

**【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9月10日提出
【計算期間】	第4期(自 2020年6月11日至 2021年6月10日)
【ファンド名】	SMT 世界経済インデックス・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、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）並びに債券に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。



## DR(預託証券)とは

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

## &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)  日本	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	北米  欧州  アジア  オセアニア				
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))		アフリカ  中近東 (中東)				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記す

るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### (1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

###### (2) 債券

一般... 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

[ 投資形態による属性区分 ]

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

[ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

[ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

## 〔特殊型〕

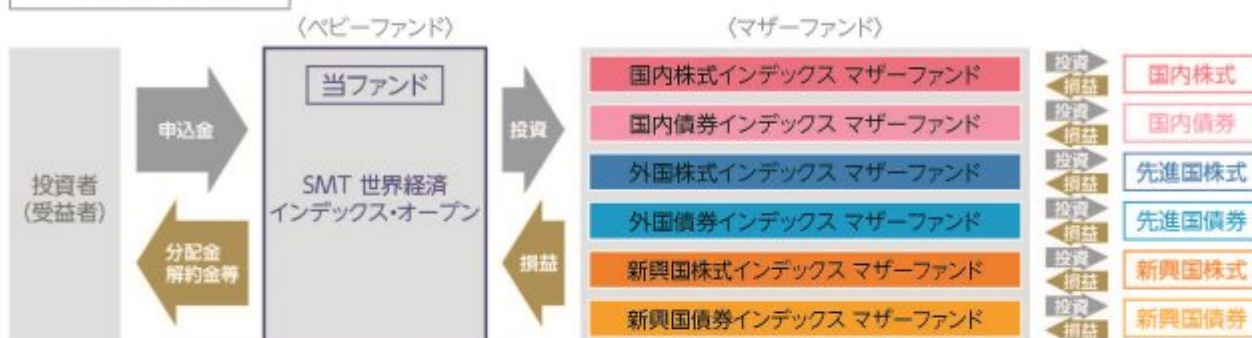
- (1) プル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款に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

## &lt;ファンドの特色&gt;

**特色1** 世界の株式及び債券に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

## ファンドのしくみ



## ? ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてペーパーファンドとし、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。

**特色2** 世界経済全体の発展を享受します。

- 基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率に基づき決定します。  
※年1回地域別構成比の見直しを行います。



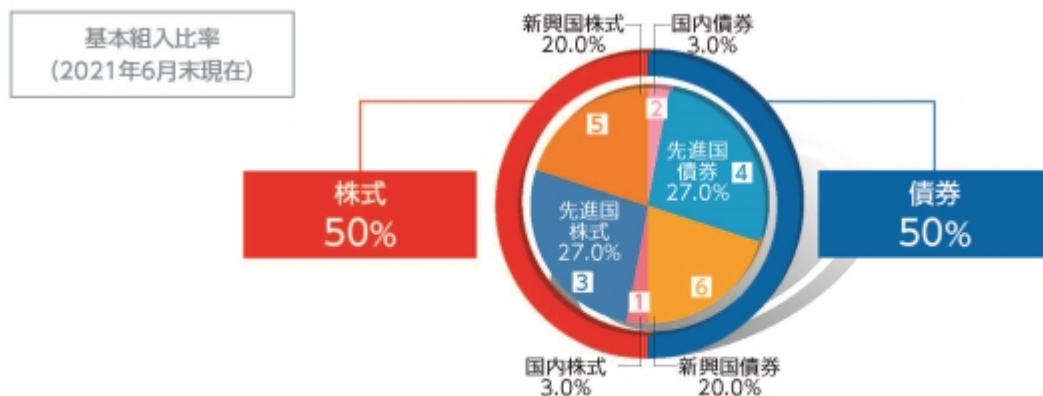
(出所) IMF「世界経済見通し2020年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※ IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※ GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※ 上記のファンドの地域別構成比は、2021年6月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。





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

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

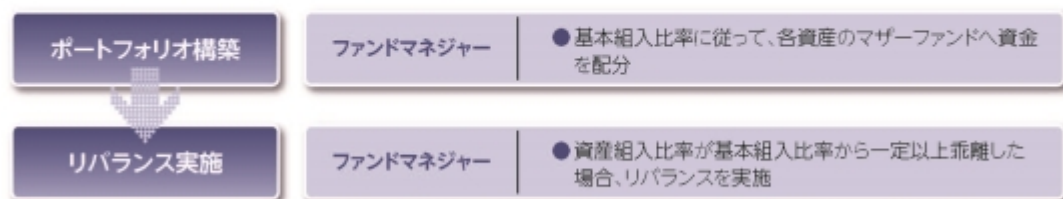
各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- ※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※3 「MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※5 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド」とは、新興国の現地通貨債権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。



## ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### 分配方針

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

### 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

### 〈ご参考情報〉

#### 世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects 2019」及びIMF「世界経済見通し2021年4月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

### (2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

### (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



## 委託会社の概況（2021年 6月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

## ロ．委託会社の沿革

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

## ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

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

### 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．株式と債券の基本資産配分比率は、株式50%、債券50%とします。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率に基づき決定します。また、各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、年1回見直しを行います。
- ホ．各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によって

は、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

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



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

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

### 3. 運用制限

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

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。

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

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

投資信託財産に属する資産の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並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

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

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

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

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及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

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

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

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

## 3. 運用制限

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。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

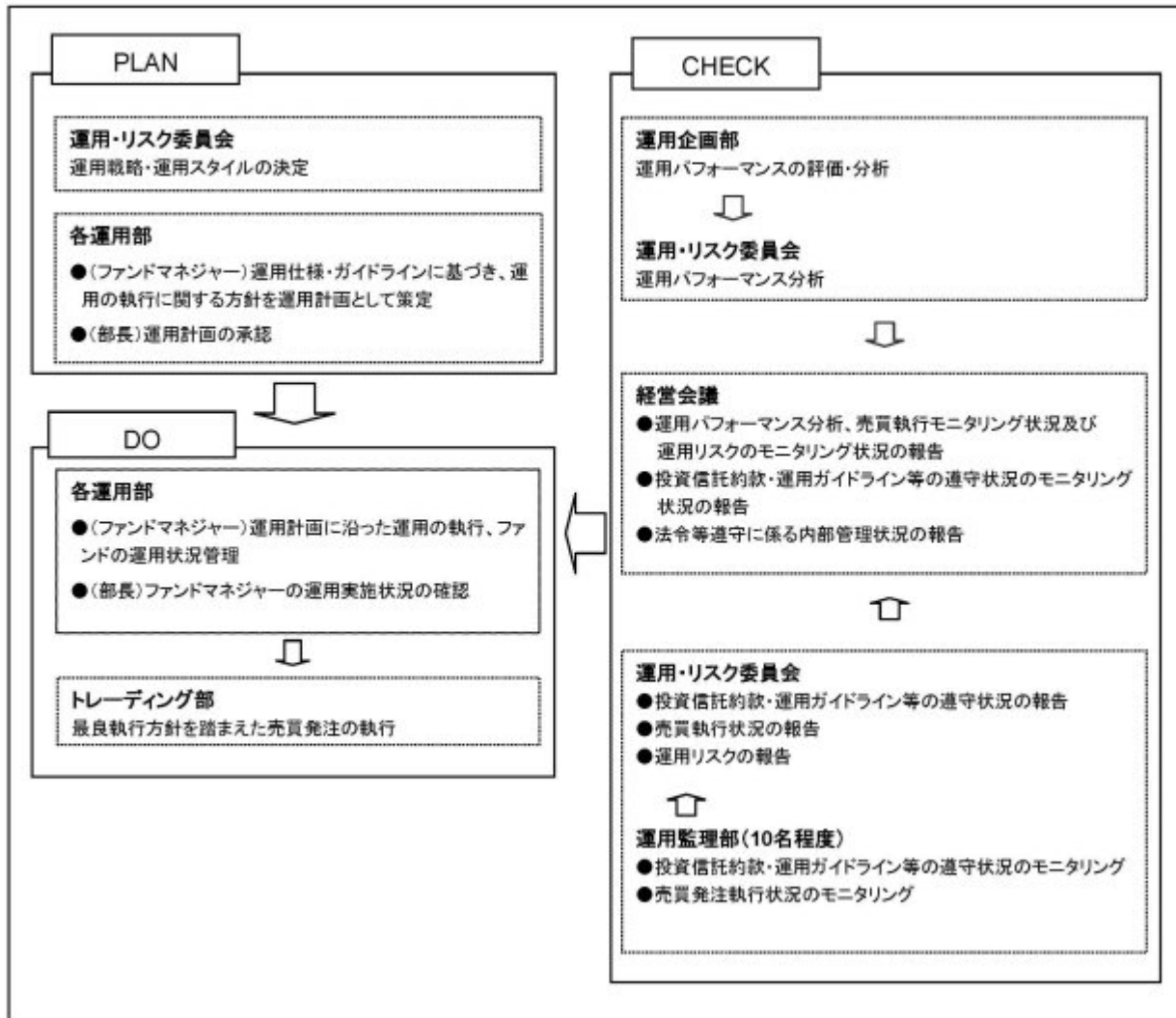
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。



## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

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

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

#### ニ．投資する株式等の範囲

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

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証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新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価

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

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

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

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

a.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する

株式の時価合計額を超えないものとします。

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

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

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

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

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

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

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、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、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 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6月の2年11ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年7月～2021年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。

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

## 各資産クラスの指数について

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

取得申込受付日の翌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、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

#### （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間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

## 八．損益通算について

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

### 二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」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。

二．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について」をご参照ください。）

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

上記は、2021年6月30日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2021年6月30日現在の状況について記載してあります。

### 【SMT 世界経済インデックス・オープン】

#### (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	2,129,753,924	99.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,423,960	0.81
合計(純資産総額)		2,147,177,884	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	160,966,313	3.7766	607,920,385	3.8524	620,106,624	28.88
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	180,872,493	3.0825	557,544,178	3.0662	554,591,238	25.83
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	115,361,977	3.8325	442,127,279	3.8841	448,077,454	20.87
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	228,262,598	1.8057	412,196,401	1.7884	408,224,830	19.01
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	34,599,331	1.8872	65,298,135	1.8770	64,942,944	3.02
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	23,994,631	1.4111	33,860,116	1.4091	33,810,834	1.57

(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	99.19
合計	99.19

(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 (2018年 6月11日)	133,663,474	133,663,474	10,190	10,190
第2期計算期間末 (2019年 6月10日)	610,160,593	610,160,593	10,100	10,100
第3期計算期間末 (2020年 6月10日)	1,156,132,494	1,156,132,494	10,679	10,679
第4期計算期間末 (2021年 6月10日)	2,100,019,595	2,100,019,595	12,927	12,927
2020年 6月末日	1,160,896,264		10,481	
7月末日	1,246,261,511		10,723	
8月末日	1,336,356,028		11,072	
9月末日	1,359,656,701		10,806	
10月末日	1,408,417,775		10,746	
11月末日	1,532,054,101		11,455	
12月末日	1,610,416,089		11,703	
2021年 1月末日	1,706,926,268		11,942	
2月末日	1,758,193,615		12,123	
3月末日	1,882,069,370		12,438	
4月末日	1,973,629,737		12,682	
5月末日	2,061,676,979		12,845	
6月末日	2,147,177,884		12,989	

### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	0
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	0
第4期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6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～2018年 6月11日	1.9
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0.9
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	5.7
第4期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	21.1

(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～2018年 6月11日	210,699,013	79,527,897	131,171,116
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	507,695,592	34,729,041	604,137,667
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	609,862,541	131,375,478	1,082,624,730
第4期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	692,206,929	150,265,737	1,624,565,922

(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	465,886,191,040	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,342,863,358	0.92
合計(純資産総額)		470,229,054,398	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	4,410,610,000	0.94

(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	1,769,500	9,122.12	16,141,593,600	9,710.00	17,181,845,000	3.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,094,200	10,785.01	11,800,968,100	10,815.00	11,833,773,000	2.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,360,100	8,250.78	11,221,888,400	7,775.00	10,574,777,500	2.25
日本	株式	キーエンス	電気機器	171,500	53,896.32	9,243,220,500	56,070.00	9,616,005,000	2.04
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,785,000	619.80	7,304,447,200	600.10	7,072,178,500	1.50
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,195,700	5,554.46	6,641,469,300	5,470.00	6,540,479,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	100,000	67,664.26	6,766,426,100	64,620.00	6,462,000,000	1.37
日本	株式	信越化学工業	化学	316,300	18,851.45	5,962,713,700	18,580.00	5,876,854,000	1.25
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,004,900	2,931.06	5,876,497,600	2,894.50	5,803,183,050	1.23
日本	株式	日本電産	電気機器	420,500	12,533.41	5,270,300,400	12,875.00	5,413,937,500	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,453,300	3,719.11	5,404,991,500	3,719.00	5,404,822,700	1.15
日本	株式	日立製作所	電気機器	839,800	5,742.50	4,822,554,300	6,361.00	5,341,967,800	1.14
日本	株式	HOYA	精密機器	340,800	14,355.02	4,892,191,170	14,730.00	5,019,984,000	1.07
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	102,300	48,655.58	4,977,466,600	48,080.00	4,918,584,000	1.05
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,375,300	3,355.11	4,614,295,900	3,550.00	4,882,315,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,374,600	3,714.22	5,105,577,200	3,465.00	4,762,989,000	1.01
日本	株式	ダイキン工業	機械	222,500	21,596.50	4,805,222,600	20,690.00	4,603,525,000	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,192,200	3,949.96	4,709,152,726	3,830.00	4,566,126,000	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	513,200	8,280.03	4,249,313,900	8,482.00	4,352,962,400	0.93
日本	株式	ファナック	電気機器	153,300	26,304.89	4,032,540,700	26,795.00	4,107,673,500	0.87
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,203,300	3,248.80	3,909,284,400	3,200.00	3,850,560,000	0.82
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,341,000	1,672.17	3,914,560,900	1,587.50	3,716,337,500	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	673,000	4,741.28	3,190,887,000	5,297.00	3,564,881,000	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	1,372,400	2,415.15	3,314,560,800	2,500.50	3,431,686,200	0.73
日本	株式	S M C	機械	51,200	65,519.39	3,354,593,200	65,650.00	3,361,280,000	0.71

日本	株式	第一三共	医薬品	1,372,700	2,528.96	3,471,507,700	2,394.50	3,286,930,150	0.70
日本	株式	富士通	電気機器	157,200	17,813.62	2,800,302,300	20,800.00	3,269,760,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,047,400	2,984.63	3,126,102,900	3,028.00	3,171,527,200	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,514,500	1,799.34	2,725,111,850	1,934.50	2,929,800,250	0.62
日本	株式	デンソー	輸送用機器	384,600	7,504.61	2,886,275,700	7,579.00	2,914,883,400	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	0.18
		建設業	2.28
		食料品	3.36
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.30
		医薬品	5.24
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.62
		機械	5.33
		電気機器	18.00
		輸送用機器	7.82
		精密機器	2.70
		その他製品	2.43
		電気・ガス業	1.19
		陸運業	3.35
		海運業	0.34
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	8.69
		卸売業	4.71
小売業	4.59		
銀行業	4.89		
証券、商品先物取引業	0.76		
保険業	1.80		
その他金融業	1.08		

	不動産業	2.00
	サービス業	5.62
	小計	99.08
合計		99.08

(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	227	円	4,430,549,650	4,410,610,000	0.94

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

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

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	532,306,379,550	83.89
地方債証券	日本	34,994,434,799	5.52
特殊債券	日本	38,802,342,157	6.12
社債券	日本	26,977,070,380	4.25
	フランス	1,101,523,000	0.17
	オーストラリア	399,724,000	0.06
	小計	28,478,317,380	4.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		90,126,857	0.01
合計(純資産総額)		634,491,347,029	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	100.95	8,318,362,400	100.95	8,318,609,600	0.100	2025/9/20	1.31
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	7,960,000,000	101.05	8,044,137,200	101.18	8,054,007,600	0.100	2028/3/20	1.27
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,790,000,000	100.74	7,848,113,400	100.74	7,847,957,600	0.100	2024/9/20	1.24
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,970,000,000	100.60	7,011,820,000	100.57	7,009,729,000	0.100	2023/12/20	1.10
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	100.54	6,796,706,800	100.49	6,793,124,000	0.100	2023/9/20	1.07
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	100.98	6,705,404,000	101.02	6,707,927,200	0.100	2026/9/20	1.06
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,520,000,000	100.91	6,579,723,200	100.91	6,579,788,400	0.100	2025/6/20	1.04
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	102.24	6,462,136,800	102.22	6,460,809,600	0.400	2025/9/20	1.02
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	101.01	6,414,706,500	101.09	6,419,342,000	0.100	2027/3/20	1.01
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	100.70	6,344,352,000	100.68	6,343,155,000	0.100	2024/6/20	1.00
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	6,070,000,000	100.66	6,110,062,000	100.62	6,108,058,900	0.100	2024/3/20	0.96
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	5,740,000,000	100.46	5,766,404,000	100.69	5,779,606,000	0.100	2030/9/20	0.91
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	5,700,000,000	100.35	5,720,406,000	100.32	5,718,468,000	0.100	2022/12/20	0.90
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	100.80	5,423,201,400	100.80	5,423,147,600	0.100	2024/12/20	0.85
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	5,220,000,000	100.96	5,270,112,000	100.97	5,270,686,200	0.100	2026/3/20	0.83
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	4,860,000,000	102.23	4,968,378,000	102.17	4,965,753,600	0.600	2024/6/20	0.78
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	4,920,000,000	100.34	4,936,773,600	100.56	4,947,847,200	0.100	2030/12/20	0.78
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	4,880,000,000	101.04	4,930,947,200	101.15	4,936,461,600	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	101.87	4,889,760,000	101.78	4,885,632,000	0.600	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	4,780,000,000	102.13	4,881,814,000	102.11	4,881,049,200	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	4,820,000,000	100.96	4,866,464,800	101.02	4,869,356,800	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	100.85	4,841,232,000	100.85	4,841,232,000	0.100	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	4,730,000,000	100.29	4,744,110,200	100.43	4,750,528,200	0.100	2031/3/20	0.75
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	4,690,000,000	100.89	4,732,116,200	101.12	4,742,621,800	0.100	2029/3/20	0.75
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	4,640,000,000	100.78	4,676,563,200	101.02	4,687,745,600	0.100	2029/9/20	0.74
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	4,610,000,000	101.01	4,656,987,900	101.19	4,665,181,700	0.100	2028/9/20	0.74
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	101.02	4,657,252,500	101.19	4,664,859,000	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	102.00	4,651,382,400	101.98	4,650,288,000	0.400	2025/3/20	0.73
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	4,590,000,000	101.20	4,645,447,200	101.11	4,641,086,700	0.800	2022/9/20	0.73
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	4,540,000,000	100.54	4,564,534,100	100.76	4,574,549,400	0.100	2030/6/20	0.72

