,969,140.00
INVENTEC CO LTD	280,511	26.85	7,531,720.35
LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	3,005.00	27,165,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	67.40	15,195,464.80
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	190.00	11,400,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	318.00	6,678,000.00
PEGATRON CORP	200,474	71.10	14,253,701.40
QUANTA COMPUTER INC	286,270	95.40	27,310,158.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	56.10	7,186,410.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	106.50	10,650,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	231.00	6,237,000.00
WISTRON CORP	242,695	31.15	7,559,949.25
WIWYNN CORP	8,000	944.00	7,552,000.00
WPG HOLDINGS LTD	143,692	50.90	7,313,922.80
YAGEO CORPORATION	38,764	535.00	20,738,740.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	99.80	5,980,215.60
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	366,315	113.50	41,576,752.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	65.60	10,299,200.00

	TAIWAN MOBILE CO LTD	143,200	100.50	14,391,600.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	314,315	113.00	35,517,595.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,075.00	3,225,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	766.00	18,384,000.00	
	MEDIATEK INC	147,804	1,060.00	156,672,240.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	85.50	9,832,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	578.00	33,550,010.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	547.00	6,344,653.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	69,770	105.00	7,325,850.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	516.00	26,287,104.00	
	SILERGY CORP	7,000	3,300.00	23,100,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,454,389	599.00	1,470,179,011.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,120,000	54.00	60,480,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	114.00	10,146,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	337.50	10,800,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	33.90	11,831,100.00	
	新台湾ドル 小計	32,764,026		3,307,090,077.09 (12,888,060,739)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	443.15	29,301,078.00	
	COAL INDIA LTD	84,540	136.85	11,569,299.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	251.45	14,942,416.25	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	94.70	18,349,545.50	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	111.45	28,164,418.05	
	PETRONET LNG LTD	83,779	242.90	20,349,919.10	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	279,072	1,931.75	539,097,336.00	
	ACC LTD	5,315	1,904.75	10,123,746.25	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	312.25	22,960,679.25	
	ASIAN PAINTS LTD	37,699	2,551.65	96,194,653.35	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	715.45	21,069,287.05	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,449.60	45,704,438.40	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	147,807	401.10	59,285,387.70	
	JSW STEEL LTD	80,284	756.95	60,770,973.80	
	PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,558.70	20,845,728.90	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	1,816.20	22,281,141.60	
	SHREE CEMENT LTD	901	27,840.00	25,083,840.00	
	TATA STEEL LTD	67,202	1,182.35	79,456,284.70	
	ULTRATECH CEMENT LTD	9,760	6,481.90	63,263,344.00	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	629.40	34,115,997.60	
	VEDANTA LTD	198,772	283.05	56,262,414.60	
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,002.00	23,522,952.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	62,365	1,342.70	83,737,485.50	
	SIEMENS INDIA LTD	5,926	1,863.05	11,040,434.30	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	45,467	767.75	34,907,289.25
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	574.00	15,185,170.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,640.60	13,715,416.00
BAJAJ AUTO LTD	5,820	3,866.75	22,504,485.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	1,832.70	16,184,573.70
BHARAT FORGE LTD	30,322	636.80	19,309,049.60
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,417.15	35,495,847.75
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,860.80	35,010,470.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	83,591	767.40	64,147,733.40
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,994	6,703.05	93,802,481.70
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	220.90	27,485,703.40
MRF LTD	133	77,446.20	10,300,344.60
TATA MOTORS LTD	190,082	302.75	57,547,325.50
PAGE INDUSTRIES LTD	601	29,629.85	17,807,539.85
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	1,446.50	47,575,385.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	2,740.55	24,078,472.30
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	4,677.30	36,740,191.50
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	186.25	14,801,846.25
TRENT LTD	19,255	752.75	14,494,201.25
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	2,895.50	50,740,742.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,155	3,461.25	35,148,993.75
ITC LTD	289,062	205.35	59,358,881.70
NESTLE INDIA LIMITED	3,198	16,761.35	53,602,797.30
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	629.00	38,377,177.00
UNITED SPIRITS LTD	32,483	547.95	17,799,059.85
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,511.35	14,457,574.10
DABUR INDIA LTD	58,111	534.60	31,066,140.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	702.10	27,005,574.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	83,473	2,411.20	201,270,097.60
MARICO LTD	42,465	473.85	20,122,040.25
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	3,310.85	33,485,936.90
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,013.05	35,877,165.75
BIOCON LTD	58,256	381.15	22,204,274.40
CIPLA LTD	49,816	882.90	43,982,546.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,029.10	59,558,156.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	5,174.70	65,428,906.80
IPCA LABORATORIES LTD	9,167	2,056.30	18,850,102.10
LUPIN LTD	26,552	1,196.55	31,770,795.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	78,858	679.45	53,580,068.10
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,616.05	15,984,065.50
AXIS BANK LTD	229,173	716.75	164,259,747.75
BANDHAN BANK LTD	74,811	297.35	22,245,050.85

	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	170,867	2,496.75	426,612,182.25	
	ICICI BANK LTD	511,368	607.10	310,451,512.80	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	56,150	1,780.35	99,966,652.50	
	STATE BANK OF INDIA	187,504	358.25	67,173,308.00	
	YES BANK LTD	1,020,164	13.35	13,619,189.40	
	BAJAJ FINANCE LTD	28,025	5,493.80	153,963,745.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,718.65	11,132,871.75	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,211.70	15,052,949.10	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,669.65	19,571,637.30	
	REC LTD	48,168	131.20	6,319,641.60	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,297.65	27,530,942.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	11,318.45	44,006,133.60	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	74,097	672.65	49,841,347.05	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,449.95	34,131,823.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	561.75	17,825,451.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	41,424	1,000.25	41,434,356.00	
	DLF LTD	56,420	257.95	14,553,539.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	109,406	916.40	100,259,658.40	
	INFOSYS LTD	332,785	1,352.55	450,108,351.75	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	3,768.60	21,692,061.60	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	94,235	3,132.90	295,228,831.50	
	TECH MAHINDRA LTD	62,414	980.95	61,225,013.30	
	WIPRO LTD	118,712	515.25	61,166,358.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	241,735	568.50	137,426,347.50	
	INDUS TOWERS LTD	35,804	254.60	9,115,698.40	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,102.90	46,961,482.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	150.25	26,258,892.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	515.10	13,765,532.40	
	NTPC LTD	394,110	105.05	41,401,255.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	214.55	43,202,860.75	
	インドルピー 小計	7,975,720		5,775,761,847.10 (8,605,885,152)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	92.67	6,764,910.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	127.07	8,450,155.00	
	MCB BANK LTD	53,300	163.52	8,715,616.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		23,930,681.00 (17,230,090)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	21,829	18.18	396,851.22	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.15	936,331.43	
	MESAI EED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.93	858,550.95	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	13.50	2,656,638.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	5.48	1,119,293.13	

	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.46	1,813,168.40	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	9.34	921,132.41	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	17.30	1,976,179.00	
	QATAR NATIONAL BANK	448,253	17.99	8,064,071.47	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.22	668,740.27	
	OOREDOO QSC	72,800	7.11	517,608.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	17.03	1,063,029.63	
	カタールリアル 小計	2,573,602		20,991,593.91 (620,301,600)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	163.20	3,675,264.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	5,158	286.69	1,478,747.02	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,934.00	11,834,146.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,424	324.34	12,786,780.16	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	146.76	14,250,689.52	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	70.88	3,990,614.88	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	79,345	269.86	21,412,041.70	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	690.32	3,708,399.04	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	246.38	8,364,601.00	
	SASOL LTD	57,207	240.69	13,769,152.83	
	SIBANYE STILLWATER LTD	266,701	67.10	17,895,637.10	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	173.38	4,802,972.76	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	128.49	5,207,571.21	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	193.73	5,523,242.30	
	NASPERS LTD-N SHS	43,648	3,337.65	145,681,747.20	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	50.57	5,587,732.15	
	BID CORP LTD	35,017	283.82	9,938,524.94	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	247.08	6,651,640.68	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,265	149.14	6,601,682.10	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	190.24	4,427,645.76	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	206.29	2,686,514.67	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	164.02	6,108,760.88	
	ABSA GROUP LTD	73,296	123.00	9,015,408.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,974	1,553.96	10,837,317.04	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	147.93	5,626,813.41	
	STANDARD BANK GROUP LTD	127,912	121.24	15,508,050.88	
	FIRSTRAND LTD	440,697	53.25	23,467,115.25	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	278.19	4,781,251.53	
REMGRO LTD	55,441	110.31	6,115,696.71		
DISCOVERY LIMITED	48,488	144.42	7,002,636.96		
OLD MUTUAL LTD	489,612	13.23	6,477,566.76		
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	31.88	3,228,423.84		
SANLAM LTD	167,172	58.90	9,846,430.80		

	NEPI ROCKCASTLE PLC	33,499	97.16	3,254,762.84	
	MTN GROUP LTD	173,000	96.47	16,689,310.00	
	VODACOM GROUP	62,331	126.15	7,863,055.65	
	南アフリカランド 小計	2,934,741		446,097,947.57 (3,452,798,114)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	227,621	6.26	1,424,907.46	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	61,141	5.04	308,150.64	
	DUBAI ISLAMIC BANK	215,945	4.54	980,390.30	
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	12.45	3,302,935.20	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	283,262	14.70	4,163,951.40	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	3.60	1,323,140.40	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.96	352,100.28	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.00	1,540,160.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	174,383	21.56	3,759,697.48	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	2,159,870		17,155,433.16 (507,457,712)	
クウェートディ ナール	AGILITY	129,938	1.08	140,592.91	
	BOUBYAN BANK K.S.C	130,019	0.66	86,202.59	
	GULF BANK	107,146	0.22	24,429.28	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	443,151	0.72	323,057.07	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	660,861	0.82	547,192.90	
	MABANEE CO KPSC	67,003	0.75	50,587.26	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.60	129,000.00	
	クウェートディナール 小計	1,753,118		1,301,062.01 (470,932,405)	
香港・オフショ ア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	5.32	483,588.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	20.02	400,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	4.44	444,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	12.04	461,132.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	10.14	890,292.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	14.89	911,268.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.25	862,575.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	50.24	1,479,065.60	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	9.03	349,461.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	18,150	57.06	1,035,639.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	21.62	1,154,508.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	106.42	851,360.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5,000	26.68	133,400.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	30.50	1,131,550.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	23.30	233,000.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.68	774,480.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	5.95	357,000.00	

JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	10.17	392,256.90
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	22.56	685,824.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	15,300	36.54	559,062.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.50	550,250.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	32,300	29.25	944,775.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	20.82	150,986.64
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	13,800	41.48	572,424.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	5,100	47.46	242,046.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	77.84	435,904.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	71.61	429,660.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	14.25	58,425.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	23.90	234,220.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.09	561,498.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	106.62	1,865,850.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	61.09	563,249.80
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	129.73	1,349,192.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	79.99	455,943.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	14.14	333,704.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	9.33	317,220.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	38.51	439,014.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	24.19	411,230.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	11,100	61.28	680,208.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	46.11	387,324.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	7.26	701,316.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	110,200	4.19	461,738.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	4.99	1,052,391.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	367.28	4,921,552.00
EAST GROUP CO LTD-A	52,700	6.30	332,010.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	85.17	644,992.41
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	32.05	185,890.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	178.31	1,123,353.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	45.36	616,896.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	81.21	930,341.76
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	29.80	1,448,280.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	3.89	634,848.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	30.31	1,269,989.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	7,100	84.90	602,790.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	82.43	824,300.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	9.25	209,050.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	17.19	742,608.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.19	245,153.09
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	31.17	984,972.00

ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	71.20	588,112.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	20.96	989,102.40
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	44,300	13.28	588,304.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	11.38	911,538.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.05	568,230.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	86.97	956,670.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.40	217,560.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	5.64	601,788.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.18	207,200.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.93	847,539.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	11.59	359,290.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	61.40	1,246,420.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	45.27	240,791.13
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.72	209,568.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	63.37	525,971.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	15.46	337,646.40
BYD CO LTD -A	4,700	143.95	676,565.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	23,820	16.71	398,032.20
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	48.49	897,065.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	25.89	888,027.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.10	471,730.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	19.94	849,444.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	10,200	163.99	1,672,698.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	79.90	487,549.80
MIDEA GROUP CO LTD-A	11,600	75.08	870,928.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	14.15	469,780.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	163.73	1,260,721.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	31.00	806,000.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	3,000	28.20	84,600.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	8.50	867,000.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	78.25	626,000.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	9.05	717,665.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	19.45	651,186.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	12.10	648,560.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	12.67	215,390.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	10.51	1,465,094.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	64.98	1,059,174.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	7.93	130,845.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	8.87	730,533.20
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	20.40	465,120.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	21.87	535,815.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	6.51	400,365.00



CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	288.00	3,513,600.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	22.42	381,140.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	6.76	309,608.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	12,900	71.68	924,672.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	52.67	452,962.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,800	82.00	639,600.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	5.31	215,055.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	58.30	623,810.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	206.45	330,320.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	56.70	124,740.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	8.15	484,925.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	46.18	475,654.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	51.22	512,200.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	153.20	1,210,280.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	38.50	177,100.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	14,160	159.09	2,252,714.40
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	3,000	223.12	669,360.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	25.87	708,838.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	81.81	1,390,770.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	35.79	42,948.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	38.61	1,324,400.22
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	51.74	895,102.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	186.10	1,693,510.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	14.23	394,171.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	44.32	509,680.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	84.90	594,300.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,903.00	14,462,800.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	237.40	2,326,520.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	23,970	106.09	2,542,977.30
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	15.75	422,100.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	14,000	30.13	421,820.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	401.22	2,688,174.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	36.00	1,137,600.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	14.17	540,727.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	272.10	5,768,520.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	73.90	746,390.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	17.28	91,584.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	33.19	985,743.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,914	69.29	1,241,261.06
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5,000	110.93	554,650.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	133.12	377,794.56
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	43.58	423,597.60

INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	5,250	147.00	771,750.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	92.00	1,136,200.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	29.95	539,100.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	16.77	174,408.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	29.95	443,260.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	11.81	293,360.40
OVCTEK CHINA INC-A	5,150	111.72	575,358.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	426.01	2,257,853.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	305.80	611,600.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	14.55	550,426.50
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	307.06	61,412.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	33.25	778,050.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	116.32	639,760.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	466.00	1,025,200.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	15,300	20.21	309,213.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	24.91	254,082.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	200.85	1,988,415.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	33.37	740,580.41
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.99	479,840.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	145.33	1,162,640.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	38.25	721,012.50
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	31,752	79.99	2,539,842.48
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	16,380	42.80	701,064.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.61	487,801.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	173.58	1,180,344.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	34.23	239,610.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	20.77	233,288.64
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	103,300	4.27	441,091.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	12.76	248,820.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	55.71	947,070.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	13,720	143.09	1,963,194.80
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	16.95	442,395.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	102.00	724,200.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	330.61	1,289,379.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	19.97	180,129.40
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,200	38.75	937,750.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	65.54	635,738.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.25	1,149,200.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.84	280,720.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.93	487,577.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	7.08	531,991.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	9.43	476,215.00

BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	42.87	1,028,880.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.25	375,375.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.87	858,063.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.79	488,531.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	54.18	5,683,482.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	4.68	1,280,448.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.99	1,231,314.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.28	749,832.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.22	1,363,464.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	22.65	2,156,280.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	24.05	2,871,570.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.15	728,725.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.03	1,387,149.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	3.85	471,625.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	10.01	441,441.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	7.12	141,688.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	9.64	450,188.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	18.21	521,898.60
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	23.44	1,012,608.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	26.57	640,337.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	34,900	30.19	1,053,631.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.45	52,020.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.27	377,454.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	8.96	741,888.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.77	895,062.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	104.50	564,300.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	6.08	263,872.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	15.84	498,960.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	9.00	791,100.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	8.40	358,680.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	8.76	277,692.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	45,800	12.64	578,912.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.51	934,472.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.54	517,560.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	4.74	448,404.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	11.13	486,381.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	32.27	587,314.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	70.10	4,682,680.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	5.29	96,278.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	11.59	633,973.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	28.00	1,503,600.00
GEMDALE CORP-A	45,500	11.40	518,700.00

GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	5.91	695,016.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	6.97	490,409.20
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	13.91	1,137,838.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	44.10	564,480.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	16.84	143,140.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	140,000	3.15	441,000.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	12.49	335,981.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	28.70	387,450.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	14.26	410,688.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	43.57	291,919.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.87	382,659.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	87.00	791,700.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	48.72	526,176.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	256.17	768,510.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	4,700	63.38	297,886.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	125.50	690,250.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	32.30	425,391.00
ADDSINO CO LTD -A	5,800	16.95	98,310.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	67.90	909,860.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	6.61	757,506.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	39.49	1,105,720.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	11.32	393,936.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	17.44	362,752.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	13.45	606,595.00
GOERTEK INC -A	26,900	34.35	924,015.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	8.14	407,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	126.33	884,310.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	26.26	517,637.12
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	24.99	419,832.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	34.70	1,611,815.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	371.10	400,788.00
NINESTAR CORP-A	18,543	24.30	450,594.90
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	8.26	258,538.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	24.06	584,658.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	77.88	370,708.80
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	16.84	395,740.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	26.70	357,780.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	16.29	464,265.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	13.47	633,090.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	17.83	327,002.20
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	15.78	44,184.00
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	43,600	8.90	388,040.00

WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	82.00	344,400.00		
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	21,080	32.75	690,370.00		
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	69.60	783,000.00		
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	22.49	681,447.00		
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	33.74	293,538.00		
ZTE CORP-A	12,600	28.14	354,564.00		
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	5.36	931,568.00		
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	19.76	2,647,840.00		
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.12	684,112.00		
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.74	861,000.00		
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.18	262,350.00		
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,480	177.95	797,216.00		
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	33.03	247,725.00		
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	34.63	1,031,974.00		
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	24,000	96.73	2,321,520.00		
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	162.30	503,130.00		
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	23.98	973,588.00		
SG MICRO CORP-A	1,400	235.96	330,344.00		
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	120.86	314,236.00		
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	26.70	787,650.00		
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	12.31	403,152.50		
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	20.13	452,240.58		
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	121.50	595,350.00		
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	264.26	1,427,004.00		
香港・オフショア人民元 小計	12,052,115		239,382,052.90 (4,052,235,453)		
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	21.24	500,393.16	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	218,286	35.70	7,792,810.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	80.20	786,280.80	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	18.90	603,439.20	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,868	101.80	1,920,762.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	27.00	871,641.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	55.10	2,478,618.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	91,645	119.80	10,979,071.00	
	SAUDI CEMENT	7,489	64.60	483,789.40	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	35.55	748,647.45	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	17.32	1,145,094.48	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	70.80	1,880,164.80	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	78.70	348,798.40	
	JARIR MARKETING CO	7,199	203.00	1,461,397.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	129.00	480,525.00	
	ALMARAI CO	30,130	54.40	1,639,072.00	

SAVOLA	25,336	39.80	1,008,372.80	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,778	149.60	415,588.80	
AL RAJHI BANK	124,491	99.20	12,349,507.20	
ALINMA BANK	109,956	19.18	2,108,956.08	
ARAB NATIONAL BANK	57,638	21.80	1,256,508.40	
BANK AL-JAZIRA	35,813	18.14	649,647.82	
BANK ALBILAD	45,859	36.35	1,666,974.65	
BANQUE SAUDI FRANSI	48,656	36.20	1,761,347.20	
RIYAD BANK	138,943	24.30	3,376,314.90	
SAUDI BRITISH BANK	71,793	28.90	2,074,817.70	
THE SAUDI NATIONAL BANK	223,924	54.00	12,091,896.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	112.00	679,056.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	77.60	513,168.80	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	10.58	498,233.36	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	10.68	493,277.16	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	31.55	1,085,761.70	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	14.54	390,995.14	
SAUDI TELECOM CO	60,999	121.00	7,380,879.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	23.64	2,180,104.44	
サウジアラビアリアル 小計	1,843,728		86,101,911.84 (2,500,399,519)	
合 計	249,552,917		89,273,195,822 (89,273,195,822)	

## (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	5,482,592.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	5,482,592.00 (29,948,658)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	2,842,260.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	10,500	2,204,790.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,793,772.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	734,580.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,802,340.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	29,129	1,007,572.11	
	ブラジルリアル 小計	192,029	10,385,314.11 (215,642,739)		
	投資信託受益証券合計			250,429	245,591,397 (245,591,397)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	7,444,776.00	

メキシコペソ 小計		308,400	7,444,776.00 (40,667,088)	
南アフリカ ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	4,230,973.98	
南アフリカランド 小計		295,047	4,230,973.98 (32,747,738)	
投資証券合計		603,447	73,414,826 (73,414,826)	
合計			319,006,223 (319,006,223)	

(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 64銘柄	100.0%			14.5%
メキシコペソ	株式 22銘柄	95.7%			1.8%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.5%	0.0%
ブラジルレアル	株式 47銘柄	95.0%			4.6%
	投資信託受 益証券 6銘柄		5.0%		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%			0.1%
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%			0.3%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%			0.7%
香港ドル	株式 202銘柄	100.0%			21.0%
マレーシアリングギット	株式 38銘柄	100.0%			1.3%
タイバーツ	株式 44銘柄	100.0%			1.8%
フィリピンペソ	株式 20銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%			1.2%
韓国ウォン	株式 105銘柄	100.0%			13.6%

新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			14.4%
インドルピー	株式	96銘柄	100.0%			9.6%
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	99.1%			3.9%
	投資証券	1銘柄			0.9%	0.0%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	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	293銘柄	100.0%			4.5%
サウジアラビアリアル	株式	35銘柄	100.0%			2.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	336,183,028
国債証券	522,555,617,300
地方債証券	33,331,005,386
特殊債証券	40,987,415,370
社債証券	26,664,549,340
未収入金	594,689,600
未収利息	1,041,282,546
前払費用	24,391,574
流動資産合計	625,535,134,144
資産合計	625,535,134,144
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	595,764,091
未払利息	260
流動負債合計	595,764,351
負債合計	595,764,351
<b>純資産の部</b>	
元本等	



	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
元本	443,635,763,178
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	181,303,606,615
元本等合計	624,939,369,793
純資産合計	624,939,369,793
負債純資産合計	625,535,134,144

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日まで個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	443,635,763,178口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,066,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4087円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,087円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	421,545,977,936円
期中追加設定元本額	30,388,071,981円
期中一部解約元本額	8,298,286,739円
期末元本額	443,635,763,178円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,674,159,226円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,028,329円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,355,458,999円
世界経済インデックスファンド	2,373,952,241円
D C マイセレクション 2 5	24,149,129,788円
D C マイセレクション 5 0	27,453,189,528円
D C マイセレクション 7 5	7,950,061,633円
D C 日本債券インデックス・オープン	438,357,736円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,374,722,510円
D C 日本債券インデックス・オープン P	69,071,069,960円
D C マイセレクション S 2 5	10,679,409,626円
D C マイセレクション S 5 0	11,992,135,215円
D C マイセレクション S 7 5	2,535,133,255円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	961,704,830円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,807,634,330円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	657,419,045円
D C 世界経済インデックスファンド	2,880,551,255円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,066,388円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,665,478円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	40,798,833円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,186,019円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,015,770円

区分	2021年 5月10日現在
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	135,459,099円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	191,715,196円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	38,807,907円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	35,911,181円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,544,821,428円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	834,051,112円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,521,685,068円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	507,022,511円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	83,726,323円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,114,570,772円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,276,293,509円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,541,920,744円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	147,812,794円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,023,231,385円
日本債券ファンド・シリーズ1	14,121,360,868円
分散投資コア戦略ファンドA	26,048,364,855円
分散投資コア戦略ファンドS	26,332,440,005円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	117,474,476円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,128,773,424円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	52,562,398円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,390,842円
SMT インデックスバランス・オープン	53,145,886円
SMT 世界経済インデックス・オープン	22,508,809円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	38,947,816円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	57,975,705円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,168,151円
グローバル経済コア	194,681,250円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,898,657円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,690,534円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	972,466円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	693,281円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	204,759円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	214,790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）	76,919,465,914円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	44,722,029円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,319,546,150

地方債証券	151,266,144
特殊債券	215,961,487
社債券	69,055,200
合計	5,617,718,581

(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4 1 3 回利付国債(2年)	1,640,000,000	1,643,985,200	
	第4 1 4 回利付国債(2年)	2,360,000,000	2,366,442,800	
	第4 1 5 回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,063,116,400	
	第4 1 6 回利付国債(2年)	4,670,000,000	4,684,663,800	
	第4 1 7 回利付国債(2年)	4,240,000,000	4,254,161,600	
	第4 1 8 回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,043,692,000	
	第4 1 9 回利付国債(2年)	660,000,000	662,468,400	
	第4 2 0 回利付国債(2年)	1,250,000,000	1,254,837,500	
	第4 2 1 回利付国債(2年)	590,000,000	592,401,300	
	第4 2 2 回利付国債(2年)	130,000,000	130,575,900	
	第4 2 3 回利付国債(2年)	370,000,000	371,013,800	
	第1 3 2 回利付国債(5年)	4,770,000,000	4,781,925,000	
	第1 3 3 回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,393,402,800	
	第1 3 4 回利付国債(5年)	5,700,000,000	5,721,147,000	
	第1 3 5 回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,097,829,600	
	第1 3 6 回利付国債(5年)	4,400,000,000	4,421,868,000	
	第1 3 7 回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,798,396,800	
	第1 3 8 回利付国債(5年)	7,050,000,000	7,095,261,000	
	第1 3 9 回利付国債(5年)	6,070,000,000	6,112,672,100	
	第1 4 0 回利付国債(5年)	7,300,000,000	7,354,677,000	

第141回利付国債(5年)	7,790,000,000	7,851,774,700	
第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,424,869,200	
第143回利付国債(5年)	3,300,000,000	3,329,403,000	
第144回利付国債(5年)	6,620,000,000	6,682,890,000	
第145回利付国債(5年)	8,240,000,000	8,321,246,400	
第146回利付国債(5年)	2,460,000,000	2,483,935,800	
第147回利付国債(5年)	540,000,000	542,764,800	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	579,948,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,589,989,100	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	777,947,500	
第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,705,596,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,471,517,500	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,707,211,800	
第7回利付国債(40年)	1,040,000,000	1,357,709,600	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,502,666,400	
第9回利付国債(40年)	1,220,000,000	1,119,008,400	
第10回利付国債(40年)	2,370,000,000	2,545,996,200	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,867,059,500	
第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,612,461,600	
第13回利付国債(40年)	2,250,000,000	2,119,005,000	
第323回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,951,963,400	
第324回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,768,139,800	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,956,821,200	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,161,527,200	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,237,626,700	
第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,446,206,000	
第329回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,273,493,800	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,942,313,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	915,777,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,893,072,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,094,751,100	
第334回利付国債(10年)	5,030,000,000	5,146,243,300	
第335回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,502,528,000	
第336回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,073,992,500	
第337回利付国債(10年)	2,850,000,000	2,894,460,000	
第338回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,122,852,400	
第339回利付国債(10年)	4,850,000,000	4,956,166,500	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,465,486,400	
第341回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,201,536,800	
第342回利付国債(10年)	5,380,000,000	5,432,508,800	
第343回利付国債(10年)	4,820,000,000	4,866,995,000	
第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,706,134,400	

第345回利付国債(10年)	3,340,000,000	3,373,867,600	
第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	6,415,341,500	
第347回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,920,468,400	
第348回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,931,435,200	
第349回利付国債(10年)	4,130,000,000	4,173,819,300	
第350回利付国債(10年)	8,060,000,000	8,145,919,600	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,656,007,800	
第352回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,937,401,000	
第353回利付国債(10年)	4,300,000,000	4,339,302,000	
第354回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,791,087,500	
第355回利付国債(10年)	4,270,000,000	4,304,587,000	
第356回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,866,273,300	
第357回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,688,342,900	
第358回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,813,422,200	
第359回利付国債(10年)	3,230,000,000	3,246,085,400	
第360回利付国債(10年)	6,550,000,000	6,577,444,500	
第361回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,753,556,400	
第362回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,033,958,500	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	135,526,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	193,292,800	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	144,451,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	139,664,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	60,541,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	433,870,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	222,816,600	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	416,185,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	274,548,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	177,604,800	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	307,746,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	234,680,400	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	490,372,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	1,023,824,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	441,024,200	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	260,202,000	
第17回利付国債(30年)	770,000,000	994,455,000	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	442,093,350	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	680,859,200	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	631,920,000	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	645,850,000	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	529,684,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	570,863,700	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	505,734,400	

第25回利付国債(30年)	350,000,000	456,428,000
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,508,094,600
第27回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,381,021,700
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,893,108,800
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,239,486,700
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,354,046,900
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,448,590,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,090,727,600
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,347,490,600
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,391,568,250
第35回利付国債(30年)	2,240,000,000	2,912,044,800
第36回利付国債(30年)	2,030,000,000	2,647,627,500
第37回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,667,919,500
第38回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,908,675,000
第39回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,943,220,000
第40回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,594,462,500
第41回利付国債(30年)	990,000,000	1,243,964,700
第42回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,911,795,200
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,750,037,800
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,537,492,800
第45回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,363,712,000
第46回利付国債(30年)	1,750,000,000	2,132,095,000
第47回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,676,713,500
第48回利付国債(30年)	1,880,000,000	2,249,871,200
第49回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,723,996,800
第50回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,946,977,600
第51回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,702,648,900
第52回利付国債(30年)	1,940,000,000	1,912,025,200
第53回利付国債(30年)	880,000,000	886,890,400
第54回利付国債(30年)	2,110,000,000	2,226,894,000
第55回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,624,176,400
第56回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,770,568,800
第57回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,632,367,000
第58回利付国債(30年)	2,000,000,000	2,104,680,000
第59回利付国債(30年)	620,000,000	636,678,000
第60回利付国債(30年)	2,700,000,000	2,904,012,000
第61回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,699,308,800
第62回利付国債(30年)	20,000,000	19,429,800
第63回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,094,970,400
第64回利付国債(30年)	2,600,000,000	2,450,188,000
第65回利付国債(30年)	860,000,000	809,105,200
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	967,427,500
第67回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,396,153,800



第68回利付国債(30年)	1,970,000,000	1,948,113,300	
第69回利付国債(30年)	840,000,000	852,541,200	
第70回利付国債(30年)	180,000,000	182,476,800	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	153,541,500	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	245,400,000	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	308,286,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	205,890,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	358,613,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	245,049,600	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	326,294,400	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	208,164,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	335,427,200	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	231,730,400	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	346,731,000	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	137,588,100	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	202,726,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	415,002,900	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	431,664,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	214,582,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	677,546,100	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	387,817,200	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	216,180,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	141,211,200	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	291,192,300	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	313,884,400	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	184,218,800	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	293,697,900	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	240,220,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	426,250,500	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	658,398,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	319,701,800	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	515,956,600	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	321,061,900	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	234,542,700	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	611,594,500	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	471,525,600	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	391,142,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	707,534,100	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	507,807,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	988,125,600	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	460,052,800	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	688,055,600	

第95回利付国債(20年)	610,000,000	698,700,100
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,801,692,600
第97回利付国債(20年)	400,000,000	457,872,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	500,852,000
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,474,934,400
第100回利付国債(20年)	480,000,000	554,505,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	835,820,700
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,479,189,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	466,732,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	184,411,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,365,437,000
第106回利付国債(20年)	380,000,000	442,517,600
第107回利付国債(20年)	260,000,000	302,013,400
第108回利付国債(20年)	660,000,000	756,591,000
第109回利付国債(20年)	520,000,000	598,098,800
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,282,512,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,143,057,700
第112回利付国債(20年)	790,000,000	924,537,000
第113回利付国債(20年)	1,720,000,000	2,020,329,200
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,746,604,000
第115回利付国債(20年)	700,000,000	831,173,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,775,618,100
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,277,488,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	777,407,400
第119回利付国債(20年)	530,000,000	614,662,200
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,792,296,300
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,758,570,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,093,276,400
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,233,453,200
第124回利付国債(20年)	610,000,000	722,734,100
第125回利付国債(20年)	820,000,000	990,502,600
第126回利付国債(20年)	730,000,000	867,502,800
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,202,141,400
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,146,462,400
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,042,991,000
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,509,797,900
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,164,680,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,354,149,200
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,448,780,100
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,334,179,700
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,205,058,800
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,680,898,000
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,278,101,300

第138回利付国債(20年)	620,000,000	713,409,200	
第139回利付国債(20年)	730,000,000	847,982,600	
第140回利付国債(20年)	2,200,000,000	2,586,716,000	
第141回利付国債(20年)	1,780,000,000	2,097,249,400	
第142回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,237,236,000	
第143回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,694,934,000	
第144回利付国債(20年)	1,440,000,000	1,666,468,800	
第145回利付国債(20年)	2,595,000,000	3,071,545,800	
第146回利付国債(20年)	2,780,000,000	3,296,941,000	
第147回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,528,013,000	
第148回利付国債(20年)	2,230,000,000	2,599,912,400	
第149回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,339,221,600	
第150回利付国債(20年)	3,260,000,000	3,769,081,600	
第151回利付国債(20年)	1,495,000,000	1,690,845,000	
第152回利付国債(20年)	3,290,000,000	3,723,556,200	
第153回利付国債(20年)	2,570,000,000	2,945,785,400	
第154回利付国債(20年)	2,720,000,000	3,082,494,400	
第155回利付国債(20年)	2,800,000,000	3,096,016,000	
第156回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,648,256,000	
第157回利付国債(20年)	2,780,000,000	2,745,750,400	
第158回利付国債(20年)	1,920,000,000	1,979,289,600	
第159回利付国債(20年)	2,930,000,000	3,063,344,300	
第160回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,628,155,200	
第161回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,889,078,900	
第162回利付国債(20年)	520,000,000	542,214,400	
第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,718,810,900	
第164回利付国債(20年)	1,710,000,000	1,752,219,900	
第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,678,343,200	
第166回利付国債(20年)	900,000,000	949,995,000	
第167回利付国債(20年)	2,770,000,000	2,827,172,800	
第168回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,436,075,000	
第169回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,661,455,900	
第170回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,315,655,600	
第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,263,271,200	
第172回利付国債(20年)	2,850,000,000	2,837,545,500	
第173回利付国債(20年)	3,250,000,000	3,229,915,000	
第174回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,402,721,200	
第175回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,202,887,700	
第176回利付国債(20年)	720,000,000	727,221,600	
国債証券合計	488,910,000,000	522,555,617,300	
地方債証券			
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,431,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,650,000	

第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,596,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	131,217,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,483,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,568,000	
第16回東京都公募公債(20年)	300,000,000	343,539,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,118,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,382,000	
第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	100,253,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,464,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,066,000	
第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	200,000,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	101,227,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	101,153,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	101,816,000	
第726回東京都公募公債	200,000,000	203,768,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	101,675,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,659,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,904,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,699,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	301,695,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	199,232,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,408,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,959,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,322,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,010,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	201,350,000	
第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	101,649,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	271,190,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,093,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	233,784,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,363,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,402,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,150,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,852,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,817,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,699,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	199,146,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	233,514,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	233,594,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	116,722,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,020,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,098,000	

第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,877,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,755,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,762,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,462,810	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,187,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,150,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,541,320	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,488,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	500,000,000	503,295,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,727,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,287,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	116,436,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,867,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,230,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	99,378,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	103,591,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,377,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	114,518,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,106,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	435,948,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,715,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,685,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	471,528,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	201,850,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,819,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,648,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	102,350,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	300,387,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	120,793,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	103,914,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,655,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,296,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,246,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,760,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,881,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,949,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,055,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	117,589,000	
	150,000,000	152,142,000	

平成24年度第18回愛知県公募公債(10年)			
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,184,000	
平成25年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,110,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,948,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,745,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,153,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,918,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	309,342,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,782,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	102,815,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,306,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,000,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	116,554,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	233,866,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,243,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,881,119	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,661,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	114,324,000	
第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	115,587,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	231,936,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	107,428,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	235,364,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	200,340,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	233,784,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	198,944,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,441,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,858,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,123,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,241,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,120,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,761,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,477,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,859,000	
	100,000,000	107,523,000	

平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)			
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,194,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,946,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	131,765,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,642,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,100,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	102,815,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,444,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	300,405,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	231,936,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,049,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,655,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,903,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,568,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,167,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,241,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,853,200	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	298,695,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	100,000,000	100,342,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	100,902,000	
第112回共同発行市場公募地方債	220,000,000	222,204,400	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,964,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,221,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,300,000	
第119回共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,668,000	
第121回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,097,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,716,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,649,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,654,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,072,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,817,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,610,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,927,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,827,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,741,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,104,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,366,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,264,136	

第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,208,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,438,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,346,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,306,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,102,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,420,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,972,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,711,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,097,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,464,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,285,101	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,964,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,244,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	202,312,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債(5年)	100,000,000	99,999,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,009,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	235,164,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	299,442,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	104,135,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	130,020,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	134,703,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	115,010,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	125,595,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,185,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,995,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	300,402,000	
平成24年度第2回京都市公募公債	122,500,000	123,840,150	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,146,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	101,459,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,424,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	135,297,600	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	232,246,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	118,241,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	116,939,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	99,116,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,880,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	349,944,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,682,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,077,000	



平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,852,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,010,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	228,404,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	300,402,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	108,259,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,276,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,499,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	115,786,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,586,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,542,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,136,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,295,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	116,862,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	115,539,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	203,654,000	
平成30年度第5回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,092,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,511,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	152,767,500	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,598,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,647,850	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	171,897,200	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	549,279,500	
令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	200,088,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	199,130,000	
平成24年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	101,254,000	
平成24年度第2回岡山県公募公債（10年）	150,000,000	151,894,500	
平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	200,000,000	202,882,000	
平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,342,000	
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	114,276,000	
地方債証券合計	31,609,430,000	33,331,005,386	
特殊債券			
第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,907,400	
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	415,170,100	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	313,896,000	
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,391,000	
第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,949,000	

第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	96,116,000	
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,038,000	
第14回道路債券	100,000,000	103,067,000	
第17回道路債券	100,000,000	102,470,000	
第21回道路債券	100,000,000	129,163,000	
第27回道路債券	400,000,000	427,456,000	
第28回道路債券	200,000,000	262,134,000	
第33回道路債券	200,000,000	266,022,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,505,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,765,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,222,000	
第42回道路債券	100,000,000	108,426,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,860,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,187,000	
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	233,460,000	
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	117,871,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,829,000	
第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,440,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	911,799,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,912,000	
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	131,394,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,256,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,698,000	
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	118,798,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,229,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,610,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,064,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,716,000	
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	101,036,000	
	100,000,000	101,068,000	

第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	303,675,000	
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	116,403,000	
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	101,468,000	
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	304,494,000	
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	202,530,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	615,930,000	
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	305,300,860	
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	635,755,800	
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	203,754,000	
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	150,814,960	
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	101,721,000	
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	270,321,258	
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	203,632,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,171,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	422,000,000	430,558,160	
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	101,849,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	230,450,000	
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	104,014,500	
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	101,986,000	
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	101,905,000	
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	229,100,000	
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	101,830,000	
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	101,637,000	
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	303,405,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,548,000	
	200,000,000	224,724,000	

第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,928,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,648,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,680,000	
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	106,940,080	
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	317,153,400	
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	206,113,150	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,676,000	
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	201,310,000	
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	100,755,000	
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	121,220,400	
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	201,350,000	
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	309,966,000	
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	216,443,880	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	376,890,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	213,996,300	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	107,989,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	392,817,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,247,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	131,464,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	42,556,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	129,499,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	233,692,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	195,328,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	233,412,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,086,000	
第37回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,862,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	505,015,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,229,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,884,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,682,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,473,000	

第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,530,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,083,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,210,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,879,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,760,850	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,640,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,824,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,073,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,331,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,727,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,719,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,244,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,803,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,693,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,048,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,000,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,391,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,540,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,634,010	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,903,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,771,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,749,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,113,200	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,249,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,680,120	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,137,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,151,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,513,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,946,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,963,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,013,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	108,167,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,944,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,886,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,181,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,978,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,060,480	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,772,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,732,900	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,038,300	
第85回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,964,000	