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	83.89
地方債証券	5.52
特殊債券	6.12
社債券	4.49
合計	100.01

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	349,535,332,093	65.95
	イギリス	22,424,105,718	4.23
	カナダ	18,634,287,162	3.52
	スイス	17,428,674,094	3.29
	フランス	17,292,121,072	3.26
	ドイツ	15,291,382,444	2.89
	オーストラリア	10,457,934,456	1.97
	オランダ	9,916,926,295	1.87
	アイルランド	9,357,560,689	1.77
	スウェーデン	5,730,712,701	1.08
	デンマーク	4,213,740,838	0.80
	スペイン	4,071,706,164	0.77
	香港	3,764,275,728	0.71
	イタリア	3,117,806,593	0.59
	フィンランド	2,108,450,390	0.40
	ジャージー	1,752,456,548	0.33
	シンガポール	1,477,796,889	0.28

	ベルギー	1,438,040,342	0.27
	バミューダ	1,249,546,079	0.24
	ノルウェー	1,067,499,947	0.20
	ケイマン	1,033,551,690	0.20
	イスラエル	981,012,023	0.19
	ニュージーランド	542,240,464	0.10
	ルクセンブルク	531,266,094	0.10
	キュラソー	432,433,272	0.08
	オーストリア	311,293,242	0.06
	ポルトガル	246,945,981	0.05
	パナマ	201,035,059	0.04
	リベリア	176,835,223	0.03
	マン島	135,303,688	0.03
	パプアニューギニア	58,476,770	0.01
	小計	504,980,749,748	95.28
投資信託受益証券	オーストラリア	207,608,601	0.04
	香港	80,793,772	0.02
	小計	288,402,373	0.05
投資証券	アメリカ	9,779,831,274	1.85
	オーストラリア	733,584,987	0.14
	イギリス	309,531,149	0.06
	フランス	272,494,047	0.05
	シンガポール	226,260,833	0.04
	香港	184,400,524	0.03
	カナダ	76,591,962	0.01
	小計	11,582,694,776	2.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,151,153,919	2.48
合計(純資産総額)		530,003,000,816	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	9,612,122,268	1.81
	買建	カナダ	794,290,840	0.15
	買建	ドイツ	1,592,473,405	0.30
	買建	イギリス	516,087,936	0.10
	買建	オーストラリア	390,082,160	0.07

(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		1,292,606,690	0.24
	売建		26,316,400	0.00

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
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	13,779.37	19,991,542,670	15,075.37	21,871,816,164	4.13
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	619,180	27,609.61	17,095,321,044	30,011.41	18,582,466,082	3.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,986	356,407.08	13,182,072,283	381,295.32	14,102,588,750	2.66
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	207,790	36,350.96	7,553,366,684	38,911.99	8,085,523,690	1.53
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	25,465	266,670.30	6,790,759,311	278,702.51	7,097,159,534	1.34
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,977	260,620.47	6,770,138,027	270,417.86	7,024,644,775	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,189	69,136.82	4,576,097,482	75,278.44	4,982,604,718	0.94
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	53,433	71,852.67	3,839,303,845	88,582.32	4,733,219,137	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	263,503	18,161.65	4,785,651,685	17,044.80	4,491,356,251	0.85
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	18,715.66	4,247,838,338	18,138.43	4,116,826,721	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	146,419	25,134.83	3,680,217,259	26,091.35	3,820,269,522	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	118,353	32,006.27	3,788,038,689	30,543.30	3,614,891,398	0.68
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,910	45,550.11	3,731,009,805	44,021.89	3,605,833,665	0.68

スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,795	13,339.95	3,318,914,353	13,961.81	3,473,629,763	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	92,922	35,265.06	3,276,900,630	35,190.97	3,270,016,169	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	212,538	14,911.71	3,169,305,657	14,861.95	3,158,729,554	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	76,521	39,872.93	3,051,116,966	40,693.43	3,113,902,722	0.59
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	95,999	28,753.01	2,760,260,360	32,373.40	3,107,814,103	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	670,589	4,687.48	3,143,376,683	4,521.61	3,032,146,086	0.57
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	156,656	19,755.11	3,094,757,609	19,233.17	3,012,992,952	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	36,125	72,671.63	2,625,262,778	77,619.04	2,803,987,892	0.53
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	41,289	55,796.45	2,303,779,888	65,325.13	2,697,209,499	0.51
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	37,887.77	2,305,622,964	41,873.44	2,548,166,318	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	365,193	6,454.55	2,357,158,158	6,924.51	2,528,786,086	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	394,334	6,340.65	2,500,336,716	6,252.19	2,465,452,353	0.47
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	38,504	55,600.72	2,140,850,500	58,994.43	2,271,521,533	0.43
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	356,926	6,246.66	2,229,596,866	6,174.78	2,203,942,096	0.42
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	350,418	6,316.32	2,213,355,585	6,275.41	2,199,018,373	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	79,266	26,329.09	2,087,002,282	27,181.66	2,154,582,238	0.41
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	24,043	86,290.16	2,074,674,414	88,684.92	2,132,251,532	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	3.22
		素材	4.26
		資本財	6.30
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	2.01
		自動車・自動車部品	1.95
		耐久消費財・アパレル	2.02



	消費者サービス	1.78
	メディア・娯楽	7.24
	小売	5.51
	食品・生活必需品小売り	1.30
	食品・飲料・タバコ	3.82
	家庭用品・パーソナル用品	1.71
	ヘルスケア機器・サービス	5.01
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.38
	銀行	5.93
	各種金融	4.60
	保険	2.94
	不動産	0.47
	ソフトウェア・サービス	11.97
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.62
	電気通信サービス	1.67
	公益事業	2.80
	半導体・半導体製造装置	4.58
	小計	95.28
投資信託受益証券		0.05
投資証券		2.19
合計		97.52

(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	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	406	アメリカドル	86,255,449.5	9,538,127,606	86,924,600	9,612,122,268	1.81
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	37	カナダドル	8,869,288.5	790,697,070	8,909,600	794,290,840	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	36	スイスフラン	4,293,292	515,409,705	4,327,920	519,566,796	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	199	ユーロ	8,206,660.5	1,079,832,388	8,154,025	1,072,906,609	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	26	オーストラリアドル	4,732,532	393,368,060	4,693,000	390,082,160	0.07
	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	48	イギリスポンド	3,401,220	520,930,855	3,369,600	516,087,936	0.10

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	9,500,000.00	1,049,940,000	1,050,497,650	0.20
	ユーロ	買建	1,840,000.00	242,361,120	242,109,040	0.05
	ユーロ	売建	200,000.00	26,313,600	26,316,400	0.00

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

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

## 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	133,616,681,326	43.39
	フランス	30,278,921,967	9.83
	イタリア	28,280,800,479	9.18
	ドイツ	22,706,864,757	7.37
	イギリス	19,581,506,168	6.36
	スペイン	17,701,169,568	5.75
	ベルギー	7,112,898,090	2.31
	オーストラリア	6,376,923,435	2.07
	カナダ	6,104,498,135	1.98
	オランダ	5,802,790,540	1.88
	オーストリア	4,458,653,237	1.45
	アイルランド	2,484,924,050	0.81
	メキシコ	2,418,253,415	0.79
	ポーランド	1,874,223,092	0.61
	フィンランド	1,869,439,204	0.61
	デンマーク	1,505,060,668	0.49
	マレーシア	1,443,205,267	0.47
	イスラエル	1,390,333,035	0.45
	シンガポール	1,288,449,588	0.42
	スウェーデン	1,082,746,908	0.35
ノルウェー	747,216,137	0.24	
	小計	298,125,559,066	96.82

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,805,730,755	3.18
合計(純資産総額)		307,931,289,821	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	3,217,553,229	1.04
	買建	ドイツ	3,954,840,849	1.28

(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		7,550,677,500	2.45

(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	10,196.68	1,626,371,341	10,285.66	1,640,564,015	0.625	2030/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,613.95	1,597,399,803	10,716.75	1,612,871,941	1.125	2031/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,238.15	1,443,579,576	10,321.08	1,455,273,411	0.625	2030/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	11,059.72	1,437,764,616	11,014.37	1,431,868,459	0.250	2024/3/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,629.09	1,251,782,878	9,894.31	1,286,261,384	1.375	2040/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,930.54	1,282,533,621	11,898.58	1,279,097,440	2.375	2027/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	10,937.05	1,257,761,110	10,888.24	1,252,147,882	0.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,055.84	1,216,142,429	11,006.16	1,210,678,219	0.750	2026/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,096.41	1,208,431,889	12,112.82	1,210,071,675	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,705.92	1,196,346,013	11,665.75	1,192,240,474	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,758.19	1,193,456,892	11,692.10	1,186,748,879	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,405.75	1,160,241,218	10,497.32	1,170,451,726	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,355.39	1,135,539,972	11,331.85	1,133,185,834	2.000	2022/10/31	0.37

アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,248.49	1,124,849,130	11,231.86	1,123,186,117	1.500	2022/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,083.48	1,124,973,754	11,064.91	1,123,088,492	0.250	2023/4/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,029.05	1,102,905,911	10,991.91	1,099,191,120	0.125	2024/1/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,286.47	1,095,953,542	12,286.47	1,095,953,542	2.875	2028/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,903.79	1,090,379,276	10,849.36	1,084,936,661	0.250	2025/7/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,243.30	1,073,735,900	11,226.46	1,072,127,098	1.750	2022/5/31	0.35
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	22,707.94	1,071,814,995	22,674.12	1,070,218,877	4.500	2041/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,681.33	1,068,133,688	10,682.20	1,068,220,084	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,259.50	1,069,653,087	11,242.01	1,067,991,148	1.500	2022/9/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,854.08	1,060,941,022	11,814.78	1,057,422,977	2.250	2027/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,488.62	1,049,044,815	12,496.40	1,049,697,933	3.125	2028/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	9,900,000	10,113.75	1,001,261,299	10,505.96	1,040,090,428	1.875	2051/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	16,114.86	1,028,128,435	16,103.68	1,027,414,877	2.500	2030/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,425.16	1,028,264,419	11,362.52	1,022,627,423	1.375	2025/1/31	0.33
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,290.60	1,016,154,612	11,270.95	1,014,385,758	1.875	2022/7/31	0.33
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,843.29	1,012,601,366	11,820.82	1,010,680,902	2.250	2027/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,600.99	1,007,094,396	10,591.92	1,006,232,642	0.375	2027/7/31	0.33

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.82
合計	96.82

(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	90	アメリカ ドル	11,127,672.4	1,230,498,014	11,103,047.1	1,227,774,948	0.40
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	61	アメリカ ドル	8,060,343.66	891,312,802	8,068,203.43	892,181,935	0.29
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	62	アメリカ ドル	9,810,884.85	1,084,887,646	9,925,812.5	1,097,596,346	0.36
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	40	ユーロ	4,486,184	590,292,091	4,485,200	590,162,616	0.19
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	56	ユーロ	7,508,757.6	988,002,325	7,504,000	987,376,320	0.32

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	105	ユーロ	18,050,860.5	2,375,132,224	18,067,350	2,377,301,913	0.77
-----	-----------------------	-----------	----	-----	-----	--------------	---------------	------------	---------------	------

(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	31,510,000.00	3,464,435,421	3,483,745,600	1.13
	カナダドル	買建	3,710,000.00	334,077,980	330,709,400	0.11
	ユーロ	買建	24,400,000.00	3,235,338,319	3,210,918,000	1.04
	イギリスポンド	買建	3,430,000.00	529,195,762	525,304,500	0.17

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

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

## 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	23,601,737,382	23.02
	台湾	12,901,786,437	12.58
	韓国	12,576,130,099	12.27
	中国	10,743,970,207	10.48
	インド	9,518,773,215	9.28
	ブラジル	4,862,547,473	4.74
	南アフリカ	3,257,096,518	3.18
	サウジアラビア	2,738,446,208	2.67
	ロシア	2,619,565,379	2.55
	メキシコ	1,605,069,624	1.57
	タイ	1,540,207,763	1.50
	マレーシア	1,179,203,760	1.15
	香港	1,057,662,602	1.03
	インドネシア	1,049,655,598	1.02
	アラブ首長国連邦	658,673,356	0.64
	バミューダ	647,678,250	0.63
	カタール	623,626,537	0.61
	ポーランド	621,182,299	0.61
	フィリピン	614,935,016	0.60

	クウェート	487,457,879	0.48
	チリ	439,436,439	0.43
	アメリカ	377,650,852	0.37
	オランダ	235,366,186	0.23
	ルクセンブルク	229,557,235	0.22
	トルコ	223,410,326	0.22
	ハンガリー	216,486,908	0.21
	キプロス	137,422,281	0.13
	コロンビア	136,275,552	0.13
	ギリシャ	126,173,387	0.12
	チェコ	94,829,466	0.09
	ジャージー	86,028,057	0.08
	エジプト	50,940,163	0.05
	英ヴァージン諸島	47,845,878	0.05
	パキスタン	30,537,534	0.03
	マン島	25,838,080	0.03
	シンガポール	22,402,083	0.02
	ペルー	16,474,651	0.02
	アルゼンチン	7,804,189	0.01
	小計	95,409,884,869	93.05
投資信託受益証券	ブラジル	219,092,478	0.21
	メキシコ	33,716,399	0.03
	小計	252,808,877	0.25
投資証券	メキシコ	37,802,137	0.04
	南アフリカ	33,532,681	0.03
	小計	71,334,818	0.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,800,186,588	6.63
合計(純資産総額)		102,534,215,152	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,824,946,733	6.66

(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		667,059,068	0.65
	売建		269,455	0.00

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,476,389	1,826.78	4,523,830,824	2,357.21	5,837,372,629	5.69
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	578,800	8,868.02	5,132,812,995	8,408.72	4,866,967,136	4.75
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,523,688	3,996.40	6,089,271,646	3,124.25	4,760,391,376	4.64
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	5,918.08	2,832,240,947	7,921.79	3,791,167,513	3.70
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	364,500	4,763.27	1,736,213,234	4,610.91	1,680,677,424	1.64
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	43,648	25,947.87	1,132,572,940	23,379.66	1,020,475,574	1.00
ブラジル	株式	VALE SA	素材	393,678	1,474.74	580,575,873	2,509.37	987,886,926	0.96
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	285,779	3,080.52	880,348,888	3,131.69	894,974,094	0.87
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,450,620	84.15	795,349,058	87.00	822,264,424	0.80
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	342,781	1,715.85	588,162,991	2,344.57	803,675,763	0.78
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	85,581	9,383.81	803,076,597	8,818.75	754,717,872	0.74
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	132,230	4,966.62	656,737,022	5,566.59	736,071,148	0.72
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	629,500	1,194.83	752,146,702	1,090.78	686,648,528	0.67
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	1,177.73	393,952,948	2,051.98	686,388,648	0.67
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	54,927	8,568.47	470,640,551	12,225.00	671,482,575	0.65
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	44,003	12,971.01	570,763,457	14,767.95	649,834,500	0.63
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	170,867	3,247.45	554,883,121	3,751.80	641,058,811	0.63
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	26,907	15,944.53	429,019,474	22,964.14	617,896,346	0.60
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	83,239	5,439.13	452,748,364	7,237.20	602,417,291	0.59

台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	152,804	2,817.77	430,566,909	3,704.18	566,014,972	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	1,255,248	326.58	409,942,670	441.72	554,480,134	0.54
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,405,800	373.94	525,688,226	390.88	549,510,350	0.54
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	40,751	9,713.34	395,828,612	12,687.94	517,046,618	0.50
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	12,477	29,445.72	367,394,318	40,244.70	502,133,122	0.49
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	268,967	1,383.04	371,993,967	1,854.42	498,779,559	0.49
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	511,368	702.46	359,218,335	960.14	490,989,985	0.48
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	575,861	488.76	281,459,896	833.77	480,137,469	0.47
韓国	株式	KAKAO CORP	メディア・娯楽	30,701	7,525.98	231,055,161	15,452.39	474,404,132	0.46
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	94,235	4,105.22	386,856,252	5,011.27	472,237,500	0.46
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	124,491	2,067.80	257,422,490	3,261.21	405,992,041	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	4.65
		素材	7.80
		資本財	2.54
		商業・専門サービス	0.31
		運輸	1.65
		自動車・自動車部品	3.55
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.05
		メディア・娯楽	8.31
		小売	10.20
		食品・生活必需品小売り	1.07
		食品・飲料・タバコ	3.14
		家庭用品・パーソナル用品	0.97
		ヘルスケア機器・サービス	1.23
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.56
		銀行	11.93
		各種金融	2.16
		保険	2.44
不動産	1.79		



		ソフトウェア・サービス	2.42
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.24
		電気通信サービス	2.26
		公益事業	1.83
		半導体・半導体製造装置	8.33
		小計	93.05
投資信託受益証券			0.25
投資証券			0.07
合計			93.37

(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	898	アメリカドル	61,281,496	6,776,507,827	61,719,540	6,824,946,733	6.66

(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	6,032,443.96	666,733,171	667,059,068	0.65
	ブラジルリアル	売建	12,081.24	271,071	269,455	0.00

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

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

#### 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	7,163,894,261	9.86
	インドネシア	7,007,318,764	9.65
	メキシコ	6,766,898,369	9.32