第 8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,896,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	211,198,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	171,756,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	94,242,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,845,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	102,928,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,468,800	
第 5 9 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,986,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,614,000	11,897,613	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,973,000	12,294,355	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,220,000	12,587,088	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	170,388,000	170,278,951	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	121,776,000	121,778,435	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,037,000	12,336,841	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,964,000	13,392,719	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	219,867,000	219,273,359	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,412,000	10,483,218	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	21,718,000	22,056,583	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,853,000	13,269,951	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	239,190,000	238,245,199	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	85,152,000	85,079,620	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,487,000	11,742,930	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,445,000	13,937,624	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	277,119,000	276,742,118	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,519,000	11,776,910	
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	191,114,000	190,991,687	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,492,000	14,002,267	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,351,000	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,727,000	18,821,819	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,079,000	19,280,168	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,103,000	21,552,024	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,975,000	23,406,451	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,025,000	25,748,313	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,731,000	26,456,976	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,036,000	56,648,812	

第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,727,000	11,973,736	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,116,000	25,526,062	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,871,000	12,127,651	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,635,000	11,944,025	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,284,000	26,790,673	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,835,000	11,007,059	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,463,000	27,062,331	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,570,000	26,038,794	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,799,000	13,311,343	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,836,000	55,777,908	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,334,000	29,937,137	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,608,000	13,048,397	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,124,000	40,285,630	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,086,000	38,068,925	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,943,000	37,947,541	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,650,000	82,850,696	
第61回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,288,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,325,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,012,000	89,871,358	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,793,000	45,710,257	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,048,000	46,352,150	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,455,000	46,839,566	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,448,000	40,343,486	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,348,000	39,953,630	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,052,000	46,449,750	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	177,603,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,438,000	122,341,036	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,420,000	165,035,619	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,774,000	46,568,094	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,185,000	48,070,271	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,920,000	48,701,083	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,842,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,076,000	154,702,128	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,949,000	52,690,436	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,012,000	109,960,180	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,449,000	61,293,702	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,247,000	65,016,018	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,965,000	65,043,474	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,613,000	201,838,980	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,992,000	135,714,261	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,697,000	65,877,348	
	68,722,000	71,133,454	

第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第107回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	403,732,000	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,782,000	75,085,614	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,920,000	80,437,082	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,777,000	80,123,232	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,101,000	80,789,868	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,443,000	81,491,976	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,184,000	82,120,863	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,887,000	83,818,649	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,619,000	84,657,547	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,142,000	83,948,477	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,565,000	84,371,402	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,074,000	84,932,395	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,582,000	170,952,222	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,134,000	84,936,638	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,258,000	173,318,233	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,536,000	86,392,215	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,114,000	172,556,491	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,396,000	87,271,191	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,142,000	175,502,049	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,894,000	176,245,930	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	129,727,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,538,000	89,714,670	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,771,000	90,138,073	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,785,000	89,416,261	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,280,000	181,802,086	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,679,000	90,854,010	
	90,658,000	90,963,517	



第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,760,000	183,059,726	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,456,000	91,904,962	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	278,994,000	275,919,486	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,094,000	184,996,676	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,910,000	95,264,963	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,465,000	95,517,505	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,232,000	196,356,536	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,274,000	98,672,992	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,188,000	197,957,033	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,600,000	198,011,008	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,077,000	99,536,717	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,976,000	200,734,947	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,556,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,025,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,573,000	
第294回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,043,000	
第59回日本学生支援債券	200,000,000	199,978,000	
第60回日本学生支援債券	200,000,000	199,974,000	
第62回日本学生支援債券	100,000,000	99,984,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	108,256,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,688,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,374,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,928,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,872,000	
い第843号商工債	200,000,000	200,256,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,131,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,129,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,270,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,153,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,111,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,760,000	
第236号商工債（3年）	300,000,000	299,958,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	300,093,000	

	第2回信中金債(10年)	100,000,000	102,076,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,306,000	
	第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,678,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,578,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,428,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,770,000	
	第74回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,022,000	
	第73回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,038,000	
	第88回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,950,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,260,000	
	第28回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,288,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,572,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,921,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	198,924,000	
	第141回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,972,000	
	特殊債券合計	39,448,599,000	40,987,415,370	
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	100,342,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	299,652,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,109,000	
	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	100,586,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,203,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,196,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,904,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,936,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,191,000	
	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	399,692,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,906,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,896,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,147,000	
	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	199,432,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
	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	100,209,000	

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	199,894,000	
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	100,425,000	
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	199,948,000	
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	101,726,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,097,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,297,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,030,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,159,000	
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	101,961,000	
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	99,847,000	
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	100,453,000	
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	200,894,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,081,000	
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	100,908,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,737,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,343,000	
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	100,688,000	
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	199,914,000	
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	200,634,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,628,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,716,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,736,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,156,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,380,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	100,027,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,324,000	
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	199,906,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,639,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,071,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,308,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,809,000	

第28回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,367,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,345,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,061,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,970,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,357,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,198,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,851,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,515,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,618,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,995,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,241,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,709,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,740,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,030,000	
第11回JA三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,206,000	
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	100,134,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,964,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,436,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,544,000	
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	100,150,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,986,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,944,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,110,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,111,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,623,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,626,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,560,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,444,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,030,000	
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	100,066,000	
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	118,073,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	112,441,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,244,000	
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	101,407,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,380,000	

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	304,305,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,323,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,252,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,894,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,976,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,708,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,762,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,142,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,965,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,718,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,839,000	
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	199,792,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,267,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,169,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,361,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,936,000	
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	200,576,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,205,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,984,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,503,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,437,000	
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	99,134,000	
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	200,086,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,644,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,972,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,266,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,202,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,095,000	
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	101,909,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,173,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,718,000	

第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,714,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,586,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,640,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,620,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,390,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,630,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,095,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,066,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,489,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	232,882,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,740,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,795,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,595,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,527,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,154,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,363,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,365,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,499,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,706,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	501,465,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,570,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,401,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,936,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,379,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,958,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,785,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	194,152,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,883,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,046,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,722,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,206,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,924,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,293,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,335,000	

第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,268,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,311,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,440,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,242,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,095,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,669,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,790,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,281,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,610,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,409,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,849,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,614,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,398,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,666,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,656,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,181,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	201,242,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,665,340	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,924,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,975,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,579,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,460,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,952,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,034,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,924,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,884,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,956,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,324,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,248,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,054,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,007,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,557,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,046,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,892,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,391,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,867,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,270,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,764,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	204,420,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	404,424,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,863,000	

第4 1 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,369,000	
第4 2 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,893,000	
第4 4 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,083,000	
第4 5 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,213,000	
第6 4 回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,419,000	
第6 5 回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,182,000	
第2 7 回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,675,000	
第6 回 S C S K 株式会社無担保社債	100,000,000	99,957,000	
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	100,712,000	
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	202,762,000	
社債券合計	26,326,000,000	26,664,549,340	
合計		623,538,587,396	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,238,364,651
コール・ローン	3,303,117,503
国債証券	294,306,290,777
派生商品評価勘定	35,395,355
未収入金	5,920,298,908
未収利息	1,834,340,720
前払費用	57,734,398
差入委託証拠金	425,595,765
流動資産合計	307,121,138,077
資産合計	307,121,138,077
負債の部	
流動負債	



	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	6,569,830
前受金	1,893,876
未払金	6,953,280,296
未払解約金	226,718,670
未払利息	2,558
流動負債合計	7,188,465,230
負債合計	7,188,465,230
純資産の部	
元本等	
元本	98,661,509,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	201,271,163,568
元本等合計	299,932,672,847
純資産合計	299,932,672,847
負債純資産合計	307,121,138,077

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2021年 5月10日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	98,661,509,279口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 3.0400円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (30,400円)</p>

（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 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 5月10日現在
期首	2020年11月11日
期首元本額	93,613,991,047円
期中追加設定元本額	9,177,791,976円
期中一部解約元本額	4,130,273,744円
期末元本額	98,661,509,279円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,450,200,894円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	617,077,783円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,046,735,908円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,371,699円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	7,146,966,169円
世界経済インデックスファンド	9,053,593,050円
D C マイセレクション 2 5	1,886,404,453円
D C マイセレクション 5 0	1,594,903,408円
D C マイセレクション 7 5	1,080,423,744円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,113,883,812円
D C マイセレクション S 2 5	830,492,966円
D C マイセレクション S 5 0	662,002,471円
D C マイセレクション S 7 5	346,205,923円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	37,743,908円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	79,893,966円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	40,438,684円
D C 世界経済インデックスファンド	11,042,223,425円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	672,086,611円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	3,925,757円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,388,520円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,529,048円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	30,705,008円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	71,223,680円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	106,862,002円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	90,036,269円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	95,223,196円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,630,219,594円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	489,585,124円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,941,568,268円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	490,141,077円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	61,809,375円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	507,355,830円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	192,553,052円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	234,152,090円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	813,587,024円

区分	2021年 5月10日現在
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,256,213,928円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	765,529,114円
外国債券ファンド・シリーズ1	628,687,544円
コア投資戦略ファンド（安定型）	905,750,994円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,367,564,911円
分散投資コア戦略ファンドA	1,148,177,436円
分散投資コア戦略ファンドS	2,349,587,917円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	429,248,945円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,558,704,644円
コア投資戦略ファンド（切替型）	877,927,110円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,908,847円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	100,505,435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）	1,178,174,256円
SMT インデックスバランス・オープン	188,413,055円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	20,873,361,375円
SMT 世界経済インデックス・オープン	170,507,341円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	174,688,010円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	278,813,727円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,165,817円
グローバル経済コア	766,929,857円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,716,556円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	474,156円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	242,417,632円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	25,844,604円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	738,326円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	753,032円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	351,020円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	908,884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）	509,175,396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）	10,494,235,065円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	337,396,905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）	342,715,652円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	187,969,580円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	369,968,658円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	11,025,077,223
合計	11,025,077,223

(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 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,470,939,672	-	3,472,833,548	1,893,876
	合計	3,470,939,672	-	3,472,833,548	1,893,876

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2021年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,190,931,026	-	3,217,770,097	26,839,071
	アメリカドル	1,469,111,279	-	1,470,517,672	1,406,393
	カナダドル	154,095,796	-	158,815,197	4,719,401
	ユーロ	1,328,259,320	-	1,345,734,063	17,474,743
	イギリスポンド	239,464,631	-	242,703,165	3,238,534
	売建	140,421,965	-	140,329,387	92,578
	アメリカドル	95,397,909	-	95,073,623	324,286
	ユーロ	43,749,129	-	43,977,790	228,661
	シンガポールドル	1,054,232	-	1,057,410	3,178
	イスラエルシェケル	220,695	-	220,564	131
	合計	3,331,352,991	-	3,358,099,484	26,931,649

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,968,750.00	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,694,913.30	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,496,777.32	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,048,035.97	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,986,250.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,241,875.00	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,400,625.02	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,994,921.94	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,172,203.12	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,015,625.04	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	986,562.50	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,854,687.50	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,374,609.37	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,534,890.61	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,871,250.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,949,062.48	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,094,765.62	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,630,937.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,958,984.39	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,940,312.52	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,460,898.45	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,822,659.93	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,216,333.61	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,851,455.46	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,389,121.08	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,863,425.79	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,488,162.50	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,200,292.95	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,042,500.00	

T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,692,691.48	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,415,820.32	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,649,218.80	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,258,945.35	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,999,570.34	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,480,128.96	
T 1.125% 02/15/31	11,050,000.00	10,603,683.64	
T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	6,776,696.87	
T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	7,790,203.12	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,161,667.99	
T 1.25% 05/15/50	10,650,000.00	8,319,480.51	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,658,951.16	
T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,298,476.54	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,129,492.20	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	7,984,968.75	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,568,457.02	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,112,500.00	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,090,917.95	
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,383,125.00	
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,343,617.17	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,184,218.78	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,481,120.31	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,992,562.50	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,102,890.64	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,179,687.50	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,683,500.00	
T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,679,794.91	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,817,421.87	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,441,085.97	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,601,855.46	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,364,346.87	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,030,195.31	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,548,974.60	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,866,543.00	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,100,390.65	
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,587,597.65	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,585,441.38	
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,264,956.29	
T 1.625% 11/15/50	8,050,000.00	6,927,402.38	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,120,225.00	
T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,686,906.26	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,761,606.41	



T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,590,341.79
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,864,867.17
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,808,483.61
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,719,922.86
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,133,710.92
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,506,781.25
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,483,962.48
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,268,590.80
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,077,812.50
T 1.875% 02/15/41	3,000,000.00	2,867,343.75
T 1.875% 02/15/51	6,300,000.00	5,764,007.84
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,528,483.40
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,197,753.94
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,469,570.71
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,093,203.12
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,297,187.50
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,725,720.69
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,644,107.44
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,367,152.33
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,794,281.25
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,869,131.06
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,551,687.51
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,839,062.50
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,140,273.46
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,074,500.00
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,468,750.00
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,810,650.00
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,494,874.19
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,218,906.24
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,598,875.00
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,405,507.83
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,159,521.46
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,283,165.62
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,481,953.12
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,700,148.46
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,800,630.83
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,712,640.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,187,890.62
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,739,414.08
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,949,281.29
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,193,750.00
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,100,875.01
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,804,648.44

T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,604,121.14	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,614,504.68	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,328,906.25	
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	7,683,398.47	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,682,944.14	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,377,148.45	
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,368,995.31	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,193,125.00	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,230,826.18	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,423,683.57	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,293,425.80	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,788,875.00	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,108,252.74	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	10,932,806.25	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,462,945.31	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,841,894.56	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,158,207.01	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,720,390.62	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,335,842.95	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,207,421.89	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,220,351.56	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,784,710.92	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,086,579.69	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,991,562.50	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,057,265.63	
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,431,117.19	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,439,585.93	
T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	7,943,261.70	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,528,546.87	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,510,628.15	
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,101,118.75	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,353,808.60	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,370,625.00	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,066,540.62	
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,655,132.81	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,290,183.62	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,178,125.00	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,981,472.64	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	9,917,925.00	
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	4,820,367.20	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,054,296.87	
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,664,550.77	

T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,292,606.25
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,243,554.72
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,164,843.75
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,943,145.35
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	4,717,578.15
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,544,907.06
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,480,154.68
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,787,890.62
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,070,371.09
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,299,093.75
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,278,710.90
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,824,417.23
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,058,789.06
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,744,726.56
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,082,695.33
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	6,988,134.37
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	4,832,803.12
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,494,625.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,040,527.35
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,653,622.67
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,539,703.12
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	942,407.81
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,023,812.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,515,625.00
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,545,156.26
T 3.75% 11/15/43	4,500,000.00	5,766,328.12
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,867,554.68
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,217,375.00
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,125,843.75
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,088,281.25
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,855,153.12
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,005,312.50
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,565,161.74
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,284,957.05
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,632,304.69
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,518,945.30
T 3% 11/15/44	4,050,000.00	4,632,820.31
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,206,281.25
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,174,519.54
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,347,734.38
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,600,476.57
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,684,601.56
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,717,734.37

	T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,139,171.10
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	752,167.97
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,348,523.44
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,348,548.44
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,078,007.81
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,571,539.06
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,614,550.78
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,671,109.37
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,636,156.25
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,556,250.00
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,121,812.50
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,909,695.31
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,478,941.41
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,877,390.62
	アメリカドル 小計	1,150,000,000.00	1,193,378,271.89 (129,803,754,633)
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,060,642.60
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,213,469.60
	CAN 0.25% 04/01/24	700,000.00	695,366.00
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,598,024.00
	CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	910,564.20
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,770,654.90
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	3,947,745.90
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,206,314.00
	CAN 1.25% 03/01/25	2,400,000.00	2,458,344.00
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,534,351.20
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,096,803.50
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,401,507.20
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	619,074.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,717,124.60
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,726,747.60
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,526,100.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,417,852.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,915,542.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,354,210.20
	CAN 2.5% 06/01/24	1,300,000.00	1,380,171.00
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,770,117.60
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,166,718.80
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	665,660.80
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,384,119.80
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,475,029.90
	CAN 2% 12/01/51	4,080,000.00	4,026,552.00

	CAN 3.5% 12/01/45	1,480,000.00	1,912,796.40
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,418,098.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,569,133.80
	CAN 5.75% 06/01/33	1,410,000.00	2,033,135.40
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,188,237.40
	カナダドル 小計	65,030,000.00	68,160,208.90 (6,116,015,544)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,783,260.00
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	33,994,512.40
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,980,000.00	45,771,710.60
	MBONO 6.5% 06/09/22	33,080,000.00	33,733,330.00
	MBONO 6.75% 03/09/23	33,850,000.00	35,003,608.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	41,667,940.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	24,180,000.00	26,044,519.80
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,525,757.20
	MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,008,040.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	42,507,581.40
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	28,851,963.60
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	37,145,216.70
	MBONO 8% 11/07/47	23,430,000.00	24,239,037.90
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	37,347,164.80
	メキシコペソ 小計	409,160,000.00	436,623,643.20 (2,385,056,650)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,383,713.70
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	1,000,413.40
	BGB 0.4% 06/22/40	710,000.00	676,026.50
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,680,960.60
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	520,332.80
	BGB 0.8% 06/22/25	2,420,000.00	2,554,092.20
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,807,167.70
	BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,244,012.10
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,554,747.20
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	437,912.00
	BGB 0% 10/22/31	630,000.00	621,337.50
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,682,805.00
	BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	823,780.80
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,611,067.20
	BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,195,170.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,279,509.00
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,448,697.20
	BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,163,051.00
	BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,196,859.00
BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,964,737.00	

BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,060,028.20
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,356,610.80
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,974,648.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,385,741.40
BGB 4.25% 03/28/41	2,400,000.00	4,001,832.00
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,244,186.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,420,189.20
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,533,006.00
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,899,784.00
BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,385,507.00
BKO 0% 06/10/22	900,000.00	906,552.00
BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	5,004,796.50
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,043,073.20
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,647,542.40
BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,871,737.50
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	587,319.60
BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,766,763.00
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,130,168.70
BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,785,102.00
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,216,199.30
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,314,912.50
BTPS 0.9% 04/01/31	2,500,000.00	2,496,550.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,229,194.60
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,045,180.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	951,282.60
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,639,159.40
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,252,032.40
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,454,494.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,004,210.00
BTPS 0% 04/15/24	500,000.00	501,620.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,051,478.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,031,762.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,469,937.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,427,742.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,037,978.90
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,524,560.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,550,358.40
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,025,722.80
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,206,312.20
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,721,762.40
BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,055,107.20
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,384,960.00
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,852,082.50

BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,118,540.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,895,642.00	
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,195,704.80	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,013,287.60	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,504,864.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	691,645.80	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,527,471.20	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,061,480.80	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,029,188.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,470,000.00	1,638,241.50	
BTPS 2.45% 10/01/23	910,000.00	968,176.30	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,264,411.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,213,641.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,943,778.20	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,522,197.60	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,193,439.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,499,503.50	
BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	2,955,072.60	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,266,458.70	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,766,977.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,505,769.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,795,801.40	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,821,211.20	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,874,086.80	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,421,201.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,076,423.20	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,973,334.40	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,108,627.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,510,705.60	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,919,598.80	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,503,608.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,705,714.20	
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,790,269.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,830,130.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,116,782.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,883,928.40	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,507,170.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,746,217.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,654,804.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,354,485.00	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,330,260.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,985,236.30	

BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,983,660.00
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,852,909.40
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,929,844.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	982,496.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,072,713.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,087,495.30
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,291,528.80
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,136,620.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,162,090.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,551,348.90
DBR 0.5% 08/15/27	5,690,000.00	6,059,508.60
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,670,566.90
DBR 0% 02/15/31	800,000.00	817,864.00
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,812,386.00
DBR 0% 05/15/36	620,000.00	612,541.40
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,487,460.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,603,250.00
DBR 0% 08/15/30	5,380,000.00	5,515,414.60
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	689,878.90
DBR 0% 08/15/50	2,720,000.00	2,460,566.40
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,229,292.80
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,458,961.60
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,076,416.80
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,156,081.20
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,444,529.20
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,881,592.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,763,668.50
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,148,979.80
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,112,340.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,916,003.20
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,385,154.20
DBR 2.5% 08/15/46	3,800,000.00	5,887,986.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,038,006.40
DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,248,718.20
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,761,425.80
DBR 4.25% 07/04/39	2,720,000.00	4,773,736.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,521,040.00
DBR 4.75% 07/04/34	3,390,000.00	5,579,262.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,345,388.90
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,457,436.80
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,342,326.40
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,834,946.70
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,980,537.50



DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,413,346.20	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,838,605.20	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,819,860.80	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,325,972.40	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,605,730.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,087,865.00	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	753,479.10	
FRTR 0.5% 06/25/44	910,000.00	861,870.10	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,340,732.40	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,580,000.00	3,370,570.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	4,500,000.00	4,807,170.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,074,128.50	
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,557,960.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,313,939.50	
FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	966,492.00	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,354,696.70	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,053,292.00	
FRTR 0% 03/25/25	8,090,000.00	8,251,476.40	
FRTR 0% 05/25/22	2,800,000.00	2,818,816.00	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,275,411.80	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,003,820.40	
FRTR 0% 11/25/31	670,000.00	659,420.70	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,706,337.00	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,830,000.00	5,386,657.50	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,719,783.20	
FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	4,702,559.30	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,644,534.60	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,029,350.00	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,605,506.60	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,502,617.60	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,020,930.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,634,182.40	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,458,545.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	5,984,811.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,825,516.60	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,153,731.60	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,543,094.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,177,157.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,604,252.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,628,574.60	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000.00	8,155,924.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	5,896,500.80	

FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	4,506,336.00
FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,273,955.40
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,327,498.20
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,501,773.40
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,095,205.60
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,458,524.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,180,620.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	957,369.90
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,039,836.50
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	756,580.00
IRISH 0.55% 04/22/41	490,000.00	477,098.30
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,152,229.50
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,669.30
IRISH 0% 10/18/31	580,000.00	568,295.60
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,312,752.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	750,500.50
IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	964,576.00
IRISH 1.5% 05/15/50	730,000.00	837,076.40
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	969,699.20
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,520,337.20
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,470,972.80
IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,384,757.80
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,080,376.30
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,095,001.60
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,854,582.00
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,391,358.20
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,778,365.80
NETHER 0.5% 01/15/40	1,290,000.00	1,347,959.70
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,441,243.20
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,262,637.40
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,745,598.60
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,884,521.00
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,885,760.80
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	671,321.00
NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	857,911.60
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,947,936.00
NETHER 0% 07/15/31	830,000.00	835,527.80
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,045,070.40
NETHER 2.25% 07/15/22	1,220,000.00	1,262,468.20
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,614,061.80
NETHER 2.75% 01/15/47	2,100,000.00	3,346,875.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,160,821.60
NETHER 3.75% 01/15/23	2,330,000.00	2,506,730.50

NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,510,343.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,489,002.80	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,418,038.30	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	227,954.00	
OBL 0% 04/05/24	4,250,000.00	4,337,167.50	
OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,191,367.40	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,847,612.50	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,250,680.40	
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,200,684.80	
OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,464,384.40	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,536,651.50	
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,572,189.50	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,866,553.50	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	938,006.60	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,736,834.40	
RAGB 0.75% 03/20/51	790,000.00	806,037.00	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,216,011.20	
RAGB 0.85% 06/30/20	350,000.00	312,634.00	
RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,138,429.80	
RAGB 0% 02/20/31	590,000.00	589,185.80	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	949,827.60	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,521,255.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,350,000.00	1,376,190.00	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,915.20	
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	382,279.80	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,541,640.10	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,129,140.90	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	424,545.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,068,091.20	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,408,709.40	
RAGB 2.1% 09/20/17	780,000.00	1,263,210.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,260,000.00	1,618,923.60	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,309,507.60	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,508,208.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	967,607.80	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,907,814.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,655,643.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,669,747.20	
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	523,956.60	
RFGB 0.125% 04/15/52	490,000.00	420,758.10	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	383,772.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	650,392.40	

RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	917,432.40
RFGB 0.5% 09/15/28	1,030,000.00	1,088,843.90
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	800,264.80
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	536,610.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	732,676.50
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,461.80
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,643.60
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	631,499.40
RFGB 1.125% 04/15/34	710,000.00	793,141.00
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	592,738.30
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	677,469.00
RFGB 1.625% 09/15/22	930,000.00	959,146.20
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	848,915.60
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	513,294.60
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	787,334.20
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	988,945.00
SPGB 0.1% 04/30/31	1,850,000.00	1,781,235.50
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,339,715.90
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,659,574.20
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,412,466.00
SPGB 0.45% 10/31/22	3,060,000.00	3,105,900.00
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,937,903.00
SPGB 0.6% 10/31/29	3,400,000.00	3,488,570.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,101,000.00
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	938,380.80
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,380,691.00
SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,424,692.20
SPGB 0% 01/31/28	780,000.00	776,552.40
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,404,157.00
SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,275,787.80
SPGB 1.2% 10/31/40	1,810,000.00	1,820,950.50
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,285,399.00
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,724,723.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,120,000.00	2,313,810.40
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,605,283.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,950,849.30
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,322,537.60
SPGB 1.45% 10/31/71	560,000.00	486,136.00
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,899,577.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,286,375.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,121,965.00
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,113,199.00
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,360,625.80

	SPGB 1% 10/31/50	2,160,000.00	1,921,212.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,117,835.50	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,918,337.60	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,400,116.00	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	3,995,892.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,250,000.00	3,008,587.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	2,952,098.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,841,451.20	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,754,317.60	
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	3,019,686.40	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,439,580.80	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,331,764.80	
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,747,760.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,550,000.00	4,241,262.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,889,698.10	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,100,000.00	3,762,276.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,316,069.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,040,427.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,589,076.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,519,213.50	
	ユーロ 小計	783,730,000.00	912,720,686.50 (120,771,201,237)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	3,000,000.00	2,973,900.00	
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,517,802.30	
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,970,148.50	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,199,522.40	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	1,978,357.10	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,325,402.20	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,168,522.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,037,039.40	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,729,699.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,450,000.00	2,284,478.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	2,550,000.00	2,122,722.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,956,909.20	
	UKT 0.875% 01/31/46	760,000.00	688,088.80	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,725,619.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,137,197.70	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,785,944.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,120,720.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,656,156.50	
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,370,786.00	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,026,860.60	

	UKT 1.625% 10/22/71	900,000.00	1,076,706.00	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,436,461.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,895,964.50	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,191,822.40	
	UKT 1.75% 09/07/37	3,100,000.00	3,362,291.00	
	UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,642,640.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,629,400.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,776,588.80	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,761,280.20	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,917,967.80	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,810,000.00	3,893,648.40	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,697,984.50	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,554,982.80	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,614,544.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,390,000.00	3,418,656.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,839,242.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,820,000.00	2,736,788.60	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,704,951.30	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,070,000.00	3,158,675.10	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,573,434.20	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,573,674.20	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,058,112.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,533,507.20	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,768,921.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,780,000.00	2,432,120.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,596,473.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,858,748.20	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,131,722.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,749,287.50	
	イギリスbond 小計	105,270,000.00	126,362,469.70 (19,289,230,999)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,270,000.00	5,144,099.70	
	SGB 0.75% 05/12/28	8,380,000.00	8,731,122.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,724,450.90	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,061,625.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,509,784.70	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,478,850.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	10,050,000.00	11,125,450.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	8,609,687.80	
	SGB 3.5% 06/01/22	14,000,000.00	14,569,520.00	
	スウェーデンクローナ 小計	76,250,000.00	82,954,590.60 (1,086,705,136)	
	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,956,620.00	

ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,340,000.00	4,352,976.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,886,542.20	
	NGB 1.75% 02/17/27	5,360,000.00	5,563,251.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,937,808.60	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,919,242.00	
	NGB 2% 04/26/28	6,100,000.00	6,435,012.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,612,325.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,849,366.40	
ノルウェークローネ 小計		55,570,000.00	57,513,144.40	(762,624,294)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	8,020,000.00	8,118,485.60	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,340,000.00	3,097,883.40	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,955,588.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,006,225.80	
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,092,304.10	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,808,066.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,330,000.00	9,168,247.90	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,260,000.00	28,669,957.20	
デンマーククローネ 小計		71,160,000.00	85,916,758.00	(1,528,459,124)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,500,000.00	1,438,170.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,580,790.40	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,228,105.80	
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,160,000.00	2,079,367.20	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,170,948.30	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,102,018.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,050,000.00	6,438,168.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,544,254.60	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,086,898.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,625,341.90	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,149,375.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,260,000.00	6,922,871.40	
	POLGB 4% 10/25/23	3,430,000.00	3,755,987.20	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	797,430.00	
POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,678,298.80		
ポーランドズロチ 小計		60,380,000.00	64,598,025.40	(1,876,947,306)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,925,898.00	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,305,789.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,640,000.00	3,585,691.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,609,795.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,151,592.40	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	1,708,721.30	

	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,607,713.80	
	ACGB 1% 11/21/31	3,750,000.00	3,503,775.00	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,096,742.40	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,753,689.60	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,264,880.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,118,479.30	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,487,943.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,718,231.90	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,344,070.20	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,692,836.80	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,843,280.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,150,000.00	3,492,783.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,863,008.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,706,103.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,119,640.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,974,358.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,820,666.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,313,020.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,476,907.10	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,839,100.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,763,125.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,574,550.50	
	オーストラリアドル 小計	73,260,000.00	77,662,394.30 (6,635,474,968)	
シンガポ ルドル	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	385,772.40	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	818,584.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	422,893.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	784,126.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	769,580.60	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	522,952.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	462,688.60	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,145,424.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,439,454.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,029,978.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,121,841.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	657,130.20	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	850,485.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	426,117.10	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,398,573.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	980,495.60	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	998,993.60	
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,315,038.00	



	シンガポールドル 小計	14,300,000.00	15,530,128.70 (1,274,712,963)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,528,650.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	724,521.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,391,069.30
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,566,307.90
	MGS 3.733% 06/15/28	3,430,000.00	3,608,291.40
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,125,174.30
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	521,400.00
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,538,580.00
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	964,400.70
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,370,962.00
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,082,293.10
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,582,965.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,197,946.90
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,093,420.50
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,538,265.60
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	635,184.00
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,519,515.60
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,003,189.00
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	727,791.20
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,351,398.40
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,156,440.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,116,741.90
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,146,466.60
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,610,241.20
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,069,729.30
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,578,775.20
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,467,028.40	
MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,503,416.30	
MGS 4.921% 07/06/48	1,400,000.00	1,517,054.00	
MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,703,083.20	
	マレーシアリンギット 小計	51,060,000.00	53,940,302.00 (1,430,761,116)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	699,360.90
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,430,558.46
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,808,960.57
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,072,644.47
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,809,821.28
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,145,305.22
	ILGOV 1% 03/31/30	2,220,000.00	2,193,258.09
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,880,000.00	3,156,523.48
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,491,632.83

	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,977,730.44	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,079,063.07	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,332,544.94	
	イスラエルシェケル 小計	35,400,000.00	40,197,403.75 (1,345,346,807)	
	合計		294,306,290,777 (294,306,290,777)	

## 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 213銘柄	100.0%	44.1%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 338銘柄	100.0%	41.0%
イギリスポンド	国債証券 49銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.3%
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 30銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 12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。

## 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 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	442,821,695
コール・ローン	1,570,766,070
国債証券	67,345,302,121
派生商品評価勘定	32,700
未収入金	450,806,324
未収利息	1,137,594,140
前払費用	87,430,834
流動資産合計	71,034,753,884
資産合計	71,034,753,884
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	278,370
未払金	1,244,665,960
未払解約金	31,032,537
未払利息	1,216
流動負債合計	1,275,978,083
負債合計	1,275,978,083
純資産の部	
元本等	
元本	39,446,407,483
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,312,368,318
元本等合計	69,758,775,801
純資産合計	69,758,775,801
負債純資産合計	71,034,753,884

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2021年 5月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,446,407,483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 1.7684円 (1万口当たり純資産額) (17,684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 5月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

	2021年 5月10日現在

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	36,424,298,034円
期中追加設定元本額	4,154,736,222円
期中一部解約元本額	1,132,626,773円
期末元本額	39,446,407,483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	4,414,359,341円
世界経済インデックスファンド	7,545,680,158円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,823,603,265円
DC世界経済インデックスファンド	9,171,123,180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）	1,809,381,421円
コア投資戦略ファンド（安定型）	121,588,116円
コア投資戦略ファンド（成長型）	361,077,852円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	81,253,356円
分散投資コア戦略ファンドA	253,132,597円
分散投資コア戦略ファンドS	595,305,092円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	351,371,816円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,019,042,872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）	181,345,048円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	85,913,663円
SMT インデックスバランス・オープン	158,605,717円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,130,138,145円
SMT 世界経済インデックス・オープン	216,538,820円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	218,407,316円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	352,912,530円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,464,285円
グローバル経済コア	638,970,400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・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	1,072,474円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	892,955円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	357,639円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	806,570円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	78,132,786円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	241,498,323円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	301,296,923円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	301,183,796円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	290,856,697円

区分	2021年 5月10日現在
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	289,032,886円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	288,766,966円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,118,068,150
合計		2,118,068,150

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 通貨関連

(2021年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	801,010,250	-	800,793,650	216,600
	アメリカドル	326,280,000	-	326,304,300	24,300
	メキシコペソ	60,082,000	-	60,071,000	11,000
	トルコリラ	46,285,050	-	46,217,150	67,900
	チェココルナ	77,475,000	-	77,413,500	61,500
	ポーランドズロチ	43,618,500	-	43,583,400	35,100
	マレーシアリンギット	124,653,400	-	124,611,100	42,300
	南アフリカランド	46,416,000	-	46,424,400	8,400
	香港・オフショア人民元	76,200,300	-	76,168,800	31,500
	売建	35,045,500	-	35,074,570	29,070
	ハンガリーフォリント	35,045,500	-	35,074,570	29,070
	合計	836,055,750	-	835,868,220	245,670

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

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	38,844,960.00	
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	114,900,535.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000.00	115,773,161.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	110,336,950.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	70,100,000.00	72,489,008.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	116,351,112.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	60,400,000.00	65,057,444.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	62,353,620.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	34,699,440.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000.00	131,912,298.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	64,400,000.00	70,864,472.00	
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	79,635,379.00	
		MBONO 8% 11/07/47	69,100,000.00	71,486,023.00	
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	104,908,368.00	
			メキシコペソ 小計		1,111,050,000.00
	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000.00	68,590,551.40	
		BLTN 0% 07/01/22	20,650,000.00	19,324,695.39	
		BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	43,892,480.00	
		BLTN 0% 07/01/24	9,000,000.00	7,035,984.90	
		BNTNF 10% 01/01/23	46,650,000.00	48,895,940.36	
		BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000.00	35,467,773.19	
		BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000.00	33,095,112.91	
		BNTNF 10% 01/01/29	17,400,000.00	18,278,952.08	
		BNTNF 10% 01/01/31	7,450,000.00	7,819,888.68	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,491,875.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,970,062.50	
			ブラジルリアル 小計		304,450,000.00
	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	180,000,000.00	168,476,843.88	
		BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,563,228,441.80	



	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,850,617,368.47	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,480,000,000.00	1,626,011,325.48	
	BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	885,409,364.28	
	BTPCL 5% 03/01/35	1,890,000,000.00	2,073,294,012.51	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,480,000,000.00	1,828,235,891.08	
	チリペソ 小計	10,095,000,000.00	10,995,273,247.50 (1,720,496,376)	
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000.00	89,357,739,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	1,300,000,000.00	1,339,767,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	17,100,000,000.00	16,572,294,000.00	
	コロンビアペソ 小計	90,700,000,000.00	107,269,800,000.00 (3,100,526,299)	
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,568,864.50	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	4,600,000.00	4,502,204.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,200,000.00	3,596,800.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,970,000.00	7,666,651.50	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	6,593,895.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,450,000.00	7,334,940.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	7,441,504.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,050,000.00	6,862,938.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,235,390.00	
	ペルーヌエボソル 小計	50,120,000.00	54,803,187.50 (1,564,943,381)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	13,077,750.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,963,843.00	
	ウルグアイペソ 小計	29,850,000.00	31,041,593.00 (76,917,963)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,286,176.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	27,700,500.00	
	ドミニカペソ 小計	45,400,000.00	48,986,676.00 (93,863,369)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,337,750.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	6,412,850.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,950,000.00	7,777,716.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	6,850,000.00	6,337,277.50	
	TURKGB 11.7% 11/13/30	12,400,000.00	9,221,260.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	5,677,946.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	7,350,000.00	6,997,347.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,178,389.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,775,416.00	
	TURKGB 12.6% 10/01/25	8,100,000.00	6,901,767.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	6,000,000.00	5,867,640.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,226,972.00	

	TURKGB 8.5% 09/14/22	3,750,000.00	3,364,762.50	
	TURKGB 8% 03/12/25	8,300,000.00	6,155,944.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	10,750,000.00	8,577,210.00	
	トルコリラ 小計	114,250,000.00	94,810,247.50 (1,252,689,876)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	27,104,894.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	50,023,698.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	46,423,780.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,900,000.00	43,900,276.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	42,900,000.00	40,651,182.00	
	CZGB 1% 06/26/26	59,200,000.00	57,866,224.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	39,500,000.00	41,294,880.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	47,800,000.00	50,649,836.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	50,300,000.00	54,499,044.00	
	CZGB 2% 10/13/33	52,200,000.00	52,851,456.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	36,097,880.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	37,804,084.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	43,033,042.00	
		チェココルナ 小計	572,100,000.00	582,200,276.00 (3,004,735,624)
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	458,500,000.00	455,684,810.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	326,924,700.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	275,000,000.00	280,172,750.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	464,426,500.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	297,000,000.00	282,170,790.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	570,955,720.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	496,603,340.00	
	HGB 2% 05/23/29	173,000,000.00	172,442,940.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	587,000,000.00	629,909,700.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	424,516,750.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	589,837,350.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	633,368,960.00	
	HGB 3% 10/27/38	248,000,000.00	241,556,960.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	766,200,600.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	529,988,040.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	252,000,000.00	335,898,360.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	300,255,200.00	
	ハンガリーフォリント 小計	7,067,000,000.00	7,500,913,470.00 (2,769,517,275)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	3,000,000.00	2,876,340.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	12,850,000.00	12,925,044.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	12,900,000.00	12,418,443.00	

	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,262,560.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	13,800,000.00	14,646,078.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,721,870.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	15,164,280.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	17,600,000.00	19,006,416.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	15,569,136.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000.00	15,601,966.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000.00	16,502,776.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,653,042.50	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	11,881,184.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	11,703,678.00	
	ポーランドズロチ 小計	184,900,000.00	195,932,814.00 (5,692,984,657)	
ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	195,500,000.00	182,641,965.00	
	RFLB 5.7% 05/17/28	181,000,000.00	170,992,510.00	
	RFLB 6.1% 07/18/35	180,000,000.00	164,773,800.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	150,792,470.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	159,038,060.00	
	RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	210,851,025.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	146,000,000.00	148,908,320.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	137,100,000.00	140,896,299.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	216,987,624.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	163,637,775.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	209,307,330.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	169,389,298.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	117,700,000.00	120,500,083.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	196,500,000.00	207,242,655.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	142,319,010.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	166,742,140.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	149,374,475.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	192,880,840.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	72,768,536.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	109,819,968.00	
RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	168,100,920.00		
RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	130,106,744.00		
	ロシアルーブル 小計	3,481,550,000.00	3,548,071,847.00 (5,215,665,615)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	6,150,000.00	5,925,525.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,330,404.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,448,898.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	9,450,000.00	9,802,390.50	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,311,261.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,006,509.50	

	MGS 3.757% 05/22/40	10,450,000.00	9,906,600.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,362,629.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,212,710.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000.00	28,757,197.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,727,220.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,599,332.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	2,400,000.00	2,540,736.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	27,524,120.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	8,500,000.00	8,961,635.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	5,900,000.00	5,649,958.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	8,023,928.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	5,850,000.00	6,329,875.50	
	マレーシアリングット 小計	187,500,000.00	194,420,930.00 (5,156,995,726)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	42,000,000.00	42,101,220.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	91,000,000.00	91,263,900.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	99,000,000.00	101,397,780.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	53,621,472.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	41,865,894.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	85,100,000.00	84,809,809.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	59,300,000.00	60,259,474.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	106,100,000.00	111,872,901.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	91,000,000.00	95,284,280.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	83,200,000.00	91,370,240.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	53,500,000.00	54,811,285.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000.00	203,528,578.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000.00	137,885,792.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,437,320.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	114,300,000.00	134,711,694.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	95,701,728.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	97,400,000.00	110,226,606.00	
THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	131,400,250.00		
	タイバーツ 小計	1,590,600,000.00	1,731,550,223.00 (6,043,110,278)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,147,000.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	24,272,800.00	
	フィリピンペソ 小計	35,000,000.00	39,419,800.00 (89,518,423)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,301,733,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,424,934,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	33,500,000,000.00	33,416,920,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	52,500,000,000.00	53,498,025,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	44,934,750,000.00	