	ブラジル	6,527,388,843	8.99
	タイ	6,229,246,994	8.57
	ポーランド	5,713,347,615	7.86
	南アフリカ	5,434,390,869	7.48
	ロシア	5,386,600,845	7.41
	マレーシア	5,184,850,102	7.14
	コロンビア	3,091,853,535	4.26
	チェコ	3,005,304,011	4.14
	ハンガリー	2,783,659,037	3.83
	チリ	1,581,898,317	2.18
	ペルー	1,539,607,307	2.12
	トルコ	1,226,850,488	1.69
	ウルグアイ	98,392,956	0.14
	ドミニカ共和国	96,512,491	0.13
	フィリピン	89,359,362	0.12
	小計	68,927,374,166	94.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,717,655,204	5.12
合計(純資産総額)		72,645,029,370	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000	3.79	2,745,981,903	3.50	2,533,833,934	9.850	2027/6/28	3.49
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000	1,868.49	1,565,799,290	1,847.89	1,548,536,731	0.000	2024/1/1	2.13
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	46,650,000	2,433.85	1,135,392,093	2,317.47	1,081,102,353	10.000	2023/1/1	1.49
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	121,100,000	907.75	1,099,294,245	874.96	1,059,584,310	10.500	2026/12/21	1.46
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,929.93	988,127,046	1,928.10	987,190,766	0.000	2023/7/1	1.36
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000	2,524.54	848,246,947	2,360.33	793,072,655	10.000	2025/1/1	1.09
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000	2,922.29	796,325,213	2,794.90	761,612,949	3.885	2029/8/15	1.05
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000	2,535.22	796,060,411	2,372.20	744,873,501	10.000	2027/1/1	1.03
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,841.02	738,667,310	2,811.86	731,083,988	3.955	2025/9/15	1.01
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000	661.23	772,979,009	614.28	718,101,103	8.500	2029/5/31	0.99
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000	421.50	753,229,588	388.62	694,467,157	3.300	2038/6/17	0.96
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000	734.38	699,131,438	727.71	692,788,774	8.000	2030/1/31	0.95

メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	621.43	675,193,682	581.63	631,948,795	7.500	2027/6/3	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000	570.85	663,903,417	542.06	630,426,820	5.750	2026/3/5	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	664.18	665,844,857	623.24	624,804,970	10.000	2024/12/5	0.86
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,765.66	631,954,168	2,732.13	624,292,422	3.480	2023/3/15	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000	576.41	623,681,082	563.97	610,225,290	6.500	2022/6/9	0.84
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	93,600,000	624.38	584,423,294	648.68	607,170,564	8.750	2048/2/28	0.84
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	3,067.64	610,460,732	3,011.69	599,326,706	2.500	2023/1/25	0.83
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000	1,711.12	581,781,173	1,717.38	583,910,279	2.940	2024/10/17	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	612.64	600,081,657	584.71	572,730,201	8.000	2023/12/7	0.79
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	19,300,000,000	3.07	592,571,295	2.89	558,019,601	7.250	2034/10/18	0.77
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	17,600,000	3,221.99	567,071,340	3,067.11	539,812,796	2.500	2026/7/25	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000	583.10	539,955,554	568.19	526,150,317	6.750	2023/3/9	0.72
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,669.37	509,160,567	1,692.18	516,115,168	2.850	2027/6/4	0.71
中国	国債証券	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000	1,725.59	507,324,188	1,732.01	509,211,468	3.190	2024/4/11	0.70
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.5% 06/15/25	62,100,000,000	0.80	501,545,375	0.80	502,432,346	6.500	2025/6/15	0.69
中国	国債証券	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000	1,706.24	477,748,090	1,717.10	480,790,638	3.020	2025/10/22	0.66
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000	3,317.10	499,224,040	3,156.76	475,092,404	2.750	2029/10/25	0.65
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000	427.42	509,485,236	393.63	469,212,503	3.400	2036/6/17	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	94.88
合計	94.88

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

#### 投資不動産物件


該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績



## 運用実績

当初設定日：2017年8月25日

作成基準日：2021年6月30日

### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 12,989円

純資産総額 21.47億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年6月	0円
2019年6月	0円
2020年6月	0円
2021年6月	0円

設定来  
分配金合計額 0円

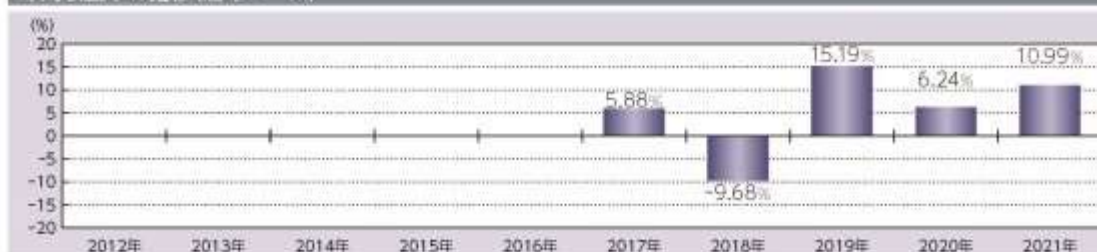
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	28.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア	-	-	1.2%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.0%
外国債券 インデックス マザーファンド	25.8%	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%
新興国株式 インデックス マザーファンド	20.9%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.2%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	1.0%
新興国債券 インデックス マザーファンド	19.0%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.7%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	3.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	1.6%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.0%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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て扱います。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

###### (ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

###### 外貨建資産等の円換算

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

##### < 基準価額の照会方法 >

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

###### (照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>



フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2017年 8月25日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2018年6月11日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

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

#### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

##### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファン

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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）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）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年6月11日から2021年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT 世界経済インデックス・オープン】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2020年 6月10日現在)	第4期 (2021年 6月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	10,853,284	19,326,385
親投資信託受益証券	1,127,300,133	2,082,157,057
未収入金	22,747,269	5,025,701
流動資産合計	1,160,900,686	2,106,509,143
資産合計	1,160,900,686	2,106,509,143
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,068,646	1,443,132
未払受託者報酬	267,288	499,655
未払委託者報酬	2,405,557	4,496,836
未払利息	15	21
その他未払費用	26,686	49,904
流動負債合計	4,768,192	6,489,548
負債合計	4,768,192	6,489,548
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,082,624,730	1,624,565,922
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	73,507,764	475,453,673
(分配準備積立金)	51,826,527	348,977,271
元本等合計	1,156,132,494	2,100,019,595
純資産合計	1,156,132,494	2,100,019,595
負債純資産合計	1,160,900,686	2,106,509,143

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日		自 2020年 6月11日 至 2021年 6月10日	
営業収益				
受取利息		25		75
有価証券売買等損益		55,418,898		324,791,730
営業収益合計		55,418,923		324,791,805
営業費用				
支払利息		4,694		5,526
受託者報酬		468,948		868,204
委託者報酬		4,220,441		7,813,678
その他費用		46,787		86,697
営業費用合計		4,740,870		8,774,105
営業利益又は営業損失（ ）		50,678,053		316,017,700
経常利益又は経常損失（ ）		50,678,053		316,017,700
当期純利益又は当期純損失（ ）		50,678,053		316,017,700
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,136,317		13,474,475
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,022,926		73,507,764
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,234,188		111,239,760
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		18,234,188		111,239,760
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,563,720		11,837,076
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,563,720		11,837,076
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		73,507,764		475,453,673

## (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3期 (2020年 6月10日現在)	第4期 (2021年 6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,082,624,730口	1,624,565,922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) 1.0679円 (10,679円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2927円 (12,927円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日			第4期 自 2020年 6月11日 至 2021年 6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	22,023,881円	費用控除後の配当等収益額	A	37,351,074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	20,627,646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	265,192,151円
収益調整金額	C	21,681,237円	収益調整金額	C	126,476,402円
分配準備積立金額	D	9,175,000円	分配準備積立金額	D	46,434,046円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	73,507,764円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	475,453,673円
当ファンドの期末残存口数	F	1,082,624,730口	当ファンドの期末残存口数	F	1,624,565,922口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	678円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,926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4期 自 2020年 6月11日 至 2021年 6月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第4期 (2021年 6月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第3期	第4期
	自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日	自 2020年 6月11日 至 2021年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	604,137,667円	1,082,624,730円
期中追加設定元本額	609,862,541円	692,206,929円
期中一部解約元本額	131,375,478円	150,265,737円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期 (2020年 6月10日現在)	第4期 (2021年 6月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	54,150,807	312,886,254
合計	54,150,807	312,886,254

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	113,039,592	433,145,108	
	国内株式インデックス マザーファンド	33,884,463	63,953,535	
	外国株式インデックス マザーファンド	159,796,273	603,470,624	
	国内債券インデックス マザーファンド	23,357,153	32,961,614	
	外国債券インデックス マザーファンド	176,921,490	545,413,569	
	新興国債券インデックス マザーファンド	223,250,433	403,212,607	
合計		730,249,404	2,082,157,057	

(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 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,616,241,549
株式	464,020,632,450
未収配当金	3,053,069,078
前払金	15,927,500
差入委託証拠金	275,780,000
流動資産合計	470,981,650,577
資産合計	470,981,650,577
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,929,150
未払金	23,821,800
未払解約金	268,232,190
未払利息	3,988
流動負債合計	307,987,128
負債合計	307,987,128
純資産の部	
元本等	
元本	249,370,614,913
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	221,303,048,536

	2021年 6月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	470,673,663,449
純資産合計	470,673,663,449
負債純資産合計	470,981,650,577

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 6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	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 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	249,370,614,913口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8874円 (1万口当たり純資産額) (18,874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 6月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 6月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	216,012,632,233円
期中追加設定元本額	83,173,284,652円
期中一部解約元本額	49,815,301,972円
期末元本額	249,370,614,913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）	425,271,167円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,863,395,910円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,712,867円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,414,264,300円
世界経済インデックスファンド	2,712,305,969円
日本株式インデックス・オープン	3,564,294,637円
DCマイセレクション25	6,039,036,822円
DCマイセレクション50	17,839,545,946円
DCマイセレクション75	17,463,706,723円
DC日本株式インデックス・オープン	5,785,059,266円

区分	2021年 6月10日現在
DCマイセレクションS25	2,851,830,470円
DCマイセレクションS50	8,427,294,901円
DCマイセレクションS75	5,943,455,762円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,491,524,070円
DCターゲット・イヤールファンド2025	248,501,027円
DCターゲット・イヤールファンド2035	649,731,331円
DCターゲット・イヤールファンド2045	463,105,665円
DC世界経済インデックスファンド	3,188,460,094円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,526,235,209円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	6,195,294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）	198,833,547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）	49,034,856円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	170,985,948円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,043,192円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	97,548,884円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,166,284,649円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	483,237,030円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,090,756,437円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	261,317,995円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	28,587,703円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	557,361,339円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	318,403,754円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	402,843,023円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	41,816,544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）	653,296,725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	1,859,307,814円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,637,915,929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	2,047,093,068円
分散投資コア戦略ファンドS	7,251,551,602円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	397,724,496円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	383,283,874円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,069,376,596円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	203,609,111円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,320,078円
SMT インデックスバランス・オープン	59,507,514円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	24,216,585,712円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	617,812,436円
SMT 世界経済インデックス・オープン	33,884,463円

区分	2021年 6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)	110,577,979円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	20,001,063円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,880,178円
グローバル経済コア	235,183,035円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	22,270,419円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	57,775,436円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	7,865,334円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,165,542,032円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	130,640,832円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	4,006,501円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2,720,610円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,153,087円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	827,938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)	42,452,043,414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)	1,190,363,256円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	162,635,515円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,534,021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)	46,537,434,312円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		7,995,489,208
合計		7,995,489,208

(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 6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	6,494,907,500	-	6,478,980,000	15,927,500
	合計	6,494,907,500	-	6,478,980,000	15,927,500

## (注)1.時価の算定方法

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



2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,600	2,947.00	22,397,200	
日本水産	217,900	547.00	119,191,300	
マルハニチロ	36,700	2,477.00	90,905,900	
雪国まいたけ	19,300	1,736.00	33,504,800	
カネコ種苗	7,100	1,501.00	10,657,100	
サカタのタネ	28,000	3,865.00	108,220,000	
ホクト	19,700	1,936.00	38,139,200	
ホクリヨウ	3,600	768.00	2,764,800	
住石ホールディングス	41,100	128.00	5,260,800	
日鉄鉱業	5,400	6,440.00	34,776,000	
三井松島ホールディングス	9,800	979.00	9,594,200	
I N P E X	862,800	815.00	703,182,000	
石油資源開発	30,700	2,037.00	62,535,900	
K & O エナジーグループ	11,400	1,363.00	15,538,200	
ヒノキヤグループ	5,800	2,554.00	14,813,200	
ショーボンドホールディングス	33,500	4,675.00	156,612,500	
ミライト・ホールディングス	81,300	1,939.00	157,640,700	
タマホーム	14,200	2,095.00	29,749,000	
サンヨーホームズ	2,700	730.00	1,971,000	
日本アクア	9,300	570.00	5,301,000	
ファーストコーポレーション	7,200	761.00	5,479,200	
ベステラ	4,500	1,595.00	7,177,500	
Robot Home	44,000	276.00	12,144,000	
キャンディル	4,000	558.00	2,232,000	
スペースバリューホールディングス	28,600	700.00	20,020,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,500	969.00	4,360,500	
第一カッター興業	5,800	1,416.00	8,212,800	
安藤・間	150,400	820.00	123,328,000	
東急建設	68,700	751.00	51,593,700	
コムシスホールディングス	83,200	3,220.00	267,904,000	
ピーアールホールディングス	31,400	514.00	16,139,600	
高松コンストラクショングループ	14,600	2,054.00	29,988,400	
東建コーポレーション	7,200	9,760.00	70,272,000	

ソネック	2,400	965.00	2,316,000
ヤマウラ	10,200	907.00	9,251,400
オリエンタル白石	78,900	294.00	23,196,600
大成建設	168,600	3,740.00	630,564,000
大林組	541,800	930.00	503,874,000
清水建設	507,500	939.00	476,542,500
飛鳥建設	15,500	1,085.00	16,817,500
長谷工コーポレーション	177,500	1,533.00	272,107,500
松井建設	21,300	727.00	15,485,100
銭高組	2,400	4,360.00	10,464,000
鹿島建設	397,000	1,491.00	591,927,000
不動テトラ	13,300	1,853.00	24,644,900
大末建設	6,800	1,028.00	6,990,400
鉄建建設	10,900	1,898.00	20,688,200
西松建設	38,800	3,395.00	131,726,000
三井住友建設	130,900	495.00	64,795,500
大豊建設	11,900	4,070.00	48,433,000
前田建設工業	135,700	985.00	133,664,500
佐田建設	12,500	483.00	6,037,500
ナカノフドー建設	13,000	408.00	5,304,000
奥村組	29,800	2,988.00	89,042,400
東鉄工業	23,200	2,357.00	54,682,400
イチケン	3,900	1,838.00	7,168,200
富士ピー・エス	7,000	569.00	3,983,000
浅沼組	6,500	4,610.00	29,965,000
戸田建設	225,000	795.00	178,875,000
熊谷組	25,100	2,912.00	73,091,200
北野建設	3,300	2,405.00	7,936,500
植木組	4,800	1,530.00	7,344,000
矢作建設工業	23,900	723.00	17,279,700
ピーエス三菱	17,800	654.00	11,641,200
日本ハウスホールディングス	37,000	352.00	13,024,000
大東建託	59,100	12,060.00	712,746,000
新日本建設	23,000	888.00	20,424,000
N I P P O	44,800	3,010.00	134,848,000
東亜道路工業	3,400	4,590.00	15,606,000
前田道路	33,500	2,221.00	74,403,500
日本道路	5,200	7,890.00	41,028,000
東亜建設工業	14,500	2,510.00	36,395,000
日本国土開発	52,700	584.00	30,776,800
若築建設	9,700	1,444.00	14,006,800
東洋建設	60,700	569.00	34,538,300

五洋建設	230,100	801.00	184,310,100	
世紀東急工業	26,000	876.00	22,776,000	
福田組	6,300	4,955.00	31,216,500	
住友林業	127,400	2,185.00	278,369,000	
日本基礎技術	16,500	507.00	8,365,500	
巴コーポレーション	24,100	390.00	9,399,000	
大和ハウス工業	500,300	3,348.00	1,675,004,400	
ライト工業	31,000	1,827.00	56,637,000	
積水ハウス	587,600	2,213.00	1,300,358,800	
日特建設	14,100	778.00	10,969,800	
北陸電気工事	9,400	1,222.00	11,486,800	
ユアテック	31,000	740.00	22,940,000	
日本リーテック	11,300	1,743.00	19,695,900	
四電工	2,900	3,335.00	9,671,500	
中電工	24,900	2,334.00	58,116,600	
関電工	88,100	910.00	80,171,000	
きんでん	110,000	1,872.00	205,920,000	
東京エネシス	18,000	989.00	17,802,000	
トーエネック	5,400	3,690.00	19,926,000	
住友電設	15,300	2,368.00	36,230,400	
日本電設工業	29,700	1,834.00	54,469,800	
協和エクシオ	82,100	2,723.00	223,558,300	
新日本空調	14,300	2,095.00	29,958,500	
九電工	38,000	3,480.00	132,240,000	
三機工業	38,400	1,430.00	54,912,000	
日揮ホールディングス	180,700	1,081.00	195,336,700	
中外炉工業	5,900	2,037.00	12,018,300	
ヤマト	17,300	804.00	13,909,200	
太平電業	12,000	2,666.00	31,992,000	
高砂熱学工業	49,000	1,844.00	90,356,000	
三晃金属工業	2,100	2,480.00	5,208,000	
朝日工業社	4,000	2,982.00	11,928,000	
明星工業	35,000	750.00	26,250,000	
大気社	26,300	3,400.00	89,420,000	
ダイダン	12,000	2,677.00	32,124,000	
日比谷総合設備	17,400	1,857.00	32,311,800	
フィル・カンパニー	3,100	2,957.00	9,166,700	
テスホールディングス	9,900	1,761.00	17,433,900	
東洋エンジニアリング	22,800	721.00	16,438,800	
レイズネクスト	29,100	1,164.00	33,872,400	
ニッポン	50,700	1,579.00	80,055,300	
日清製粉グループ本社	195,900	1,655.00	324,214,500	