	INDOGB 6.25% 06/15/36	7,500,000,000.00	7,450,500,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	33,000,000,000.00	33,245,190,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	44,100,000,000.00	45,790,353,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	23,933,280,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,398,760,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	20,023,171,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	28,263,520,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,017,338,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,075,007,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	38,883,984,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,076,840,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	38,681,892,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,402,243,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,320,578,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,400,000,000.00	20,435,040,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	50,716,178,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	57,988,320,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,657,504,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	32,644,380,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	40,050,393,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,658,226,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	22,883,914,000.00	
	インドネシアルピア 小計	824,400,000,000.00	881,172,973,000.00 (6,785,031,892)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	121,100,000.00	138,977,993.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	43,600,000.00	29,982,412.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,311,289.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	44,900,000.00	47,281,945.00	
	SAGB 7% 02/28/31	40,200,000.00	33,995,934.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	55,200,000.00	49,447,056.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	57,378,927.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	56,204,984.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	93,600,000.00	77,142,312.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	54,524,290.00	
	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000.00	89,395,656.00	
	SAGB 9% 01/31/40	48,450,000.00	41,507,599.50	
		南アフリカランド 小計	774,950,000.00	698,150,397.50 (5,403,684,076)
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,295,000.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	17,874,720.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,197,899.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000.00	30,108,990.00	

	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	16,971,318.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000.00	34,128,180.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,095,200.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	8,000,000.00	8,038,480.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,147,400.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,633,346.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000.00	29,767,794.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,159,240.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,314,380.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,026,799.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,221,980.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,214,000.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,268,060.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,251,520.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	23,700,000.00	24,297,477.00	
	香港・オフショア人民元 小計	409,400,000.00	410,011,783.00 (6,940,638,461)	
	合計		67,345,302,121 (67,345,302,121)	

## 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%	9.6%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.8%
チリペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	2.6%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	4.6%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.3%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.9%
チェココルナ	国債証券 13銘柄	100.0%	4.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 17銘柄	100.0%	4.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	8.5%
ロシアルーブル	国債証券 22銘柄	100.0%	7.7%
マレーシアリンギット	国債証券 18銘柄	100.0%	7.7%
タイバーツ	国債証券 18銘柄	100.0%	9.0%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%

インドネシアルピア	国債証券	27銘柄	100.0%	10.1%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	8.0%
香港・オフショア人民元	国債証券	19銘柄	100.0%	10.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,677,707,192
投資証券	104,512,859,650
派生商品評価勘定	268,423,200
未収入金	91,214,580
未収配当金	1,057,593,188
差入委託証拠金	197,370,000
流動資産合計	108,805,167,810
資産合計	108,805,167,810
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	268,423,200
未払解約金	148,007,521
未払利息	2,073
流動負債合計	416,432,794
負債合計	416,432,794
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	50,413,397,286
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	57,975,337,730
元本等合計	108,388,735,016
純資産合計	108,388,735,016
負債純資産合計	108,805,167,810

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

	2021年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	50,413,397,286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 2.1500円 (1万口当たり純資産額) (21,500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 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>



	2021年 5月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	55,613,724,754円
期中追加設定元本額	2,438,940,748円
期中一部解約元本額	7,639,268,216円
期末元本額	50,413,397,286円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,628,247,461円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,623,430円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,574,164,778円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	23,326,868,398円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,420,648,265円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,078,546,626円
分散投資コア戦略ファンド A	433,901,311円
分散投資コア戦略ファンド S	874,825,963円
コア投資戦略ファンド（切替型）	871,401,330円
S M T インデックスバランス・オープン	27,022,933円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	285,741,987円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	4,954,578円
グローバル経済コア	260,777,909円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	9,614,344円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	422,862,295円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	42,599,327円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	555,915,556円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,835,805円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	893,720,485円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	378,462,607円

区分	2021年 5月10日現在
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	307,661,898円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		17,200,109,206
合計		17,200,109,206

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,499,048,800	-	3,767,472,000	268,423,200
	合計	3,499,048,800	-	3,767,472,000	268,423,200

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,539	201,609,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,304	278,323,200	

S O S i L A 物流リート投資法人	2,476	357,039,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	3,246	2,087,178,000	
森ヒルズリート投資法人	11,062	1,738,946,400	
産業ファンド投資法人	13,312	2,630,451,200	
アドバンス・レジデンス投資法人	8,945	3,157,585,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,418	1,420,303,400	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,719	2,350,062,000	
G L P 投資法人	29,427	5,276,261,100	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,234	1,481,900,000	
日本プロロジスリート投資法人	14,888	5,181,024,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,433	919,986,000	
O n e リート投資法人	1,468	447,740,000	
イオンリート投資法人	9,552	1,435,665,600	
ヒューリックリート投資法人	7,807	1,348,268,900	
日本リート投資法人	3,059	1,307,722,500	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	59,845	1,239,988,400	
積水ハウス・リート投資法人	27,699	2,481,830,400	
トーセイ・リート投資法人	2,083	279,746,900	
ケネディクス商業リート投資法人	3,746	1,033,146,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,009	280,657,300	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,813	212,846,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	30,454	5,225,906,400	
いちごホテルリート投資法人	1,647	143,947,800	
ラサールロジポート投資法人	11,391	1,990,007,700	
スターアジア不動産投資法人	9,676	543,791,200	
マリモ地方創生リート投資法人	882	115,101,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,287	1,824,285,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,520	126,160,000	
投資法人みらい	10,171	500,413,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,040	270,504,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,368	1,072,704,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	3,013	533,903,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,443	166,233,600	
タカラレーベン不動産投資法人	2,830	331,959,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,653	502,652,800	
日本ビルファンド投資法人	10,599	7,429,899,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,417	6,394,143,000	
日本都市ファンド投資法人	46,907	5,197,295,600	
オリックス不動産投資法人	18,764	3,597,058,800	
日本プライムリアルティ投資法人	5,863	2,526,953,000	
N T T 都市開発リート投資法人	8,506	1,351,603,400	

東急リアル・エステート投資法人	6,314	1,164,933,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,539	815,413,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	20,140	3,315,044,000	
森トラスト総合リート投資法人	6,731	1,050,036,000	
インヴィンシブル投資法人	39,377	1,675,491,350	
フロンティア不動産投資法人	3,125	1,501,562,500	
平和不動産リート投資法人	5,778	937,191,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,153	1,928,965,500	
福岡リート投資法人	4,870	860,042,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,913	2,307,096,000	
いちごオフィスリート投資法人	7,813	743,797,600	
大和証券オフィス投資法人	2,006	1,560,668,000	
阪急阪神リート投資法人	4,254	656,817,600	
スターツプロシード投資法人	1,467	328,461,300	
大和ハウスリート投資法人	13,437	4,010,944,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,339	1,959,899,400	
大和証券リビング投資法人	12,297	1,377,264,000	
ジャパンエクセレント投資法人	8,738	1,326,428,400	
合計	589,806	104,512,859,650	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	89,964,960
コール・ローン	128,083,425
投資証券	87,805,303,033
派生商品評価勘定	448
未収入金	302,309,944
未収配当金	107,979,419
流動資産合計	88,433,641,229
資産合計	88,433,641,229
負債の部	

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	69,549
未払解約金	130,922,363
未払利息	99
流動負債合計	130,992,011
負債合計	130,992,011
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	41,688,637,767
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,614,011,451
元本等合計	88,302,649,218
純資産合計	88,302,649,218
負債純資産合計	88,433,641,229

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p>

	2021年 5月10日現在
	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 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,688,637,767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 2.1181円 (1万口当たり純資産額) (21,181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 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	47,638,239,657円
期中追加設定元本額	1,605,477,130円
期中一部解約元本額	7,555,079,020円



区分	2021年 5月10日現在
期末元本額	41,688,637,767円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	78,132,785円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	119,338,464円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,659,821,901円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,819,259円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,591,466,800円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,437,644,405円
コア投資戦略ファンド（安定型）	968,807,753円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,133,420,495円
分散投資コア戦略ファンドA	474,238,531円
分散投資コア戦略ファンドS	973,563,519円
コア投資戦略ファンド（切替型）	894,066,097円
SMT インデックスバランス・オープン	156,644,689円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	306,655,965円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,371,396円
グローバル経済コア	263,627,370円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,978,964円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	449,706,229円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	45,385,362円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	879,154,604円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	473,403,385円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	91,753,320円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	4,065,754円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	126,865,565円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	143,360,667円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	138,431,255円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	137,460,330円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	120,452,903円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	13,451,541,622
合計	13,451,541,622

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	144,868,274	-	144,937,375	69,101
	アメリカドル	65,256,000	-	65,260,860	4,860
	カナダドル	11,662,690	-	11,664,653	1,963
	ユーロ	10,530,640	-	10,585,680	55,040
	イギリスポンド	15,262,200	-	15,264,680	2,480
	オーストラリアドル	23,923,480	-	23,923,032	448
	香港ドル	10,026,864	-	10,030,730	3,866
	シンガポールドル	8,206,400	-	8,207,740	1,340
合計		144,868,274	-	144,937,375	69,101

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	1,030,802.40	
		AGREE REALTY CORP	35,452	2,494,402.72	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	767,382.20	
		ALEXANDER'S INC	1,190	327,250.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,006	12,649,008.84	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,157	956,741.11	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	77,492	3,547,583.76	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	583,982.00	

AMERICAN HOMES 4 RENT-A	151,277	5,659,272.57	
AMERICOLD REALTY TRUST	142,080	5,451,609.60	
APARTMENT INCOME REIT CO	83,811	3,716,179.74	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	76,106	530,458.82	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,824,331.71	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,000	514,140.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,196	15,289,663.88	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	138,699.00	
BOSTON PROPERTIES	79,048	8,549,831.68	
BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,286,338.80	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	167,078	3,794,341.38	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	21,202	429,552.52	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	24,100	435,969.00	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	91,350.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	54,928	6,739,116.32	
CARETRUST REIT INC	52,477	1,211,956.31	
CENTERSPACE	7,499	534,378.74	
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	338,048.80	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	6,500	69,550.00	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	283,816.50	
CLIPPER REALTY INC	7,300	63,656.00	
COLONY CAPITAL INC	277,172	1,940,204.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,431	1,211,037.13	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,605	570,617.85	
COREPOINT LODGING INC	22,000	228,140.00	
CORESITE REALTY CORP	23,959	2,848,245.92	
CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,769,715.18	
COUSINS PROPERTIES INC	83,643	3,020,348.73	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	147,420.00	
CUBESMART	112,430	4,742,297.40	
CYRUSONE INC	67,819	4,752,077.33	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,154,966.40	
DIGITAL REALTY TRUST INC	157,875	23,867,542.50	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	523,896.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	92,859	3,012,345.96	
DUKE REALTY CORP	208,515	9,577,093.95	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,009,608.24	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,329	3,486,673.35	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	957,192.40	
EPR PROPERTIES	41,912	2,074,644.00	
EQUINIX INC	49,993	35,667,505.85	

EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,877,271.15
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	95,606	6,681,903.34
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	192,339	14,242,702.95
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	1,652,192.64
ESSEX PROPERTY TRUST	36,272	10,478,255.36
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,703	10,852,029.72
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	273,220.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,320	4,575,668.40
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	72,698	3,574,560.66
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,250	1,221,300.00
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	307,256.90
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	123,191	5,803,528.01
GEO GROUP INC/THE	64,306	369,116.44
GETTY REALTY CORP	21,985	695,165.70
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	429,195.00
GLADSTONE LAND CORP	11,500	256,335.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	388,448.30
GLOBAL NET LEASE INC	51,412	984,539.80
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	78,310	2,483,993.20
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	123,154	3,484,026.66
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	300,597	10,076,011.44
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	251,789.50
HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,422	2,597,442.12
HOST HOTELS AND RESORTS INC	397,952	6,995,996.16
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,344,479.10
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,731	982,574.95
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,941	952,698.51
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,388	2,473,165.24
INVITATION HOMES INC	316,646	11,092,109.38
IRON MOUNTAIN INC	162,379	6,706,252.70
JBG SMITH PROPERTIES	62,238	2,001,574.08
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	350,000	257,250.00
KILROY REALTY CORPORATION	59,619	4,041,572.01
KIMCO REALTY CORP	243,461	5,224,673.06
KITE REALTY GROUP TRUST	46,370	1,000,664.60
LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	1,931,228.04
LIFE STORAGE INC	42,485	4,077,285.45
LTC PROPERTIES INC	23,126	946,547.18
MACERICH CO/THE	64,797	890,310.78
MACK-CALI REALTY CORP	50,236	848,486.04
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	548,740.18

MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	327,113	7,026,387.24
MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,825	10,022,439.75
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,071,014.48
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	98,678	4,789,830.12
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	36,720	1,682,143.20
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,779,633.00
NETSTREIT CORP	7,992	170,229.60
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	305,550.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	621,184.46
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	765,046.70
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	130,489	4,762,848.50
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	215,232.97
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	951,992.86
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	133,080	2,974,338.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,690,066.80
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,212,366.92
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,256,594.00
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	299,238.00
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	293,722.49
PRIME US REIT	295,000	252,225.00
PROLOGIS INC	414,203	48,055,832.06
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,754,004.00
PUBLIC STORAGE	85,357	23,666,935.39
QTS REALTY TRUST INC	36,137	2,297,590.46
REALTY INCOME CORP	209,371	14,258,165.10
REGENCY CENTERS CORP	88,920	5,811,811.20
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,615	1,254,810.37
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	115,918	1,403,766.98
RETAIL VALUE	9,529	174,761.86
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	73,995	4,071,944.85
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,495,114.20
RPT REALTY	43,950	570,471.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,424,677.04
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,636	2,103,416.28
SAFEHOLD INC	8,340	588,637.20
SAUL CENTERS INC	6,800	298,452.00
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	332,131.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,137,090.67
SIMON PROPERTY GROUP	184,427	23,042,309.38
SITE CENTERS CORP	91,820	1,357,099.60
SL GREEN REALTY CORP	39,045	2,847,161.40