日東富士製粉	1,300	7,020.00	9,126,000
昭和産業	14,600	3,005.00	43,873,000
鳥越製粉	15,400	795.00	12,243,000
中部飼料	21,200	1,193.00	25,291,600
フィード・ワン	23,300	771.00	17,964,300
東洋精糖	2,900	1,194.00	3,462,600
日本甜菜製糖	9,000	1,649.00	14,841,000
D M三井製糖ホールディングス	13,700	1,864.00	25,536,800
塩水港精糖	20,700	226.00	4,678,200
日新製糖	8,200	1,741.00	14,276,200
森永製菓	40,700	3,470.00	141,229,000
中村屋	4,200	3,780.00	15,876,000
江崎グリコ	47,700	4,300.00	205,110,000
名糖産業	7,600	1,554.00	11,810,400
井村屋グループ	9,800	2,329.00	22,824,200
不二家	11,100	2,191.00	24,320,100
山崎製パン	130,000	1,607.00	208,910,000
第一屋製パン	3,300	960.00	3,168,000
モロゾフ	2,800	5,390.00	15,092,000
亀田製菓	9,900	4,465.00	44,203,500
寿スピリッツ	16,700	7,880.00	131,596,000
カルビー	79,000	2,510.00	198,290,000
森永乳業	32,100	5,710.00	183,291,000
六甲バター	11,500	1,623.00	18,664,500
ヤクルト本社	119,300	6,230.00	743,239,000
明治ホールディングス	114,700	6,760.00	775,372,000
雪印メグミルク	41,700	2,183.00	91,031,100
プリマハム	24,400	2,962.00	72,272,800
日本ハム	66,300	4,365.00	289,399,500
林兼産業	5,700	618.00	3,522,600
丸大食品	17,100	1,707.00	29,189,700
S Foods	15,600	3,385.00	52,806,000
柿安本店	6,000	2,568.00	15,408,000
伊藤ハム米久ホールディングス	111,600	698.00	77,896,800
サッポロホールディングス	59,200	2,357.00	139,534,400
アサヒグループホールディングス	378,800	5,443.00	2,061,808,400
キリンホールディングス	735,400	2,300.00	1,691,420,000
宝ホールディングス	128,500	1,504.00	193,264,000
オエノンホールディングス	49,300	381.00	18,783,300
養命酒製造	5,300	1,855.00	9,831,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,800	1,845.00	245,016,000
サントリー食品インターナショナル	116,000	4,235.00	491,260,000

ダイドーグループホールディングス	9,800	5,090.00	49,882,000
伊藤園	52,600	6,640.00	349,264,000
キーコーヒー	17,000	2,111.00	35,887,000
ユニカフェ	5,200	999.00	5,194,800
ジャパンフーズ	2,500	1,214.00	3,035,000
日清オイリオグループ	22,200	3,070.00	68,154,000
不二製油グループ本社	42,300	2,775.00	117,382,500
かどや製油	1,900	4,035.00	7,666,500
J・オイルミルズ	16,200	1,931.00	31,282,200
キッコーマン	124,800	7,180.00	896,064,000
味の素	412,400	2,641.50	1,089,354,600
ブルドックソース	7,900	2,265.00	17,893,500
キューピー	96,500	2,577.00	248,680,500
ハウス食品グループ本社	64,800	3,265.00	211,572,000
カゴメ	70,900	3,005.00	213,054,500
焼津水産化学工業	8,400	984.00	8,265,600
アリアケジャパン	15,800	6,800.00	107,440,000
ピエトロ	2,300	1,684.00	3,873,200
エバラ食品工業	3,800	2,556.00	9,712,800
やまみ	1,900	1,943.00	3,691,700
ニチレイ	82,600	2,878.00	237,722,800
東洋水産	89,200	4,290.00	382,668,000
イトアンドホールディングス	6,000	1,890.00	11,340,000
大冷	1,900	1,963.00	3,729,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,700	778.00	7,546,600
日清食品ホールディングス	68,000	7,830.00	532,440,000
永谷園ホールディングス	8,500	2,190.00	18,615,000
一正蒲鉾	6,700	969.00	6,492,300
フジッコ	18,800	1,931.00	36,302,800
ロック・フィールド	18,700	1,519.00	28,405,300
日本たばこ産業	929,700	2,188.00	2,034,183,600
ケンコーマヨネーズ	10,600	1,675.00	17,755,000
わらべや日洋ホールディングス	11,300	2,070.00	23,391,000
なとり	9,700	1,893.00	18,362,100
イフジ産業	2,700	942.00	2,543,400
ピククルスコーポレーション	4,100	3,270.00	13,407,000
ファーマフーズ	16,400	2,892.00	47,428,800
北の達人コーポレーション	60,500	485.00	29,342,500
ユーグレナ	88,300	878.00	77,527,400
紀文食品	10,100	1,487.00	15,018,700
ミヨシ油脂	6,100	1,241.00	7,570,100
理研ビタミン	16,400	1,558.00	25,551,200

片倉工業	23,000	1,545.00	35,535,000
グンゼ	12,500	4,750.00	59,375,000
東洋紡	67,200	1,355.00	91,056,000
ユニチカ	50,900	376.00	19,138,400
富士紡ホールディングス	8,300	4,090.00	33,947,000
倉敷紡績	15,900	2,027.00	32,229,300
シキボウ	9,500	952.00	9,044,000
日本毛織	56,200	1,002.00	56,312,400
トーア紡コーポレーション	6,700	464.00	3,108,800
帝国繊維	19,300	2,124.00	40,993,200
帝人	159,500	1,785.00	284,707,500
東レ	1,225,800	752.00	921,801,600
サカイオーベックス	4,600	3,040.00	13,984,000
住江織物	3,700	1,888.00	6,985,600
日本フェルト	10,700	452.00	4,836,400
イチカワ	2,600	1,367.00	3,554,200
日東製網	1,800	1,534.00	2,761,200
アツギ	13,300	617.00	8,206,100
ダイニック	6,400	775.00	4,960,000
セーレン	41,800	2,119.00	88,574,200
ソトー	7,000	806.00	5,642,000
東海染工	2,300	1,136.00	2,612,800
小松マテーレ	28,000	959.00	26,852,000
ワコールホールディングス	42,300	2,581.00	109,176,300
ホギメディカル	22,900	3,485.00	79,806,500
T S Iホールディングス	52,100	354.00	18,443,400
マツオカコーポレーション	5,500	1,786.00	9,823,000
ワールド	22,300	1,602.00	35,724,600
三陽商会	8,800	1,017.00	8,949,600
ナイガイ	6,800	330.00	2,244,000
オンワードホールディングス	102,400	383.00	39,219,200
ルックホールディングス	5,900	1,577.00	9,304,300
ゴールドウイン	28,000	6,640.00	185,920,000
デサント	29,000	2,412.00	69,948,000
キング	9,400	528.00	4,963,200
ヤマトインターナショナル	15,500	342.00	5,301,000
特種東海製紙	10,400	4,355.00	45,292,000
王子ホールディングス	761,700	652.00	496,628,400
日本製紙	74,800	1,283.00	95,968,400
三菱製紙	24,000	369.00	8,856,000
北越コーポレーション	121,000	587.00	71,027,000
中越パルプ工業	6,400	1,247.00	7,980,800

巴川製紙所	5,600	808.00	4,524,800	
大王製紙	81,600	1,736.00	141,657,600	
阿波製紙	4,400	424.00	1,865,600	
レンゴー	174,500	950.00	165,775,000	
トーモク	10,400	1,943.00	20,207,200	
ザ・パック	12,800	2,790.00	35,712,000	
クラレ	266,500	1,117.00	297,680,500	
旭化成	1,121,500	1,266.00	1,419,819,000	
共和レザー	9,200	719.00	6,614,800	
昭和電工	128,500	3,600.00	462,600,000	
住友化学	1,331,900	610.00	812,459,000	
住友精化	8,200	3,610.00	29,602,000	
日産化学	93,300	5,540.00	516,882,000	
ラサ工業	5,500	1,884.00	10,362,000	
クレハ	14,500	6,370.00	92,365,000	
多木化学	6,600	5,460.00	36,036,000	
テイカ	12,400	1,362.00	16,888,800	
石原産業	30,300	1,048.00	31,754,400	
片倉コープアグリ	4,400	1,214.00	5,341,600	
日本曹達	23,600	3,375.00	79,650,000	
東ソー	261,500	1,998.00	522,477,000	
トクヤマ	50,300	2,324.00	116,897,200	
セントラル硝子	32,300	2,088.00	67,442,400	
東亜合成	103,200	1,168.00	120,537,600	
大阪ソーダ	17,200	2,492.00	42,862,400	
関東電化工業	40,100	1,007.00	40,380,700	
デンカ	61,700	3,735.00	230,449,500	
信越化学工業	312,900	18,535.00	5,799,601,500	
日本カーバイド工業	6,200	1,306.00	8,097,200	
堺化学工業	11,900	1,900.00	22,610,000	
第一稀元素化学工業	17,000	1,743.00	29,631,000	
エア・ウォーター	172,500	1,769.00	305,152,500	
日本酸素ホールディングス	139,400	2,099.00	292,600,600	
日本化学工業	4,800	2,892.00	13,881,600	
東邦アセチレン	2,500	1,213.00	3,032,500	
日本パーカライズニング	85,400	1,091.00	93,171,400	
高压ガス工業	26,800	647.00	17,339,600	
チタン工業	2,100	1,933.00	4,059,300	
四国化成工業	22,500	1,235.00	27,787,500	
戸田工業	3,600	2,407.00	8,665,200	
ステラ ケミファ	9,200	3,070.00	28,244,000	
保土谷化学工業	5,000	3,960.00	19,800,000	

日本触媒	30,600	5,580.00	170,748,000
大日精化工業	14,000	2,407.00	33,698,000
カネカ	43,800	4,390.00	192,282,000
三菱瓦斯化学	169,500	2,488.00	421,716,000
三井化学	146,100	3,810.00	556,641,000
J S R	169,800	3,195.00	542,511,000
東京応化工業	29,000	6,930.00	200,970,000
大阪有機化学工業	15,600	4,265.00	66,534,000
三菱ケミカルホールディングス	1,131,100	894.40	1,011,655,840
K Hネオケム	27,900	2,714.00	75,720,600
ダイセル	227,500	910.00	207,025,000
住友ベークライト	26,600	4,985.00	132,601,000
積水化学工業	357,800	1,853.00	663,003,400
日本ゼオン	152,600	1,541.00	235,156,600
アイカ工業	47,100	4,000.00	188,400,000
宇部興産	85,400	2,325.00	198,555,000
積水樹脂	27,900	2,079.00	58,004,100
タキロンシーアイ	36,600	586.00	21,447,600
旭有機材	9,600	1,357.00	13,027,200
ニチバン	8,900	1,766.00	15,717,400
リケンテクノス	41,300	582.00	24,036,600
大倉工業	8,000	2,425.00	19,400,000
積水化成成品工業	22,700	591.00	13,415,700
群栄化学工業	3,900	2,449.00	9,551,100
タイガースポリマー	8,900	451.00	4,013,900
ミライアル	5,400	1,410.00	7,614,000
ダイキアクシス	6,500	878.00	5,707,000
ダイキョーニシカワ	35,700	738.00	26,346,600
竹本容器	6,000	991.00	5,946,000
森六ホールディングス	9,100	2,330.00	21,203,000
恵和	3,300	3,040.00	10,032,000
日本化薬	104,700	1,045.00	109,411,500
カーリットホールディングス	16,800	675.00	11,340,000
日本精化	12,200	1,474.00	17,982,800
扶桑化学工業	13,300	4,030.00	53,599,000
トリケミカル研究所	15,700	3,485.00	54,714,500
A D E K A	77,900	1,903.00	148,243,700
日油	63,700	5,750.00	366,275,000
新日本理化	28,000	274.00	7,672,000
ハリマ化成グループ	12,600	905.00	11,403,000
花王	413,700	6,797.00	2,811,918,900
第一工業製薬	5,700	3,420.00	19,494,000



石原ケミカル	4,300	2,192.00	9,425,600
日華化学	5,700	1,261.00	7,187,700
ニイタカ	3,500	2,508.00	8,778,000
三洋化成工業	10,100	5,580.00	56,358,000
有機合成薬品工業	13,000	326.00	4,238,000
大日本塗料	19,100	850.00	16,235,000
日本ペイントホールディングス	698,000	1,642.00	1,146,116,000
関西ペイント	190,100	2,918.00	554,711,800
神東塗料	13,300	199.00	2,646,700
中国塗料	40,800	900.00	36,720,000
日本特殊塗料	12,700	1,152.00	14,630,400
藤倉化成	22,800	531.00	12,106,800
太陽ホールディングス	12,400	5,250.00	65,100,000
D I C	71,500	2,905.00	207,707,500
サカタインクス	36,900	1,058.00	39,040,200
東洋インキＳＣホールディングス	35,800	2,096.00	75,036,800
T & K T O K A	11,800	822.00	9,699,600
富士フィルムホールディングス	303,600	7,670.00	2,328,612,000
資生堂	343,300	8,108.00	2,783,476,400
ライオン	224,600	1,965.00	441,339,000
高砂香料工業	10,800	2,697.00	29,127,600
マンダム	36,200	2,131.00	77,142,200
ミルボン	23,100	6,450.00	148,995,000
ファンケル	62,900	3,605.00	226,754,500
コーセー	32,500	18,040.00	586,300,000
コタ	10,900	1,437.00	15,663,300
シーボン	2,200	1,960.00	4,312,000
ポーラ・オルビスホールディングス	73,700	2,982.00	219,773,400
ノエビアホールディングス	14,700	5,250.00	77,175,000
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,026.00	4,001,400
新日本製薬	4,700	2,137.00	10,043,900
エステー	11,100	1,798.00	19,957,800
アグロ カネショウ	6,500	1,419.00	9,223,500
コニシ	28,400	1,507.00	42,798,800
長谷川香料	29,800	2,300.00	68,540,000
星光 P M C	9,900	831.00	8,226,900
小林製薬	48,400	9,320.00	451,088,000
荒川化学工業	14,400	1,220.00	17,568,000
メック	11,800	2,785.00	32,863,000
日本高純度化学	4,700	2,824.00	13,272,800
タカラバイオ	45,200	2,880.00	130,176,000
J C U	19,400	3,520.00	68,288,000

新田ゼラチン	10,800	644.00	6,955,200
O A T アグリオ	3,300	1,428.00	4,712,400
デクセリアルズ	48,300	2,200.00	106,260,000
アース製薬	13,000	6,660.00	86,580,000
北興化学工業	16,100	959.00	15,439,900
大成ラミック	5,300	2,740.00	14,522,000
クミアイ化学工業	71,400	923.00	65,902,200
日本農薬	30,800	518.00	15,954,400
アキレス	11,900	1,397.00	16,624,300
有沢製作所	24,000	914.00	21,936,000
日東電工	104,400	8,450.00	882,180,000
レック	20,500	1,182.00	24,231,000
三光合成	18,100	446.00	8,072,600
きもと	26,400	255.00	6,732,000
藤森工業	15,500	4,085.00	63,317,500
前澤化成工業	11,000	1,247.00	13,717,000
未来工業	6,200	1,726.00	10,701,200
ウェーブロックホールディングス	6,000	712.00	4,272,000
J S P	10,100	1,656.00	16,725,600
エフピコ	31,800	4,055.00	128,949,000
天馬	12,900	2,521.00	32,520,900
信越ポリマー	26,600	1,062.00	28,249,200
東リ	43,000	247.00	10,621,000
ニフコ	63,400	4,020.00	254,868,000
バルカー	14,000	2,100.00	29,400,000
ユニ・チャーム	366,300	4,388.00	1,607,324,400
ショーエイコーポレーション	3,800	970.00	3,686,000
協和キリン	173,800	3,670.00	637,846,000
武田薬品工業	1,437,400	3,767.00	5,414,685,800
アステラス製薬	1,497,900	1,909.50	2,860,240,050
大日本住友製薬	128,100	2,340.00	299,754,000
塩野義製薬	217,300	5,839.00	1,268,814,700
わかもと製薬	20,600	328.00	6,756,800
日本新薬	49,000	8,480.00	415,520,000
バイオフェルミン製薬	2,900	3,130.00	9,077,000
中外製薬	540,400	4,267.00	2,305,886,800
科研製薬	29,600	4,765.00	141,044,000
エーザイ	190,900	10,000.00	1,909,000,000
ロート製薬	82,300	2,899.00	238,587,700
小野薬品工業	396,700	2,463.50	977,270,450
久光製薬	50,200	5,820.00	292,164,000
持田製薬	24,000	3,745.00	89,880,000

参天製薬	300,600	1,511.00	454,206,600
扶桑薬品工業	5,600	2,322.00	13,003,200
日本ケミファ	2,100	2,600.00	5,460,000
ツムラ	57,600	3,700.00	213,120,000
日医工	48,900	961.00	46,992,900
キッセイ薬品工業	30,600	2,170.00	66,402,000
生化学工業	30,500	1,084.00	33,062,000
栄研化学	30,400	2,169.00	65,937,600
日水製薬	6,300	982.00	6,186,600
鳥居薬品	10,800	2,525.00	27,270,000
JCRファーマ	48,700	3,400.00	165,580,000
東和薬品	24,900	2,562.00	63,793,800
富士製薬工業	10,600	1,191.00	12,624,600
ゼリア新薬工業	31,300	2,103.00	65,823,900
第一三共	1,357,700	2,497.00	3,390,176,900
キョーリン製薬ホールディングス	38,100	1,745.00	66,484,500
大幸薬品	21,200	1,066.00	22,599,200
ダイト	11,000	3,405.00	37,455,000
大塚ホールディングス	359,100	4,695.00	1,685,974,500
大正製薬ホールディングス	41,100	6,280.00	258,108,000
ペプチドリーム	89,100	4,925.00	438,817,500
あすか製薬ホールディングス	19,700	1,043.00	20,547,100
サワイグループホールディングス	37,800	5,050.00	190,890,000
日本コークス工業	146,000	104.00	15,184,000
ニチレキ	20,400	1,346.00	27,458,400
ユシロ化学工業	9,700	1,215.00	11,785,500
ビーピー・カストロール	6,200	1,397.00	8,661,400
富士石油	41,900	290.00	12,151,000
MORESCO	6,200	1,116.00	6,919,200
出光興産	191,700	2,695.00	516,631,500
ENEOSホールディングス	2,599,000	464.80	1,208,015,200
コスモエネルギーホールディングス	54,600	2,448.00	133,660,800
横浜ゴム	100,000	2,291.00	229,100,000
TOYO TIRE	90,900	2,281.00	207,342,900
ブリヂストン	459,400	4,934.00	2,266,679,600
住友ゴム工業	155,200	1,506.00	233,731,200
藤倉コンポジット	15,100	501.00	7,565,100
オカモト	10,500	4,300.00	45,150,000
フコク	7,600	1,038.00	7,888,800
ニッタ	17,900	2,730.00	48,867,000
住友理工	33,500	740.00	24,790,000
三ツ星ベルト	21,000	1,776.00	37,296,000

バンドー化学	30,400	865.00	26,296,000
日東紡績	25,700	3,455.00	88,793,500
A G C	158,600	4,845.00	768,417,000
日本板硝子	87,700	619.00	54,286,300
石塚硝子	2,900	1,936.00	5,614,400
日本山村硝子	7,300	941.00	6,869,300
日本電気硝子	64,100	2,681.00	171,852,100
オハラ	6,900	1,527.00	10,536,300
住友大阪セメント	31,100	3,045.00	94,699,500
太平洋セメント	102,300	2,489.00	254,624,700
日本ヒューム	15,900	733.00	11,654,700
日本コンクリート工業	37,600	343.00	12,896,800
三谷セキサン	8,100	4,135.00	33,493,500
アジアパイルホールディングス	26,800	506.00	13,560,800
東海カーボン	169,000	1,623.00	274,287,000
日本カーボン	9,600	4,410.00	42,336,000
東洋炭素	10,200	2,665.00	27,183,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,600	4,215.00	40,464,000
T O T O	123,400	6,010.00	741,634,000
日本碍子	190,200	2,023.00	384,774,600
日本特殊陶業	131,500	1,719.00	226,048,500
M A R U W A	6,000	10,630.00	63,780,000
品川リフラクトリーズ	4,100	3,640.00	14,924,000
黒崎播磨	3,000	4,575.00	13,725,000
ヨータイ	12,500	1,153.00	14,412,500
イソライト工業	7,800	630.00	4,914,000
東京窯業	22,400	327.00	7,324,800
ニッカトー	8,000	708.00	5,664,000
フジインコーポレーテッド	13,900	5,020.00	69,778,000
クニミネ工業	5,500	1,168.00	6,424,000
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,031.00	3,402,300
ニチアス	43,700	2,805.00	122,578,500
ニチハ	24,100	2,945.00	70,974,500
日本製鉄	815,600	1,951.50	1,591,643,400
神戸製鋼所	312,800	733.00	229,282,400
中山製鋼所	23,900	430.00	10,277,000
合同製鐵	9,300	1,695.00	15,763,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	494,400	1,354.00	669,417,600
東京製鐵	66,600	1,136.00	75,657,600
共英製鋼	19,300	1,486.00	28,679,800
大和工業	36,300	3,800.00	137,940,000
東京鐵鋼	6,600	1,597.00	10,540,200

大阪製鐵	9,100	1,136.00	10,337,600
淀川製鋼所	22,500	2,260.00	50,850,000
丸一鋼管	55,500	2,775.00	154,012,500
モリ工業	5,100	2,443.00	12,459,300
大同特殊鋼	28,000	5,530.00	154,840,000
日本高周波鋼業	6,500	425.00	2,762,500
日本冶金工業	13,300	2,345.00	31,188,500
山陽特殊製鋼	20,500	1,603.00	32,861,500
愛知製鋼	9,600	3,200.00	30,720,000
日立金属	161,100	2,122.00	341,854,200
日本金属	4,300	993.00	4,269,900
大平洋金属	11,600	1,873.00	21,726,800
新日本電工	110,500	310.00	34,255,000
栗本鐵工所	7,800	1,694.00	13,213,200
虹技	2,400	1,179.00	2,829,600
三菱製鋼	12,700	886.00	11,252,200
日亜鋼業	25,300	300.00	7,590,000
日本精線	2,500	4,465.00	11,162,500
エンビプロ・ホールディングス	7,400	1,255.00	9,287,000
シンニッタン	21,000	260.00	5,460,000
新家工業	4,300	1,656.00	7,120,800
大紀アルミニウム工業所	25,900	1,186.00	30,717,400
日本軽金属ホールディングス	46,600	1,881.00	87,654,600
三井金属鉱業	46,100	3,180.00	146,598,000
東邦亜鉛	9,500	1,975.00	18,762,500
三菱マテリアル	112,900	2,293.00	258,879,700
住友金属鉱山	218,400	4,740.00	1,035,216,000
D O W Aホールディングス	43,300	4,355.00	188,571,500
古河機械金属	28,300	1,302.00	36,846,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,900	826.00	14,785,400
東邦チタニウム	30,700	973.00	29,871,100
U A C J	26,000	2,672.00	69,472,000
C Kサンエツ	3,600	3,400.00	12,240,000
古河電気工業	53,100	2,903.00	154,149,300
住友電気工業	596,300	1,728.00	1,030,406,400
フジクラ	206,300	472.00	97,373,600
昭和電線ホールディングス	16,600	1,639.00	27,207,400
東京特殊電線	2,200	2,561.00	5,634,200
タツタ電線	30,400	574.00	17,449,600
カナレ電気	2,900	1,811.00	5,251,900
平河ヒューテック	9,600	1,209.00	11,606,400
リョービ	21,100	1,668.00	35,194,800

アーレスティ	21,300	520.00	11,076,000
アサヒホールディングス	64,200	2,338.00	150,099,600
稲葉製作所	9,600	1,522.00	14,611,200
宮地エンジニアリンググループ	5,600	2,317.00	12,975,200
トーカロ	44,100	1,413.00	62,313,300
アルファC o	6,000	1,144.00	6,864,000
SUMCO	217,900	2,523.00	549,761,700
川田テクノロジーズ	3,500	3,705.00	12,967,500
RS Technologies	5,500	5,780.00	31,790,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	3,020.00	5,738,000
信和	9,100	729.00	6,633,900
東洋製罐グループホールディングス	108,800	1,598.00	173,862,400
ホッカンホールディングス	8,700	1,434.00	12,475,800
コロナ	9,400	939.00	8,826,600
横河ブリッジホールディングス	29,300	2,094.00	61,354,200
駒井ハルテック	3,500	1,795.00	6,282,500
高田機工	1,600	2,718.00	4,348,800
三和ホールディングス	161,100	1,361.00	219,257,100
文化シャッター	50,300	1,081.00	54,374,300
三協立山	22,000	798.00	17,556,000
アルインコ	11,300	994.00	11,232,200
東洋シャッター	3,800	702.00	2,667,600
LIXIL	235,300	2,889.00	679,781,700
日本フィルコン	11,900	498.00	5,926,200
ノーリツ	35,400	1,841.00	65,171,400
長府製作所	17,400	2,021.00	35,165,400
リンナイ	33,200	10,560.00	350,592,000
ダイニチ工業	8,200	799.00	6,551,800
日東精工	21,400	562.00	12,026,800
三洋工業	2,100	1,854.00	3,893,400
岡部	34,600	669.00	23,147,400
ジーテクト	21,200	1,535.00	32,542,000
東プレ	31,900	1,665.00	53,113,500
高周波熱錬	32,900	591.00	19,443,900
東京製綱	12,200	1,220.00	14,884,000
サンコール	14,600	462.00	6,745,200
モリテック スチール	13,300	501.00	6,663,300
パイオラックス	25,300	1,519.00	38,430,700
エイチワン	16,800	814.00	13,675,200
日本発條	170,200	898.00	152,839,600
中央発條	8,200	1,223.00	10,028,600
アドバネクス	2,500	1,359.00	3,397,500

立川ブラインド工業	7,500	1,323.00	9,922,500
三益半導体工業	13,300	2,637.00	35,072,100
日本ドライケミカル	4,300	1,807.00	7,770,100
日本製鋼所	51,900	2,894.00	150,198,600
三浦工業	74,000	5,000.00	370,000,000
タクマ	58,000	1,807.00	104,806,000
ツガミ	35,500	1,714.00	60,847,000
オークマ	20,000	5,580.00	111,600,000
芝浦機械	17,800	2,555.00	45,479,000
アマダ	250,600	1,178.00	295,206,800
アイダエンジニアリング	45,000	875.00	39,375,000
滝澤鉄工所	5,000	1,136.00	5,680,000
F U J I	68,300	2,577.00	176,009,100
牧野フライス製作所	20,100	4,400.00	88,440,000
オーエスジー	84,400	1,898.00	160,191,200
ダイジェット工業	2,100	1,323.00	2,778,300
旭ダイヤモンド工業	45,300	537.00	24,326,100
D M G 森精機	108,200	1,933.00	209,150,600
ソディック	41,100	1,112.00	45,703,200
ディスコ	23,200	33,750.00	783,000,000
日東工器	8,200	1,947.00	15,965,400
日進工具	13,500	1,545.00	20,857,500
パンチ工業	14,400	635.00	9,144,000
富士ダイス	8,700	653.00	5,681,100
豊和工業	9,700	806.00	7,818,200
O K K	6,600	400.00	2,640,000
東洋機械金属	12,400	543.00	6,733,200
津田駒工業	3,300	896.00	2,956,800
エンシュウ	4,400	899.00	3,955,600
島精機製作所	25,100	2,067.00	51,881,700
オプトラン	21,500	2,560.00	55,040,000
N C ホールディングス	5,300	1,226.00	6,497,800
イワキポンプ	11,000	999.00	10,989,000
フリー	16,800	1,221.00	20,512,800
ヤマシンフィルタ	34,600	769.00	26,607,400
日阪製作所	21,200	827.00	17,532,400
やまびこ	33,200	1,222.00	40,570,400
平田機工	8,100	6,430.00	52,083,000
ペガサスミシン製造	17,500	498.00	8,715,000
マルマエ	7,100	2,119.00	15,044,900
タツモ	7,300	1,684.00	12,293,200
ナブテスコ	100,700	4,900.00	493,430,000

三井海洋開発	18,200	2,213.00	40,276,600
レオン自動機	16,800	1,522.00	25,569,600
S M C	50,600	62,840.00	3,179,704,000
ホソカワミクロン	6,000	6,090.00	36,540,000
ユニオンツール	6,400	4,025.00	25,760,000
オイレス工業	24,000	1,561.00	37,464,000
日精エー・エス・ピー機械	5,800	5,300.00	30,740,000
サトーホールディングス	22,500	2,618.00	58,905,000
技研製作所	15,100	4,620.00	69,762,000
日本エアージェット	5,700	1,290.00	7,353,000
カワタ	4,800	903.00	4,334,400
日精樹脂工業	13,300	1,327.00	17,649,100
オカダアイヨン	5,500	1,309.00	7,199,500
ワイエイシイホールディングス	6,800	1,068.00	7,262,400
小松製作所	782,800	3,145.00	2,461,906,000
住友重機械工業	99,000	3,380.00	334,620,000
日立建機	80,800	3,560.00	287,648,000
日工	26,100	707.00	18,452,700
巴工業	6,800	2,340.00	15,912,000
井関農機	17,400	1,433.00	24,934,200
T O W A	16,200	2,150.00	34,830,000
丸山製作所	3,600	1,850.00	6,660,000
北川鉄工所	7,900	1,772.00	13,998,800
ローツェ	7,600	9,810.00	74,556,000
タカキタ	6,200	668.00	4,141,600
クボタ	907,600	2,385.00	2,164,626,000
荏原実業	4,400	6,170.00	27,148,000
三菱化工機	5,600	2,754.00	15,422,400
月島機械	32,000	1,184.00	37,888,000
帝国電機製作所	12,100	1,305.00	15,790,500
新東工業	41,300	793.00	32,750,900
澁谷工業	15,200	3,305.00	50,236,000
アイチ コーポレーション	29,600	882.00	26,107,200
小森コーポレーション	44,100	798.00	35,191,800
鶴見製作所	13,400	1,770.00	23,718,000
住友精密工業	2,600	2,617.00	6,804,200
日本ギア工業	7,200	325.00	2,340,000
酒井重工業	3,100	2,475.00	7,672,500
荏原製作所	71,700	5,380.00	385,746,000
石井鐵工所	2,500	3,005.00	7,512,500
西島製作所	17,700	886.00	15,682,200
北越工業	17,900	1,166.00	20,871,400



ダイキン工業	220,100	20,245.00	4,455,924,500
オルガノ	5,600	6,210.00	34,776,000
トーヨーカネツ	6,600	2,465.00	16,269,000
栗田工業	93,500	5,170.00	483,395,000
椿本チエイン	24,700	3,285.00	81,139,500
大同工業	8,400	1,049.00	8,811,600
木村化工機	14,600	899.00	13,125,400
アネスト岩田	29,200	1,083.00	31,623,600
ダイフク	95,100	9,320.00	886,332,000
サムコ	4,300	3,220.00	13,846,000
加藤製作所	9,700	1,019.00	9,884,300
油研工業	3,000	1,752.00	5,256,000
タダノ	83,600	1,156.00	96,641,600
フジテック	59,500	2,533.00	150,713,500
C K D	40,100	2,462.00	98,726,200
キトー	14,600	1,705.00	24,893,000
平和	48,200	1,955.00	94,231,000
理想科学工業	12,700	1,758.00	22,326,600
S A N K Y O	41,100	2,822.00	115,984,200
日本金銭機械	19,300	578.00	11,155,400
マースグループホールディングス	11,000	1,641.00	18,051,000
フクシマガリレイ	11,900	4,535.00	53,966,500
オーイズミ	7,500	383.00	2,872,500
ダイコク電機	8,000	915.00	7,320,000
竹内製作所	28,900	2,853.00	82,451,700
アマノ	45,300	2,966.00	134,359,800
J U K I	24,000	819.00	19,656,000
蛇の目マシン工業	15,800	786.00	12,418,800
マックス	23,200	1,662.00	38,558,400
グローリー	44,400	2,310.00	102,564,000
新晃工業	16,100	1,893.00	30,477,300
大和冷機工業	27,800	1,082.00	30,079,600
セガサミーホールディングス	157,200	1,446.00	227,311,200
日本ピストンリング	6,400	1,318.00	8,435,200
リケン	8,000	2,667.00	21,336,000
T P R	23,300	1,533.00	35,718,900
ツバキ・ナカシマ	33,300	1,856.00	61,804,800
ホシザキ	54,400	10,340.00	562,496,000
大豊工業	14,200	1,042.00	14,796,400
日本精工	354,900	1,049.00	372,290,100
N T N	399,800	318.00	127,136,400
ジェイテクト	165,800	1,219.00	202,110,200

不二越	16,100	4,160.00	66,976,000
日本トムソン	47,500	626.00	29,735,000
T H K	107,700	3,385.00	364,564,500
ユーシン精機	11,600	830.00	9,628,000
前澤給装工業	12,100	1,092.00	13,213,200
イーグル工業	21,400	1,134.00	24,267,600
前澤工業	10,500	609.00	6,394,500
日本ピラー工業	17,500	2,251.00	39,392,500
キッツ	53,500	795.00	42,532,500
マキタ	225,300	5,030.00	1,133,259,000
日立造船	137,300	730.00	100,229,000
三菱重工業	271,500	3,438.00	933,417,000
I H I	116,200	2,845.00	330,589,000
スター精密	26,700	1,818.00	48,540,600
日清紡ホールディングス	105,700	928.00	98,089,600
イビデン	83,300	5,410.00	450,653,000
コニカミノルタ	352,200	642.00	226,112,400
ブラザー工業	211,400	2,298.00	485,797,200
ミネベアミツミ	298,200	2,893.00	862,692,600
日立製作所	830,700	6,073.00	5,044,841,100
東芝	341,900	4,720.00	1,613,768,000
三菱電機	1,727,600	1,747.50	3,018,981,000
富士電機	104,100	5,130.00	534,033,000
東洋電機製造	7,000	1,201.00	8,407,000
安川電機	186,000	5,160.00	959,760,000
シンフォニアテクノロジー	22,500	1,295.00	29,137,500
明電舎	29,400	2,298.00	67,561,200
オリジン	4,900	1,326.00	6,497,400
山洋電気	8,500	7,750.00	65,875,000
デンヨー	14,800	2,043.00	30,236,400
東芝テック	18,600	4,480.00	83,328,000
芝浦メカトロニクス	3,200	7,610.00	24,352,000
マブチモーター	48,100	4,445.00	213,804,500
日本電産	415,900	12,260.00	5,098,934,000
トレックス・セミコンダクター	9,800	2,182.00	21,383,600
東光高岳	9,500	1,419.00	13,480,500
ダイヘン	18,900	4,880.00	92,232,000
ヤーマン	28,900	1,445.00	41,760,500
J V C ケンウッド	154,100	236.00	36,367,600
ミマキエンジニアリング	17,000	706.00	12,002,000
I - P E X	8,500	2,542.00	21,607,000
日新電機	40,600	1,358.00	55,134,800

大崎電気工業	34,600	620.00	21,452,000
オムロン	143,800	8,330.00	1,197,854,000
日東工業	25,400	1,803.00	45,796,200
I D E C	23,200	2,039.00	47,304,800
正興電機製作所	6,100	1,645.00	10,034,500
不二電機工業	3,700	1,281.00	4,739,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62,400	3,110.00	194,064,000
サクサホールディングス	4,200	1,395.00	5,859,000
メルコホールディングス	6,200	4,940.00	30,628,000
テクノメディカ	4,500	1,627.00	7,321,500
日本電気	219,500	5,150.00	1,130,425,000
富士通	155,500	18,765.00	2,917,957,500
沖電気工業	70,300	1,009.00	70,932,700
岩崎通信機	7,600	943.00	7,166,800
電気興業	8,400	2,270.00	19,068,000
サンケン電気	20,200	5,260.00	106,252,000
ナカヨ	3,500	1,477.00	5,169,500
アイホン	9,900	2,115.00	20,938,500
ルネサスエレクトロニクス	764,800	1,183.00	904,758,400
セイコーエプソン	214,400	1,974.00	423,225,600
ワコム	126,600	659.00	83,429,400
アルバック	31,800	5,370.00	170,766,000
アクセル	8,300	917.00	7,611,100
E I Z O	14,700	5,080.00	74,676,000
日本信号	40,400	936.00	37,814,400
京三製作所	37,500	449.00	16,837,500
能美防災	23,400	2,001.00	46,823,400
ホーチキ	13,400	1,226.00	16,428,400
星和電機	10,400	556.00	5,782,400
エレコム	40,100	2,002.00	80,280,200
パナソニック	1,842,600	1,254.50	2,311,541,700
シャープ	229,800	1,936.00	444,892,800
アンリツ	103,900	2,056.00	213,618,400
富士通ゼネラル	52,800	2,798.00	147,734,400
ソニーグループ	1,082,300	10,795.00	11,683,428,500
T D K	83,500	13,840.00	1,155,640,000
帝国通信工業	8,600	1,190.00	10,234,000
タムラ製作所	62,400	568.00	35,443,200
アルプスアルパイン	142,000	1,205.00	171,110,000
池上通信機	5,500	850.00	4,675,000
鈴木	8,800	1,031.00	9,072,800
日本トリム	4,000	3,705.00	14,820,000