	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,982	3,023,789.32
	STAG INDUSTRIAL INC	89,179	3,239,873.07
	STORE CAPITAL CORP	135,047	4,732,046.88
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	635,969.40
	SUN COMMUNITIES INC	62,289	10,316,927.07
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,349	1,584,206.26
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	52,270	919,429.30
	TERRENO REALTY CORP	38,649	2,479,719.84
	UDR INC	167,222	7,740,706.38
	UMH PROPERTIES INC	21,320	471,811.60
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	460,915.30
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,154,506.50
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	283,090.50
	VENTAS INC	209,174	11,456,459.98
	VEREIT INC	128,943	6,061,610.43
	VICI PROPERTIES INC	299,377	9,400,437.80
	VORNADO REALTY TRUST	88,341	4,064,569.41
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	10,028	22,563.00
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,080,464.70
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,885	2,205,198.45
	WELLTOWER INC	234,215	17,495,860.50
	WHITESTONE REIT	19,090	180,209.60
	WP CAREY INC	98,987	7,437,883.18
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,215,218.40
	アメリカドル 小計	13,841,765	598,534,694.34 (65,102,618,703)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,484,623.08
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,830	338,205.10
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	147,480.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	530,765.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,320	2,647,651.20
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,227,922.50
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	566,767.80
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	448,088.22
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	463,091.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	52,150	736,358.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	302,381.60
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,032,214.75
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,120	1,306,042.40
		81,539	1,257,331.38

	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT		
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,490	534,500.40
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	575,209.50
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	243,978.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	209,204.70
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,470	645,135.70
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	99,750.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,431	1,904,880.30
	SLATE GROCERY REIT	10,300	128,544.00
	SLATE OFFICE REI	17,000	75,820.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	42,076	1,236,192.88
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	751,530.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	188,082.00
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	488,565.00
	カナダドル 小計	970,290	19,570,314.51 (1,756,044,320)
ユーロ	AEDIFICA	18,325	1,902,135.00
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	98,200	1,418,008.00
	ALTAREA	2,230	378,208.00
	BEFIMMO S.C.A.	14,010	497,355.00
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	381,000.00
	CARMILA	25,000	354,500.00
	COFINIMMO	15,733	2,050,009.90
	COVIVIO(FP)	26,742	2,037,205.56
	CROMWELL EUROPEAN REIT	160,000	380,800.00
	EUROCOMMERCIAL	19,690	435,149.00
	GECINA SA	30,292	3,868,288.40
	HAMBORNER REIT AG	45,000	411,300.00
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	420,382.50
	ICADE	17,080	1,196,454.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	141,580.10
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,062	1,245,577.46
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	268,620.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	406,640.00
	KLEPIERRE	111,130	2,475,976.40
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	184,960.00
	MERCIALYS	26,000	273,000.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	183,486	1,654,676.74
	MONTEA	6,100	564,860.00
	NSI NV	10,050	331,650.00

	RETAIL ESTATES	6,400	407,680.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,808	5,537,595.36	
	VASTNED RETAIL	10,650	260,925.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,470	2,233,912.00	
	WERELDHAVE NV	22,670	329,621.80	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	490,680.00	
	ユーロ 小計	1,874,008	32,538,750.22 (4,305,527,429)	
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	110,920.00	
	ASSURA PLC	1,467,040	1,079,741.44	
	BIG YELLOW GROUP PLC	90,146	1,109,697.26	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	343,650.00	
	BRITISH LAND CO PLC	524,845	2,812,119.51	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	870,519.74	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	380,067	441,637.85	
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	238,024.41	
	DERWENT LONDON PLC	61,915	2,153,403.70	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	376,000	330,880.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	264,000	429,264.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	136,980	982,146.60	
	HAMMERSON PLC	2,291,000	892,573.60	
	HOME REIT PLC	132,934	153,538.77	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	219,355	245,677.60	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	419,305	3,112,081.71	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,149,594.60	
	LXI REIT PLC	279,000	375,534.00	
	NEWRIVER REIT PL	186,000	186,744.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	293,040.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,099,891.99	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	193,140.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,009,521.90	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	160,650.00	
	SEGRE PLC	670,923	6,786,386.14	
	SHAFTESBURY PLC	176,693	1,131,718.66	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	187,483.56	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	376,000	427,700.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	213,856.87	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	942,658	1,810,846.01		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	462,000	360,360.00		
UNITE GROUP PLC	221,192	2,595,688.12		
WORKSPACE GROUP PLC	70,347	628,550.44		



	イギリスポンド 小計	14,236,560	33,925,852.48 (5,178,781,381)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	721,419.60
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	230,250.00
	ARENA REIT	201,053	689,611.79
	AVENTUS GROUP	230,000	673,900.00
	BWP TRUST	259,660	1,090,572.00
	CENTURIA CAPITAL GROUP	266,000	712,880.00
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	266,606	935,787.06
	CENTURIA OFFICE REIT	220,945	494,916.80
	CHARTER HALL GROUP	258,140	3,663,006.60
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	270,943	1,322,201.84
	CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,092,830.40
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	617,281.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,102,633	986,856.53
	DEXUS	604,807	6,205,319.82
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	350,460.00
	GOODMAN GROUP	939,928	18,084,214.72
	GPT GROUP	1,087,317	5,034,277.71
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	637,023.20
	HOME CONSORTIUM	91,000	440,440.00
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	180,642	230,318.55
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	114,885	364,185.45
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	859,198.24
	IRONGATE GROUP	340,000	499,800.00
	MIRVAC GROUP	2,205,770	6,132,040.60
	NATIONAL STORAGE REIT	546,340	1,119,997.00
	RURAL FUNDS GROUP	212,766	525,532.02
SCENTRE GROUP	2,915,179	7,987,590.46	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,450,948.80	
STOCKLAND	1,339,941	6,136,929.78	
VICINITY CENTERS	2,158,040	3,323,381.60	
WAYPOINT REIT LTD	455,796	1,166,837.76	
	オーストラリアドル 小計	18,294,725	73,780,009.33 (6,303,763,997)
ニュージー ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	768,485.34
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,392,696.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	1,077,404.95
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	650,000	1,092,000.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	655,529.31
	ニューージーランドドル 小計	2,834,417	4,986,115.60 (395,149,661)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	5,121,000.00

	FORTUNE REIT	846,000	6,683,400.00	
	LINK REIT	1,162,400	86,133,840.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,007,840.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,474,010.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	3,239,280.00	
	香港ドル 小計	5,277,400	105,659,370.00 (1,480,287,773)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	393,250.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	604,977	471,882.06	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,774,418	5,411,974.90	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,051,389.62	
	CAPITALAND CHINA TRUST	586,721	797,940.56	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,537,444	5,404,755.72	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	521,500.00	
	EC WORLD REIT	180,000	131,400.00	
	ESR REIT	1,404,065	547,585.35	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	329,400.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	734,262	1,762,228.80	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	250,700.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,470,696	2,161,923.12	
	IREIT GLOBAL	334,420	215,700.90	
	KEPPEL DC REIT	738,603	1,935,139.86	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,272,194.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	432,900.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,480,400	163,706.40	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,210,473	2,554,098.03	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	922,060	2,554,106.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,618,200	3,204,036.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,207,100	1,279,526.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	515,825.82	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	228,000	978,120.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	478,540	200,986.80	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	273,615.00	
SPH REIT	576,800	498,932.00		
STARHILL GLOBAL REIT	859,400	476,967.00		
SUNTEC REIT	1,180,700	1,794,664.00		
	シンガポールドル 小計	27,525,300	37,729,044.64 (3,096,799,984)	

韓国ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	56,152,470.00	
	JR REIT XXVII	64,338	326,193,660.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	121,000,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	400,814,400.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	207,233,750.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	155,798,880.00	
韓国ウォン 小計		230,114	1,267,193,160.00 (123,804,771)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,868,175.00	
イスラエルシェケル 小計		103,500	1,868,175.00 (62,525,014)	
合計		85,188,079	87,805,303,033 (87,805,303,033)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 156銘柄	100.0%	74.1%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	4.9%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.9%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.2%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 6銘柄	100.0%	0.1%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2021年 5月31日現在)

資産総額	86,492,180円
負債総額	26,988円
純資産総額（ - ）	86,465,192円
発行済口数	67,946,995口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2725円
（1万口当たり純資産額）	（12,725円）

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 5月31日現在)

資産総額	466,052,926,671円
負債総額	3,217,220,840円
純資産総額（ - ）	462,835,705,831円
発行済口数	249,503,103,457口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8550円
（1万口当たり純資産額）	（18,550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 5月31日現在)

資産総額	521,251,305,898円
負債総額	3,647,407,653円
純資産総額（ - ）	517,603,898,245円
発行済口数	137,722,653,603口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7583円
（1万口当たり純資産額）	（37,583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 5月31日現在)

資産総額	100,163,748,026円
負債総額	1,416,211,795円
純資産総額（ - ）	98,747,536,231円
発行済口数	25,984,756,013口
1口当たり純資産額（ / ）	3.8002円
（1万口当たり純資産額）	（38,002円）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 5月31日現在)

資産総額	645,222,736,404円
負債総額	16,856,565,883円
純資産総額（ - ）	628,366,170,521円
発行済口数	446,205,859,601口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4082円
（1万口当たり純資産額）	（14,082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 5月31日現在)

資産総額	307,979,423,385円
負債総額	3,723,830,364円
純資産総額（ - ）	304,255,593,021円
発行済口数	99,051,563,319口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0717円
（1万口当たり純資産額）	（30,717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 5月31日現在）

資産総額	71,475,644,571円
負債総額	2,650,449円
純資産総額（ - ）	71,472,994,122円
発行済口数	39,955,627,866口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7888円
（1万口当たり純資産額）	（17,888円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

資産総額	109,265,098,844円
負債総額	727,300,452円
純資産総額（ - ）	108,537,798,392円
発行済口数	49,958,272,073口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1726円
（1万口当たり純資産額）	（21,726円）

## グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

資産総額	90,082,609,268円
負債総額	62,093,739円
純資産総額（ - ）	90,020,515,529円
発行済口数	41,643,629,919口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1617円
（1万口当たり純資産額）	（21,617円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 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、）に支払います。

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2021年 5月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2021年 8月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年5月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	527	14,570,164
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	76	275,974
単位型公社債投資信託	47	298,023
合計	650	15,144,161

## 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。

なお、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、当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	24,869	21,589
金銭の信託	5,823	10,857
前払費用	348	397
未収委託者報酬	7,284	8,471
未収運用受託報酬	5,842	6,151
未収収益	190	177
その他	4,624	3,428
流動資産合計	48,983	51,072
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 256	1 301
器具備品	1 576	1 692
その他	1 0	1 0
有形固定資産合計	832	993
無形固定資産		
ソフトウェア	3,030	4,104
その他	40	41
無形固定資産合計	3,070	4,145
投資その他の資産		
投資有価証券	8,469	9,950
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	700	311
その他	35	39
投資その他の資産合計	14,842	15,937
固定資産合計	18,745	21,077
資産合計	67,729	72,149

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	305	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額	587	791
金		
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

## (2)【損益計算書】

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

（自 2019年4月1日  
至 2020年3月31日）（自 2020年4月1日  
至 2021年3月31日）

営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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			
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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
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				
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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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			
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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330

当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
-------	-----	-------	--------	--------	--------

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

## 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、決算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

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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建 物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
そ の 他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
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

### 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

2021年6月23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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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（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。

当事業年度（2021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	21,589	21,589	-
（2）金銭の信託	10,857	10,857	-
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	-
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
（6）未払金	(7,572)	(7,572)	-
（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	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(\*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

現金及び預金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 その他有価証券

投資有価証券の時価について、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

未払金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 2020年3月31日	当事業年度 2021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)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(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	-

当事業年度(2021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	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0
----------------	---	----	-------	---

## （有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（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

当事業年度（2021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（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

当事業年度（2021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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

(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(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

当事業年度(2021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
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(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	種類	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。

当事業年度（2021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	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

(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	13,711	-	315	315
	合計	13,711	-	315	315

(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	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(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。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

##### (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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

##### (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74百万円 当事業年度77百万円

#### 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44百万円、当事業年度92百万円であります。

#### 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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

## 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 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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

(\*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あります。

[ 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 ]

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	-----------	----	-----------

親会社 の子会 社	三井住 友信託 銀行(株)	東京都 千代田 区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	-	営業上の 取引 役員の兼 任	運用受託報 酬	9,365	未収運用 受託報酬	5,402
							投信販売 代行手数料 等	9,124	未払 手数料	1,888

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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）

当事業年度（2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 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 8月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
a uカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三十三銀行	37,461	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

資本金の額は2021年5月1日現在です。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 2月10日	有価証券届出書
2021年 2月10日	有価証券報告書

**独立監査人の監査報告書**

2021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 公認会計士 藤 澤 孝 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印  
業務執行社員**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2021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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年7月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 8資産インデックスバランス・オープンの2020年11月11日から2021年5月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2021年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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



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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。