ローランド ディー・ジー・	10,700	2,489.00	26,632,300
フォスター電機	17,600	1,012.00	17,811,200
S M K	4,500	2,568.00	11,556,000
ヨコオ	13,900	2,346.00	32,609,400
ホシデン	48,200	1,001.00	48,248,200
ヒロセ電機	26,600	15,800.00	420,280,000
日本航空電子工業	39,700	1,840.00	73,048,000
T O A	20,600	899.00	18,519,400
マクセルホールディングス	35,200	1,280.00	45,056,000
古野電気	23,200	1,045.00	24,244,000
ユニデンホールディングス	4,500	2,530.00	11,385,000
スミダコーポレーション	15,700	1,104.00	17,332,800
アイコム	7,200	2,399.00	17,272,800
リオン	7,700	2,821.00	21,721,700
本多通信工業	15,600	491.00	7,659,600
横河電機	173,000	1,711.00	296,003,000
新電元工業	6,700	4,205.00	28,173,500
アズビル	116,900	4,370.00	510,853,000
東亜ディーケーケー	9,800	824.00	8,075,200
日本光電工業	71,700	3,185.00	228,364,500
チノー	5,600	1,500.00	8,400,000
共和電業	18,700	391.00	7,311,700
日本電子材料	7,200	1,997.00	14,378,400
堀場製作所	34,200	7,340.00	251,028,000
アドバンテスト	128,500	9,910.00	1,273,435,000
小野測器	9,200	560.00	5,152,000
エスベック	15,800	2,147.00	33,922,600
キーエンス	169,600	53,850.00	9,132,960,000
日置電機	8,500	5,620.00	47,770,000
シスメックス	134,900	11,270.00	1,520,323,000
日本マイクロニクス	30,700	1,556.00	47,769,200
メガチップス	17,600	3,300.00	58,080,000
O B A R A G R O U P	8,100	3,915.00	31,711,500
澤藤電機	2,300	2,237.00	5,145,100
原田工業	8,200	925.00	7,585,000
コーセル	22,000	1,090.00	23,980,000
イリソ電子工業	14,700	4,965.00	72,985,500
オブテックスグループ	28,900	1,883.00	54,418,700
千代田インテグレ	7,800	1,850.00	14,430,000
アイ・オー・データ機器	7,300	1,077.00	7,862,100
レーザーテック	75,900	20,560.00	1,560,504,000
スタンレー電気	121,200	3,395.00	411,474,000

岩崎電気	7,000	1,827.00	12,789,000
ウシオ電機	89,200	1,714.00	152,888,800
岡谷電機産業	15,300	353.00	5,400,900
ハリオス テクノ ホールディング	18,900	354.00	6,690,600
エノモト	5,400	1,731.00	9,347,400
日本セラミック	17,900	2,976.00	53,270,400
遠藤照明	10,100	794.00	8,019,400
古河電池	13,000	1,642.00	21,346,000
双信電機	10,500	574.00	6,027,000
山一電機	11,900	1,729.00	20,575,100
図研	11,600	3,050.00	35,380,000
日本電子	31,600	5,860.00	185,176,000
カシオ計算機	139,000	1,921.00	267,019,000
ファナック	151,600	26,390.00	4,000,724,000
日本シイエムケイ	39,400	448.00	17,651,200
エンプラス	8,100	4,100.00	33,210,000
大真空	6,200	4,110.00	25,482,000
ローム	71,900	9,920.00	713,248,000
浜松ホトニクス	124,100	6,860.00	851,326,000
三井ハイテック	17,200	4,355.00	74,906,000
新光電気工業	58,300	3,645.00	212,503,500
京セラ	263,500	6,891.00	1,815,778,500
太陽誘電	77,000	5,200.00	400,400,000
村田製作所	507,600	8,284.00	4,204,958,400
双葉電子工業	30,800	815.00	25,102,000
北陸電気工業	7,600	1,004.00	7,630,400
ニチコン	55,300	1,152.00	63,705,600
日本ケミコン	17,400	2,422.00	42,142,800
K O A	24,600	1,615.00	39,729,000
市光工業	27,300	742.00	20,256,600
小糸製作所	103,600	7,020.00	727,272,000
ミツバ	31,800	903.00	28,715,400
S C R E E Nホールディングス	30,000	10,680.00	320,400,000
キャノン電子	16,500	1,731.00	28,561,500
キャノン	858,500	2,643.50	2,269,444,750
リコー	439,600	1,394.00	612,802,400
象印マホービン	47,400	1,703.00	80,722,200
M U T O Hホールディングス	2,900	1,587.00	4,602,300
東京エレクトロン	101,200	47,570.00	4,814,084,000
トヨタ紡織	50,400	2,243.00	113,047,200
芦森工業	3,300	1,056.00	3,484,800
ユニプレス	28,400	1,010.00	28,684,000

豊田自動織機	139,800	9,690.00	1,354,662,000
モリタホールディングス	27,700	1,598.00	44,264,600
三櫻工業	24,000	1,201.00	28,824,000
デンソー	380,400	7,789.00	2,962,935,600
東海理化電機製作所	45,500	1,811.00	82,400,500
三井E & Sホールディングス	66,900	522.00	34,921,800
川崎重工業	134,400	2,535.00	340,704,000
名村造船所	51,900	178.00	9,238,200
日本車輛製造	6,300	2,212.00	13,935,600
三菱ロジスネクスト	22,900	1,061.00	24,296,900
近畿車輛	3,000	1,282.00	3,846,000
日産自動車	2,037,500	556.70	1,134,276,250
いすゞ自動車	458,700	1,582.00	725,663,400
トヨタ自動車	1,750,200	9,866.00	17,267,473,200
日野自動車	215,700	1,015.00	218,935,500
三菱自動車工業	639,500	317.00	202,721,500
エフテック	12,200	888.00	10,833,600
レシップホールディングス	6,800	609.00	4,141,200
G M B	3,200	1,058.00	3,385,600
ファルテック	3,100	769.00	2,383,900
武蔵精密工業	38,500	2,442.00	94,017,000
日産車体	25,300	748.00	18,924,400
新明和工業	48,800	1,005.00	49,044,000
極東開発工業	29,800	1,737.00	51,762,600
トピー工業	14,300	1,375.00	19,662,500
ティラド	5,400	2,938.00	15,865,200
曙ブレーキ工業	94,800	181.00	17,158,800
タチエス	26,500	1,471.00	38,981,500
N O K	83,600	1,402.00	117,207,200
フタバ産業	43,400	538.00	23,349,200
K Y B	19,300	3,985.00	76,910,500
大同メタル工業	35,800	636.00	22,768,800
プレス工業	85,900	352.00	30,236,800
ミクニ	22,200	321.00	7,126,200
太平洋工業	36,300	1,188.00	43,124,400
河西工業	23,500	419.00	9,846,500
アイシン	126,500	4,870.00	616,055,000
マツダ	542,200	1,023.00	554,670,600
今仙電機製作所	15,200	746.00	11,339,200
本田技研工業	1,360,300	3,576.00	4,864,432,800
スズキ	342,400	4,786.00	1,638,726,400
S U B A R U	495,100	2,273.50	1,125,609,850

安永	8,400	1,250.00	10,500,000
ヤマハ発動機	244,100	3,260.00	795,766,000
T B K	20,700	419.00	8,673,300
エクセディ	23,500	1,773.00	41,665,500
豊田合成	55,800	2,793.00	155,849,400
愛三工業	27,200	895.00	24,344,000
盟和産業	2,700	986.00	2,662,200
日本プラスト	14,700	744.00	10,936,800
ヨロズ	14,900	1,272.00	18,952,800
エフ・シー・シー	28,300	1,747.00	49,440,100
シマノ	64,700	24,265.00	1,569,945,500
テイ・エス テック	80,300	1,631.00	130,969,300
ジャムコ	10,100	1,285.00	12,978,500
テルモ	529,600	4,473.00	2,368,900,800
クリエートメディック	5,700	1,007.00	5,739,900
日機装	55,800	1,183.00	66,011,400
日本エム・ディ・エム	10,000	2,243.00	22,430,000
島津製作所	222,300	3,995.00	888,088,500
J M S	14,600	865.00	12,629,000
長野計器	12,500	1,199.00	14,987,500
ブイ・テクノロジー	8,100	5,430.00	43,983,000
東京計器	11,000	1,084.00	11,924,000
愛知時計電機	2,300	4,295.00	9,878,500
インターアクション	8,700	2,439.00	21,219,300
オーバル	15,600	286.00	4,461,600
東京精密	29,100	5,280.00	153,648,000
マニー	68,800	2,478.00	170,486,400
ニコン	263,900	1,211.00	319,582,900
トプコン	87,000	1,814.00	157,818,000
オリンパス	955,900	2,411.50	2,305,152,850
理研計器	15,200	2,784.00	42,316,800
タムロン	13,900	2,487.00	34,569,300
H O Y A	340,000	13,740.00	4,671,600,000
シード	6,800	836.00	5,684,800
ノーリツ鋼機	15,500	2,302.00	35,681,000
エー・アンド・デイ	14,600	1,043.00	15,227,800
朝日インテック	181,900	2,661.00	484,035,900
シチズン時計	219,300	440.00	96,492,000
リズム	5,500	799.00	4,394,500
大研医器	13,700	563.00	7,713,100
メニコン	26,600	7,190.00	191,254,000
シンシア	1,900	641.00	1,217,900

松風	7,900	2,004.00	15,831,600
セイコーホールディングス	24,500	2,326.00	56,987,000
ニプロ	128,800	1,371.00	176,584,800
中本パックス	4,400	1,608.00	7,075,200
スノーピーク	10,200	3,335.00	34,017,000
パラマウントベッドホールディングス	33,100	1,984.00	65,670,400
トランザクション	9,500	1,422.00	13,509,000
粧美堂	5,000	427.00	2,135,000
ニホンフラッシュ	14,800	1,256.00	18,588,800
前田工織	19,000	3,410.00	64,790,000
永大産業	22,600	319.00	7,209,400
アートネイチャー	16,600	671.00	11,138,600
バンダイナムコホールディングス	142,900	8,022.00	1,146,343,800
アイフィスジャパン	4,400	716.00	3,150,400
共立印刷	28,900	144.00	4,161,600
SHOEI	16,200	3,880.00	62,856,000
フランスベッドホールディングス	22,200	922.00	20,468,400
パイロットコーポレーション	29,200	3,650.00	106,580,000
萩原工業	9,600	1,431.00	13,737,600
トッパン・フォームズ	30,800	1,085.00	33,418,000
フジシールインターナショナル	35,500	2,386.00	84,703,000
タカラトミー	77,500	968.00	75,020,000
廣済堂	12,000	985.00	11,820,000
エステールホールディングス	4,600	649.00	2,985,400
タカノ	5,900	643.00	3,793,700
プロネクサス	13,900	1,043.00	14,497,700
ホクシン	10,700	170.00	1,819,000
ウッドワン	5,800	1,295.00	7,511,000
大建工業	11,600	2,094.00	24,290,400
凸版印刷	262,600	1,898.00	498,414,800
大日本印刷	208,700	2,393.00	499,419,100
共同印刷	5,300	2,734.00	14,490,200
NISSHA	35,500	1,579.00	56,054,500
光村印刷	1,500	1,701.00	2,551,500
TAKARA & COMPANY	8,500	1,738.00	14,773,000
アシックス	152,800	2,601.00	397,432,800
ツツミ	4,300	2,334.00	10,036,200
ローランド	13,400	6,290.00	84,286,000
小松ウオール工業	5,300	1,948.00	10,324,400
ヤマハ	102,700	6,460.00	663,442,000
河合楽器製作所	4,800	3,665.00	17,592,000
クリナップ	16,100	517.00	8,323,700



ビジョン	110,900	3,340.00	370,406,000
オリバー	3,700	2,751.00	10,178,700
兼松サステック	1,100	1,800.00	1,980,000
キングジム	14,300	951.00	13,599,300
リンテック	37,000	2,444.00	90,428,000
イトーキ	34,300	379.00	12,999,700
任天堂	98,900	67,090.00	6,635,201,000
三菱鉛筆	28,400	1,433.00	40,697,200
タカラスタンダード	35,700	1,568.00	55,977,600
コクヨ	82,900	1,819.00	150,795,100
ナカバヤシ	17,000	605.00	10,285,000
グローブライド	8,400	4,310.00	36,204,000
オカムラ	59,400	1,462.00	86,842,800
美津濃	17,100	2,357.00	40,304,700
東京電力ホールディングス	1,465,400	345.00	505,563,000
中部電力	528,500	1,358.50	717,967,250
関西電力	654,600	1,088.50	712,532,100
中国電力	249,200	1,027.00	255,928,400
北陸電力	157,900	632.00	99,792,800
東北電力	404,600	886.00	358,475,600
四国電力	143,600	754.00	108,274,400
九州電力	381,500	872.00	332,668,000
北海道電力	161,700	521.00	84,245,700
沖縄電力	33,600	1,442.00	48,451,200
電源開発	137,500	1,638.00	225,225,000
エフオン	10,400	975.00	10,140,000
イーレックス	25,400	1,931.00	49,047,400
レノバ	29,300	3,875.00	113,537,500
東京瓦斯	332,200	2,167.00	719,877,400
大阪瓦斯	312,900	2,096.00	655,838,400
東邦瓦斯	85,000	5,610.00	476,850,000
北海道瓦斯	9,300	1,564.00	14,545,200
広島ガス	35,600	374.00	13,314,400
西部ガスホールディングス	19,400	2,494.00	48,383,600
静岡ガス	49,000	1,014.00	49,686,000
メタウォーター	19,400	2,089.00	40,526,600
SBSホールディングス	12,800	3,395.00	43,456,000
東武鉄道	180,100	3,105.00	559,210,500
相鉄ホールディングス	59,200	2,292.00	135,686,400
東急	435,700	1,628.00	709,319,600
京浜急行電鉄	221,900	1,526.00	338,619,400
小田急電鉄	276,700	2,953.00	817,095,100

京王電鉄	96,500	7,160.00	690,940,000
京成電鉄	129,500	3,710.00	480,445,000
富士急行	23,600	5,460.00	128,856,000
新京成電鉄	4,400	2,158.00	9,495,200
東日本旅客鉄道	304,100	8,515.00	2,589,411,500
西日本旅客鉄道	153,900	6,947.00	1,069,143,300
東海旅客鉄道	143,600	18,255.00	2,621,418,000
西武ホールディングス	208,200	1,435.00	298,767,000
鴻池運輸	27,500	1,130.00	31,075,000
西日本鉄道	47,900	2,892.00	138,526,800
ハマキョウレックス	13,300	3,075.00	40,897,500
サカイ引越センター	7,900	5,730.00	45,267,000
近鉄グループホールディングス	163,600	4,215.00	689,574,000
阪急阪神ホールディングス	218,200	3,685.00	804,067,000
南海電気鉄道	77,600	2,502.00	194,155,200
京阪ホールディングス	72,900	3,645.00	265,720,500
神戸電鉄	3,900	3,510.00	13,689,000
名古屋鉄道	134,500	2,271.00	305,449,500
山陽電気鉄道	11,700	1,965.00	22,990,500
アルプス物流	11,400	1,008.00	11,491,200
日本通運	56,600	8,800.00	498,080,000
ヤマトホールディングス	229,300	2,987.00	684,919,100
山九	42,000	4,905.00	206,010,000
丸運	9,300	267.00	2,483,100
丸全昭和運輸	13,300	3,370.00	44,821,000
センコーグループホールディングス	90,200	1,038.00	93,627,600
トナミホールディングス	3,900	5,040.00	19,656,000
ニッコンホールディングス	54,900	2,388.00	131,101,200
日本石油輸送	1,800	2,593.00	4,667,400
福山通運	20,900	4,015.00	83,913,500
セイノーホールディングス	122,500	1,488.00	182,280,000
エスライン	4,500	897.00	4,036,500
神奈川中央交通	4,100	3,675.00	15,067,500
日立物流	36,000	3,740.00	134,640,000
丸和運輸機関	34,500	1,568.00	54,096,000
C & F ロジホールディングス	16,500	1,645.00	27,142,500
九州旅客鉄道	126,600	2,758.00	349,162,800
S Gホールディングス	309,100	2,626.00	811,696,600
日本郵船	137,200	5,110.00	701,092,000
商船三井	97,400	4,845.00	471,903,000
川崎汽船	50,400	3,350.00	168,840,000
N S ユナイテッド海運	8,400	2,262.00	19,000,800

飯野海運	79,400	452.00	35,888,800
共栄タンカー	4,700	865.00	4,065,500
乾汽船	11,200	1,217.00	13,630,400
日本航空	398,600	2,707.00	1,079,010,200
A N Aホールディングス	441,600	2,894.00	1,277,990,400
パスコ	3,200	1,553.00	4,969,600
トランコム	5,000	8,260.00	41,300,000
日新	13,000	1,527.00	19,851,000
三菱倉庫	56,600	3,445.00	194,987,000
三井倉庫ホールディングス	17,400	2,399.00	41,742,600
住友倉庫	57,800	1,516.00	87,624,800
澁澤倉庫	9,000	2,129.00	19,161,000
東陽倉庫	27,400	324.00	8,877,600
日本トランスシティ	36,000	532.00	19,152,000
ケイヒン	3,200	1,372.00	4,390,400
中央倉庫	10,000	1,066.00	10,660,000
川西倉庫	3,000	1,148.00	3,444,000
安田倉庫	13,400	950.00	12,730,000
ファイズホールディングス	2,900	830.00	2,407,000
東洋埠頭	5,000	1,537.00	7,685,000
宇徳	11,700	516.00	6,037,200
上組	90,000	2,207.00	198,630,000
サンリツ	4,200	738.00	3,099,600
キムラユニティー	4,400	1,317.00	5,794,800
キューソー流通システム	4,100	1,704.00	6,986,400
近鉄エクスプレス	30,900	2,361.00	72,954,900
東海運	9,300	311.00	2,892,300
エーアイティー	10,300	993.00	10,227,900
内外トランスライン	5,700	1,909.00	10,881,300
日本コンセプト	5,200	1,656.00	8,611,200
N E C ネットズエスアイ	56,300	1,756.00	98,862,800
クロスキャット	4,800	1,011.00	4,852,800
システナ	60,700	1,901.00	115,390,700
デジタルアーツ	9,900	8,770.00	86,823,000
日鉄ソリューションズ	24,700	3,385.00	83,609,500
キューブシステム	9,400	1,034.00	9,719,600
エイジア	2,800	2,119.00	5,933,200
コア	7,400	1,445.00	10,693,000
ラクーンホールディングス	12,100	2,635.00	31,883,500
ソリトンシステムズ	8,700	1,660.00	14,442,000
ソフトクリエイトホールディングス	6,800	2,266.00	15,408,800
T I S	169,700	2,774.00	470,747,800

JNSホールディングス	8,300	575.00	4,772,500
電算システム	6,500	2,957.00	19,220,500
グリー	104,600	574.00	60,040,400
GMOペパボ	1,500	4,945.00	7,417,500
コーエーテクモホールディングス	45,100	5,110.00	230,461,000
三菱総合研究所	7,400	3,835.00	28,379,000
電算	2,000	2,450.00	4,900,000
AGS	9,100	872.00	7,935,200
ファインデックス	14,600	1,027.00	14,994,200
ブレインパッド	4,500	4,935.00	22,207,500
KLab	31,100	711.00	22,112,100
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	22,900	1,134.00	25,968,600
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,135.00	9,091,500
ネクソン	429,100	2,535.00	1,087,768,500
アイスタイル	52,400	557.00	29,186,800
エムアップホールディングス	4,500	2,772.00	12,474,000
エイチーム	11,900	1,737.00	20,670,300
エニグモ	16,300	1,408.00	22,950,400
テクノスジャパン	13,800	609.00	8,404,200
コロプラ	56,200	846.00	47,545,200
ブロードリーフ	84,700	522.00	44,213,400
クロス・マーケティンググループ	8,200	701.00	5,748,200
デジタルハーツホールディングス	8,000	1,532.00	12,256,000
システム情報	13,100	975.00	12,772,500
メディアドゥ	6,700	4,955.00	33,198,500
じげん	42,900	415.00	17,803,500
ブイキューブ	9,400	2,683.00	25,220,200
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	675.00	2,430,000
サイバーリンクス	5,800	1,659.00	9,622,200
フィックスターズ	18,500	895.00	16,557,500
CARTA HOLDINGS	7,100	1,722.00	12,226,200
オブティム	12,000	2,309.00	27,708,000
セレス	5,700	3,485.00	19,864,500
SHIFT	8,500	15,740.00	133,790,000
ティーガイア	18,200	1,957.00	35,617,400
セック	2,600	2,630.00	6,838,000
日本アジアグループ	16,400	912.00	14,956,800
テクマトリックス	26,500	1,634.00	43,301,000
プロシップ	5,200	1,347.00	7,004,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,000	2,280.00	93,480,000
GMOペイメントゲートウェイ	32,500	13,760.00	447,200,000
ザッパラス	7,300	584.00	4,263,200

システムリサーチ	5,100	2,099.00	10,704,900
インターネットイニシアティブ	45,300	3,100.00	140,430,000
さくらインターネット	18,800	630.00	11,844,000
ヴィンクス	5,200	988.00	5,137,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,800	5,190.00	19,722,000
SRAホールディングス	9,100	2,778.00	25,279,800
システムインテグレータ	5,400	644.00	3,477,600
朝日ネット	14,300	711.00	10,167,300
eBASE	20,700	859.00	17,781,300
アバント	18,400	1,574.00	28,961,600
アドソル日進	6,200	2,409.00	14,935,800
ODKソリューションズ	4,000	846.00	3,384,000
フリービット	10,500	946.00	9,933,000
コムチュア	15,700	2,356.00	36,989,200
サイバーコム	3,300	1,537.00	5,072,100
アステリア	12,700	833.00	10,579,100
アイル	9,600	1,521.00	14,601,600
マークライنز	7,200	3,170.00	22,824,000
メディカル・データ・ビジョン	19,500	2,179.00	42,490,500
gumi	23,800	1,059.00	25,204,200
ショーケース	4,200	775.00	3,255,000
モバイルファクトリー	4,100	1,281.00	5,252,100
テラスカイ	5,600	2,676.00	14,985,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	2,079.00	16,008,300
PCIホールディングス	6,700	1,241.00	8,314,700
パイプドHD	3,700	1,696.00	6,275,200
アイビーシー	3,100	1,011.00	3,134,100
ネオジャパン	3,400	1,699.00	5,776,600
PR TIMES	3,700	3,525.00	13,042,500
ラクス	51,200	2,194.00	112,332,800
ランドコンピュータ	2,900	1,099.00	3,187,100
ダブルスタンダード	2,300	5,060.00	11,638,000
オープンドア	10,200	2,672.00	27,254,400
マイネット	5,500	782.00	4,301,000
アカツキ	6,900	3,700.00	25,530,000
ベネフィットジャパン	1,500	2,030.00	3,045,000
Ubicomホールディングス	4,600	3,295.00	15,157,000
カナミックネットワーク	18,700	659.00	12,323,300
ノムラシステムコーポレーション	8,700	295.00	2,566,500
チェンジ	31,300	2,848.00	89,142,400
シンクロ・フード	11,100	428.00	4,750,800
オークネット	9,200	1,394.00	12,824,800

キャピタル・アセット・プランニング	3,700	1,090.00	4,033,000
セグエグループ	4,700	1,135.00	5,334,500
エイトレッド	3,400	2,243.00	7,626,200
A O I T Y O H o l d i n g s	17,600	899.00	15,822,400
マクロミル	35,100	839.00	29,448,900
ビーグリー	3,600	1,406.00	5,061,600
オロ	5,500	3,505.00	19,277,500
ユーザーローカル	2,600	4,130.00	10,738,000
テモナ	4,000	1,140.00	4,560,000
ニーズウェル	4,100	613.00	2,513,300
サインポスト	4,100	877.00	3,595,700
ソルクシーズ	6,900	1,040.00	7,176,000
フェイス	5,600	839.00	4,698,400
プロトコーポレーション	20,600	1,182.00	24,349,200
ハイマックス	5,200	1,067.00	5,548,400
野村総合研究所	294,600	3,450.00	1,016,370,000
サイバネットシステム	12,500	823.00	10,287,500
C E ホールディングス	9,700	532.00	5,160,400
日本システム技術	3,300	1,543.00	5,091,900
インテージホールディングス	21,400	1,536.00	32,870,400
東邦システムサイエンス	4,900	920.00	4,508,000
ソースネクスト	81,700	323.00	26,389,100
インフォコム	15,600	3,085.00	48,126,000
H E R O Z	5,000	2,496.00	12,480,000
ラクスル	18,500	4,805.00	88,892,500
I P S	4,100	2,779.00	11,393,900
F I G	19,700	291.00	5,732,700
システムサポート	5,300	1,417.00	7,510,100
イーソル	9,500	1,109.00	10,535,500
アルテリア・ネットワークス	19,000	1,657.00	31,483,000
E d u L a b	1,700	5,490.00	9,333,000
東海ソフト	2,900	1,411.00	4,091,900
ウイングアーク1st	9,000	2,398.00	21,582,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,198.00	8,792,000
サーバーワークス	1,700	3,860.00	6,562,000
東名	1,900	1,064.00	2,021,600
ヴィッツ	1,800	2,083.00	3,749,400
トビラシステムズ	2,500	1,340.00	3,350,000
S a n s a n	15,100	8,780.00	132,578,000
L i n k - U	3,400	1,197.00	4,069,800
ギフティ	10,300	3,240.00	33,372,000
ベース	2,000	5,270.00	10,540,000

フォーカスシステムズ	11,800	902.00	10,643,600
クレスコ	11,300	1,716.00	19,390,800
フジ・メディア・ホールディングス	176,200	1,264.00	222,716,800
オービック	53,400	20,110.00	1,073,874,000
ジャストシステム	24,200	5,980.00	144,716,000
TDCソフト	15,200	1,011.00	15,367,200
Zホールディングス	2,329,700	499.80	1,164,384,060
トレンドマイクロ	90,600	5,590.00	506,454,000
IDホールディングス	6,700	1,358.00	9,098,600
日本オラクル	34,400	9,800.00	337,120,000
アルファシステムズ	4,600	3,655.00	16,813,000
フューチャー	20,600	2,084.00	42,930,400
CAC Holdings	11,300	1,462.00	16,520,600
SBテクノロジー	6,200	3,005.00	18,631,000
トーセ	5,100	812.00	4,141,200
オービックビジネスコンサルタント	17,300	6,330.00	109,509,000
伊藤忠テクノソリューションズ	77,300	3,315.00	256,249,500
アイティフォー	22,600	781.00	17,650,600
東計電算	2,600	4,805.00	12,493,000
エクスネット	3,000	1,021.00	3,063,000
大塚商会	91,800	6,060.00	556,308,000
サイボウズ	20,000	2,521.00	50,420,000
電通国際情報サービス	21,100	3,860.00	81,446,000
ACCESS	21,600	875.00	18,900,000
デジタルガレージ	28,100	4,710.00	132,351,000
EMシステムズ	28,400	908.00	25,787,200
ウェザーニューズ	5,200	5,760.00	29,952,000
CIJ	12,000	854.00	10,248,000
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,210.00	5,778,000
日本エンタープライズ	19,000	218.00	4,142,000
WOWOW	8,300	2,422.00	20,102,600
スカラ	15,600	830.00	12,948,000
インテリジェント ウェイブ	10,500	658.00	6,909,000
IMAGICA GROUP	15,200	488.00	7,417,600
ネットワンシステムズ	69,300	3,390.00	234,927,000
システムソフト	37,500	156.00	5,850,000
アルゴグラフィックス	13,300	3,165.00	42,094,500
マーベラス	27,200	793.00	21,569,600
エイベックス	29,400	1,506.00	44,276,400
日本ユニシス	58,900	3,165.00	186,418,500
兼松エレクトロニクス	9,300	3,580.00	33,294,000
都築電気	7,800	1,825.00	14,235,000

TBSホールディングス	112,700	1,812.00	204,212,400
日本テレビホールディングス	141,800	1,332.00	188,877,600
朝日放送グループホールディングス	17,400	717.00	12,475,800
テレビ朝日ホールディングス	52,600	1,876.00	98,677,600
スカパーJ S A Tホールディングス	112,500	425.00	47,812,500
テレビ東京ホールディングス	12,300	2,179.00	26,801,700
日本BS放送	6,100	1,114.00	6,795,400
ビジョン	21,400	1,284.00	27,477,600
スマートバリュー	4,900	796.00	3,900,400
ワイヤレスゲート	7,800	455.00	3,549,000
コネクシオ	9,900	1,494.00	14,790,600
クロップス	3,500	873.00	3,055,500
日本電信電話	1,983,000	2,874.50	5,700,133,500
KDDI	1,359,600	3,632.00	4,938,067,200
ソフトバンク	1,540,900	1,409.00	2,171,128,100
光通信	20,000	20,820.00	416,400,000
エムティーアイ	17,000	679.00	11,543,000
GMOインターネット	60,100	3,105.00	186,610,500
ファイバーゲート	5,800	1,504.00	8,723,200
アйдママーケティングコミュニケーション	5,300	434.00	2,300,200
KADOKAWA	44,000	4,675.00	205,700,000
学研ホールディングス	24,200	1,382.00	33,444,400
ゼンリン	31,100	1,164.00	36,200,400
昭文社ホールディングス	7,600	482.00	3,663,200
インプレスホールディングス	14,000	208.00	2,912,000
アイネット	9,000	1,430.00	12,870,000
松竹	11,200	13,240.00	148,288,000
東宝	100,100	4,660.00	466,466,000
東映	5,600	21,480.00	120,288,000
エヌ・ティ・ティ・データ	451,600	1,713.00	773,590,800
ピー・シー・エー	2,600	4,160.00	10,816,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,763.00	10,578,000
DTS	35,300	2,637.00	93,086,100
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,400	5,870.00	424,988,000
シーイーシー	18,400	1,522.00	28,004,800
カブコン	145,400	3,325.00	483,455,000
アイ・エス・ビー	8,100	1,426.00	11,550,600
ジャステック	11,100	1,293.00	14,352,300
SCSK	39,200	6,250.00	245,000,000
日本システムウエア	5,800	2,297.00	13,322,600
アイネス	17,000	1,350.00	22,950,000
TKC	28,800	3,335.00	96,048,000



富士ソフト	18,100	5,580.00	100,998,000
N S D	54,700	1,799.00	98,405,300
コナミホールディングス	61,600	7,230.00	445,368,000
福井コンピュータホールディングス	7,900	4,225.00	33,377,500
J B C Cホールディングス	11,700	1,332.00	15,584,400
ミロク情報サービス	17,000	1,622.00	27,574,000
ソフトバンクグループ	1,345,200	8,022.00	10,791,194,400
ハウスイ	1,400	958.00	1,341,200
高千穂交易	6,600	1,132.00	7,471,200
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,734.00	4,855,200
伊藤忠食品	4,100	5,230.00	21,443,000
エレマテック	13,600	1,233.00	16,768,800
J A L U X	4,800	1,907.00	9,153,600
あらた	13,500	4,130.00	55,755,000
トーメンデバイス	2,200	3,960.00	8,712,000
東京エレクトロン デバイス	5,600	5,660.00	31,696,000
フィールズ	14,900	483.00	7,196,700
双日	939,800	346.00	325,170,800
アルフレッサ ホールディングス	176,500	1,698.00	299,697,000
横浜冷凍	47,700	890.00	42,453,000
ラサ商事	9,000	914.00	8,226,000
アルコニックス	18,100	1,496.00	27,077,600
神戸物産	117,400	2,848.00	334,355,200
ハイパー	3,500	547.00	1,914,500
あい ホールディングス	24,300	2,167.00	52,658,100
ディーブイエックス	5,200	987.00	5,132,400
ダイワボウホールディングス	77,500	1,744.00	135,160,000
マクニカ・富士エレホールディングス	40,600	2,446.00	99,307,600
ラクト・ジャパン	7,400	2,837.00	20,993,800
グリムス	5,100	1,762.00	8,986,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,600	716.00	21,193,600
八洲電機	13,200	984.00	12,988,800
メディアスホールディングス	9,700	1,035.00	10,039,500
レスターホールディングス	17,700	1,881.00	33,293,700
ジュテックホールディングス	3,900	1,014.00	3,954,600
大光	6,600	686.00	4,527,600
O C H Iホールディングス	5,000	1,286.00	6,430,000
T O K A Iホールディングス	82,500	886.00	73,095,000
黒谷	4,700	951.00	4,469,700
C o m i n i x	3,000	754.00	2,262,000
三洋貿易	17,200	1,304.00	22,428,800
ビューティガレージ	2,700	3,685.00	9,949,500

ウイン・パートナーズ	12,300	979.00	12,041,700
ミタチ産業	4,700	659.00	3,097,300
シップヘルスケアホールディングス	60,000	2,582.00	154,920,000
明治電機工業	5,900	1,339.00	7,900,100
デリカフーズホールディングス	6,700	635.00	4,254,500
スターティアホールディングス	3,300	1,372.00	4,527,600
コメダホールディングス	37,100	2,063.00	76,537,300
ピーバンドットコム	2,400	805.00	1,932,000
アセンテック	4,400	1,408.00	6,195,200
富士興産	5,200	1,221.00	6,349,200
協栄産業	1,900	1,394.00	2,648,600
小野建	15,300	1,319.00	20,180,700
南陽	3,500	1,914.00	6,699,000
佐島電機	10,600	777.00	8,236,200
エコートレーディング	3,600	623.00	2,242,800
伯東	10,400	1,539.00	16,005,600
コンドーテック	13,200	1,005.00	13,266,000
中山福	9,900	487.00	4,821,300
ナガイレーベン	22,600	2,590.00	58,534,000
三菱食品	18,700	2,931.00	54,809,700
松田産業	12,400	2,194.00	27,205,600
第一興商	33,800	4,475.00	151,255,000
メディバルホールディングス	170,500	2,182.00	372,031,000
S P K	7,300	1,350.00	9,855,000
萩原電気ホールディングス	6,300	2,441.00	15,378,300
アズワン	12,200	12,870.00	157,014,000
スズデン	5,900	1,470.00	8,673,000
尾家産業	5,000	1,252.00	6,260,000
シモジマ	10,400	1,105.00	11,492,000
ドウシシャ	16,100	1,694.00	27,273,400
小津産業	3,800	1,932.00	7,341,600
高速	9,000	1,461.00	13,149,000
たけびし	6,000	1,559.00	9,354,000
リックス	3,900	1,548.00	6,037,200
丸文	15,100	634.00	9,573,400
ハピネット	14,200	1,460.00	20,732,000
橋本総業ホールディングス	3,400	2,754.00	9,363,600
日本ライフライン	55,000	1,408.00	77,440,000
タカショー	11,100	820.00	9,102,000
マルカ	5,500	2,412.00	13,266,000
I D O M	57,400	635.00	36,449,000
進和	10,100	2,140.00	21,614,000

エスケイジャパン	4,200	452.00	1,898,400
ダイترون	7,200	2,050.00	14,760,000
シークス	21,700	1,603.00	34,785,100
田中商事	5,300	710.00	3,763,000
オーハシテクニカ	8,700	1,498.00	13,032,600
白銅	6,100	1,888.00	11,516,800
ダイコー通産	2,000	1,488.00	2,976,000
伊藤忠商事	1,190,100	3,363.00	4,002,306,300
丸紅	1,678,000	1,004.00	1,684,712,000
高島	2,700	1,756.00	4,741,200
長瀬産業	93,400	1,632.00	152,428,800
蝶理	10,900	1,717.00	18,715,300
豊田通商	170,900	5,200.00	888,680,000
三共生興	25,800	538.00	13,880,400
兼松	68,000	1,505.00	102,340,000
ツカモトコーポレーション	2,800	1,400.00	3,920,000
三井物産	1,357,400	2,552.00	3,464,084,800
日本紙パルプ商事	8,900	3,605.00	32,084,500
カメイ	22,200	1,156.00	25,663,200
東都水産	2,000	4,590.00	9,180,000
OUGホールディングス	2,700	2,853.00	7,703,100
スターゼン	12,600	2,135.00	26,901,000
山善	66,500	971.00	64,571,500
椿本興業	3,100	3,415.00	10,586,500
住友商事	1,073,800	1,527.50	1,640,229,500
内田洋行	7,300	4,840.00	35,332,000
三菱商事	1,036,000	3,072.00	3,182,592,000
第一実業	7,700	4,250.00	32,725,000
キャノンマーケティングジャパン	42,200	2,643.00	111,534,600
西華産業	9,000	1,802.00	16,218,000
佐藤商事	14,100	1,122.00	15,820,200
菱洋エレクトロ	13,000	2,626.00	34,138,000
東京産業	15,500	617.00	9,563,500
ユアサ商事	17,400	3,060.00	53,244,000
神鋼商事	3,800	2,472.00	9,393,600
トルク	10,300	244.00	2,513,200
阪和興業	34,100	3,295.00	112,359,500
正栄食品工業	11,000	4,135.00	45,485,000
カナデン	13,800	1,078.00	14,876,400
菱電商事	12,300	1,621.00	19,938,300
フルサト工業	8,600	1,869.00	16,073,400
岩谷産業	40,800	6,180.00	252,144,000

ナイス	6,700	1,983.00	13,286,100
ニチモウ	2,700	2,130.00	5,751,000
極東貿易	4,900	2,357.00	11,549,300
アステナホールディングス	24,500	674.00	16,513,000
三愛石油	41,900	1,195.00	50,070,500
稲畑産業	40,900	1,710.00	69,939,000
G S I クレオス	8,400	1,005.00	8,442,000
明和産業	15,800	475.00	7,505,000
クワザワホールディングス	6,100	619.00	3,775,900
ヤマエ久野	12,400	1,135.00	14,074,000
ワキタ	33,500	1,119.00	37,486,500
東邦ホールディングス	54,600	1,732.00	94,567,200
サンゲツ	45,900	1,565.00	71,833,500
ミツウロコグループホールディングス	25,100	1,235.00	30,998,500
シナネンホールディングス	6,300	2,882.00	18,156,600
伊藤忠エネクス	37,700	1,019.00	38,416,300
サンリオ	47,800	1,925.00	92,015,000
サンワテクノス	11,200	1,217.00	13,630,400
リョーサン	18,800	2,016.00	37,900,800
新光商事	23,000	769.00	17,687,000
トーヨー	7,700	1,696.00	13,059,200
三信電気	9,100	2,135.00	19,428,500
東陽テクニカ	16,800	1,106.00	18,580,800
モスフードサービス	24,100	3,090.00	74,469,000
加賀電子	15,400	3,015.00	46,431,000
ソーダニッカ	16,300	574.00	9,356,200
立花エレテック	12,600	1,502.00	18,925,200
フォーバル	6,000	821.00	4,926,000
P A L T A C	27,300	5,850.00	159,705,000
三谷産業	22,500	391.00	8,797,500
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,900	2,890.00	11,271,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,500	1,895.00	2,842,500
コア商事ホールディングス	12,800	725.00	9,280,000
国際紙パルプ商事	36,400	252.00	9,172,800
ヤマタネ	7,300	1,508.00	11,008,400
丸紅建材リース	1,700	1,817.00	3,088,900
日鉄物産	12,100	4,485.00	54,268,500
泉州電業	4,800	3,580.00	17,184,000
トラスコ中山	39,000	2,877.00	112,203,000
オートバックスセブン	63,100	1,492.00	94,145,200
モリト	12,500	613.00	7,662,500
加藤産業	24,600	3,305.00	81,303,000

北恵	4,300	988.00	4,248,400
イノテック	9,600	1,357.00	13,027,200
イエローハット	32,200	1,928.00	62,081,600
J Kホールディングス	15,400	787.00	12,119,800
日伝	14,100	2,126.00	29,976,600
北沢産業	11,700	250.00	2,925,000
杉本商事	8,600	2,204.00	18,954,400
因幡電機産業	45,400	2,562.00	116,314,800
東テク	5,600	2,696.00	15,097,600
ミスミグループ本社	213,500	3,510.00	749,385,000
アルテック	12,600	336.00	4,233,600
タキヒヨー	5,700	1,862.00	10,613,400
蔵王産業	3,300	1,461.00	4,821,300
スズケン	72,100	3,480.00	250,908,000
ジェコス	11,800	886.00	10,454,800
グローセル	18,500	427.00	7,899,500
ローソン	43,100	4,960.00	213,776,000
サンエー	13,000	4,300.00	55,900,000
カワチ薬品	12,000	2,283.00	27,396,000
エービーシー・マート	26,600	6,460.00	171,836,000
ハードオフコーポレーション	8,000	787.00	6,296,000
アスクル	27,700	1,869.00	51,771,300
ゲオホールディングス	23,100	1,211.00	27,974,100
アダストリア	23,800	2,040.00	48,552,000
くら寿司	20,100	3,900.00	78,390,000
キャンドウ	8,300	1,963.00	16,292,900
アイケイ	5,400	786.00	4,244,400
パルグループホールディングス	15,100	1,718.00	25,941,800
エディオン	72,500	1,066.00	77,285,000
サーラコーポレーション	35,200	600.00	21,120,000
ワッツ	8,700	937.00	8,151,900
ハローズ	7,000	2,720.00	19,040,000
フジオフードグループ本社	14,300	1,383.00	19,776,900
あみやき亭	3,800	2,979.00	11,320,200
大黒天物産	5,500	7,800.00	42,900,000
ハニーズホールディングス	13,900	1,039.00	14,442,100
ファーマライズホールディングス	4,600	780.00	3,588,000
アルペン	13,200	2,873.00	37,923,600
ハブ	6,000	798.00	4,788,000
クオールホールディングス	23,200	1,512.00	35,078,400
ジーンズホールディングス	11,600	7,930.00	91,988,000
ビックカメラ	101,300	1,123.00	113,759,900

D C Mホールディングス	105,400	1,054.00	111,091,600
M o n o t a R O	242,100	2,625.00	635,512,500
東京一番フーズ	5,000	595.00	2,975,000
きちりホールディングス	4,500	616.00	2,772,000
アークランドサービスホールディングス	14,400	2,317.00	33,364,800
J . フロント リテイリング	203,500	1,163.00	236,670,500
ドトール・日レスホールディングス	27,200	1,735.00	47,192,000
マツモトキヨシホールディングス	70,400	4,960.00	349,184,000
ブロンコピリー	9,100	2,540.00	23,114,000
Z O Z O	100,400	3,745.00	375,998,000
トレジャー・ファクトリー	5,400	1,010.00	5,454,000
物語コーポレーション	9,100	7,290.00	66,339,000
ココカラファイン	15,200	8,330.00	126,616,000
三越伊勢丹ホールディングス	298,200	866.00	258,241,200
H a m e e	4,600	1,633.00	7,511,800
マーケットエンタープライズ	1,400	1,197.00	1,675,800
ウエルシアホールディングス	90,100	3,430.00	309,043,000
クリエイトSDホールディングス	25,200	3,245.00	81,774,000
丸善C H Iホールディングス	19,900	401.00	7,979,900
ミサワ	4,000	678.00	2,712,000
ティーライフ	2,600	1,450.00	3,770,000
チムニー	5,200	1,413.00	7,347,600
シュッピン	12,000	1,037.00	12,444,000
オイシックス・ラ・大地	22,500	3,480.00	78,300,000
ネクステージ	30,200	1,651.00	49,860,200
ジョイフル本田	50,100	1,377.00	68,987,700
鳥貴族ホールディングス	6,500	1,959.00	12,733,500
ホットランド	13,000	1,422.00	18,486,000
すかいらーくホールディングス	217,100	1,605.00	348,445,500
S F Pホールディングス	8,300	1,540.00	12,782,000
綿半ホールディングス	13,100	1,247.00	16,335,700
ヨシックス	3,500	2,460.00	8,610,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	49,800	1,096.00	54,580,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,100	1,366.00	12,430,600
B E E N O S	8,700	3,725.00	32,407,500
あさひ	12,900	1,435.00	18,511,500
日本調剤	10,600	1,614.00	17,108,400
コスモス薬品	17,200	15,390.00	264,708,000
トーエル	8,800	819.00	7,207,200
オンリー	3,800	502.00	1,907,600
セブン&アイ・ホールディングス	665,700	4,857.00	3,233,304,900

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	91,500	934.00	85,461,000	
ツルハホールディングス	37,100	13,600.00	504,560,000	
サンマルクホールディングス	13,700	1,701.00	23,303,700	
フェリシモ	4,100	1,392.00	5,707,200	
トリドールホールディングス	42,300	1,871.00	79,143,300	
TOKYO BASE	15,900	788.00	12,529,200	
ウイルプラスホールディングス	3,000	1,262.00	3,786,000	
JMホールディングス	11,600	2,214.00	25,682,400	
サツドラホールディングス	2,700	2,092.00	5,648,400	
アレンザホールディングス	13,300	1,278.00	16,997,400	
串カツ田中ホールディングス	4,700	1,977.00	9,291,900	
パロックジャパンリミテッド	12,300	808.00	9,938,400	
クスリのアオキホールディングス	17,000	8,170.00	138,890,000	
力の源ホールディングス	7,700	676.00	5,205,200	
FOOD & LIFE COMPANIES	99,700	4,810.00	479,557,000	
メディカルシステムネットワーク	15,300	735.00	11,245,500	
はるやまホールディングス	8,500	671.00	5,703,500	
ノジマ	30,400	2,996.00	91,078,400	
カップ・クリエイト	23,900	1,507.00	36,017,300	
ライトオン	12,700	699.00	8,877,300	
良品計画	196,000	2,110.00	413,560,000	
三城ホールディングス	22,500	274.00	6,165,000	
アドヴァン	17,700	958.00	16,956,600	
アルビス	5,600	2,286.00	12,801,600	
コナカ	20,000	369.00	7,380,000	
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,635.00	3,760,500	
G - 7ホールディングス	8,400	2,835.00	23,814,000	
イオン北海道	22,600	1,043.00	23,571,800	
コジマ	29,700	760.00	22,572,000	
ヒマラヤ	6,300	1,020.00	6,426,000	
コーナン商事	24,300	3,810.00	92,583,000	
エコス	6,500	1,912.00	12,428,000	
ワタミ	22,400	1,040.00	23,296,000	
マルシェ	4,500	525.00	2,362,500	
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	340,300	2,322.00	790,176,600	
西松屋チェーン	37,600	1,500.00	56,400,000	
ゼンショーホールディングス	91,500	2,806.00	256,749,000	
幸楽苑ホールディングス	10,800	1,684.00	18,187,200	
ハークスレイ	4,000	1,027.00	4,108,000	
サイゼリヤ	25,400	2,707.00	68,757,800	

V Tホールディングス	64,900	479.00	31,087,100
魚力	5,500	1,957.00	10,763,500
フジ・コーポレーション	9,300	1,268.00	11,792,400
ユナイテッドアローズ	19,700	2,317.00	45,644,900
ハイデイ日高	24,800	1,860.00	46,128,000
京都きもの友禅	12,300	284.00	3,493,200
コロワイド	56,500	2,056.00	116,164,000
ピーシーデポコーポレーション	20,600	456.00	9,393,600
巻番屋	12,100	4,900.00	59,290,000
P L A N T	4,900	719.00	3,523,100
スギホールディングス	34,000	8,750.00	297,500,000
薬王堂ホールディングス	7,600	2,376.00	18,057,600
スクロール	24,700	855.00	21,118,500
ヨンドシーホールディングス	15,900	1,930.00	30,687,000
木曽路	22,400	2,423.00	54,275,200
S R Sホールディングス	22,400	839.00	18,793,600
リテールパートナーズ	21,000	1,166.00	24,486,000
ケーヨー	31,700	753.00	23,870,100
上新電機	19,700	2,761.00	54,391,700
日本瓦斯	84,300	1,774.00	149,548,200
ロイヤルホールディングス	29,700	2,353.00	69,884,100
いなげや	19,100	1,474.00	28,153,400
チヨダ	18,200	920.00	16,744,000
ライフコーポレーション	17,100	3,400.00	58,140,000
リンガーハット	21,000	2,372.00	49,812,000
M r M a x H D	24,000	650.00	15,600,000
A O K Iホールディングス	34,600	747.00	25,846,200
オークワ	26,900	1,126.00	30,289,400
コメリ	26,400	2,601.00	68,666,400
青山商事	38,300	855.00	32,746,500
しまむら	19,800	9,740.00	192,852,000
はせがわ	10,300	297.00	3,059,100
高島屋	124,100	1,338.00	166,045,800
松屋	37,400	989.00	36,988,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	80,800	977.00	78,941,600
近鉄百貨店	6,600	3,225.00	21,285,000
丸井グループ	144,000	2,254.00	324,576,000
アクシアル リテイリング	14,200	3,875.00	55,025,000
イオン	654,800	2,963.00	1,940,172,400
イズミ	34,600	4,230.00	146,358,000
平和堂	31,500	2,307.00	72,670,500
フジ	20,600	2,000.00	41,200,000



ヤオコー	19,300	6,450.00	124,485,000
ゼビオホールディングス	21,000	1,009.00	21,189,000
ケーズホールディングス	145,100	1,305.00	189,355,500
Olympicグループ	9,300	794.00	7,384,200
日産東京販売ホールディングス	26,600	242.00	6,437,200
シルバーライフ	3,600	2,420.00	8,712,000
Genky DrugStores	7,600	3,660.00	27,816,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	1,193.00	4,294,800
ブックオフグループホールディングス	9,900	940.00	9,306,000
ギフト	2,300	2,346.00	5,395,800
アインホールディングス	24,800	6,990.00	173,352,000
元気寿司	4,900	2,781.00	13,626,900
ヤマダホールディングス	571,000	515.00	294,065,000
アークランドサカモト	26,900	1,511.00	40,645,900
ニトリホールディングス	67,500	18,400.00	1,242,000,000
グルメ杵屋	12,500	985.00	12,312,500
愛眼	13,600	230.00	3,128,000
ケーユーホールディングス	9,300	968.00	9,002,400
吉野家ホールディングス	56,100	2,101.00	117,866,100
松屋フーズホールディングス	8,300	3,575.00	29,672,500
サガミホールディングス	24,400	1,055.00	25,742,000
関西スーパーマーケット	13,200	1,006.00	13,279,200
王将フードサービス	11,300	5,630.00	63,619,000
プレナス	19,300	2,038.00	39,333,400
ミニストップ	12,700	1,416.00	17,983,200
アークス	32,600	2,415.00	78,729,000
パローホールディングス	34,900	2,273.00	79,327,700
ベルク	8,500	5,650.00	48,025,000
大庄	9,500	1,150.00	10,925,000
ファーストリテイリング	22,800	83,280.00	1,898,784,000
サンドラッグ	64,100	3,555.00	227,875,500
サクスパー ホールディングス	15,100	655.00	9,890,500
ヤマザワ	4,200	1,717.00	7,211,400
やまや	3,500	2,328.00	8,148,000
ベルーナ	36,900	1,100.00	40,590,000
島根銀行	5,900	652.00	3,846,800
じもとホールディングス	11,500	654.00	7,521,000
めぶきフィナンシャルグループ	885,400	232.00	205,412,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,400	1,442.00	30,858,800
九州フィナンシャルグループ	348,000	405.00	140,940,000
ゆうちょ銀行	482,700	930.00	448,911,000
富山第一銀行	40,600	276.00	11,205,600

コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,038,100	409.00	424,582,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	111,300	665.00	74,014,500	
三十三フィナンシャルグループ	14,700	1,350.00	19,845,000	
第四北越フィナンシャルグループ	27,700	2,376.00	65,815,200	
ひろぎんホールディングス	251,300	578.00	145,251,400	
新生銀行	138,900	1,596.00	221,684,400	
あおぞら銀行	101,500	2,498.00	253,547,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,656,200	622.30	7,253,653,260	
りそなホールディングス	1,966,400	452.60	889,992,640	
三井住友トラスト・ホールディングス	322,100	3,684.00	1,186,616,400	
三井住友フィナンシャルグループ	1,179,200	3,951.00	4,659,019,200	
千葉銀行	568,700	691.00	392,971,700	
群馬銀行	350,700	355.00	124,498,500	
武蔵野銀行	25,400	1,695.00	43,053,000	
千葉興業銀行	43,400	265.00	11,501,000	
筑波銀行	70,800	170.00	12,036,000	
七十七銀行	53,500	1,296.00	69,336,000	
青森銀行	13,200	2,129.00	28,102,800	
秋田銀行	10,200	1,403.00	14,310,600	
山形銀行	19,100	884.00	16,884,400	
岩手銀行	11,200	1,772.00	19,846,400	
東邦銀行	152,400	206.00	31,394,400	
東北銀行	8,200	1,022.00	8,380,400	
みちのく銀行	10,900	974.00	10,616,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	153,800	2,017.00	310,214,600	
静岡銀行	415,000	874.00	362,710,000	
十六銀行	21,400	1,961.00	41,965,400	
スルガ銀行	149,400	345.00	51,543,000	
八十二銀行	383,800	362.00	138,935,600	
山梨中央銀行	19,800	836.00	16,552,800	
大垣共立銀行	33,700	1,880.00	63,356,000	
福井銀行	14,600	1,461.00	21,330,600	
北國銀行	15,800	2,211.00	34,933,800	
清水銀行	7,000	1,550.00	10,850,000	
富山銀行	3,300	2,631.00	8,682,300	
滋賀銀行	34,200	2,060.00	70,452,000	
南都銀行	24,800	1,830.00	45,384,000	
百五銀行	153,300	303.00	46,449,900	
京都銀行	61,000	5,220.00	318,420,000	
紀陽銀行	60,300	1,457.00	87,857,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	113,400	854.00	96,843,600	
山陰合同銀行	107,400	533.00	57,244,200	

中国銀行	146,600	860.00	126,076,000
鳥取銀行	5,400	1,122.00	6,058,800
伊予銀行	225,800	564.00	127,351,200
百十四銀行	18,100	1,471.00	26,625,100
四国銀行	24,200	694.00	16,794,800
阿波銀行	26,100	2,060.00	53,766,000
大分銀行	9,800	1,734.00	16,993,200
宮崎銀行	10,600	2,026.00	21,475,600
佐賀銀行	9,700	1,391.00	13,492,700
沖縄銀行	15,600	2,610.00	40,716,000
琉球銀行	37,000	740.00	27,380,000
セブン銀行	569,300	233.00	132,646,900
みずほフィナンシャルグループ	2,315,400	1,653.50	3,828,513,900
高知銀行	6,200	863.00	5,350,600
山口フィナンシャルグループ	212,700	644.00	136,978,800
長野銀行	5,600	1,124.00	6,294,400
名古屋銀行	13,700	2,647.00	36,263,900
北洋銀行	256,900	244.00	62,683,600
愛知銀行	5,700	2,823.00	16,091,100
中京銀行	6,100	1,509.00	9,204,900
大光銀行	5,800	1,418.00	8,224,400
愛媛銀行	23,800	835.00	19,873,000
トマト銀行	6,600	1,063.00	7,015,800
京葉銀行	72,700	413.00	30,025,100
栃木銀行	82,300	174.00	14,320,200
北日本銀行	5,300	1,729.00	9,163,700
東和銀行	29,900	534.00	15,966,600
福島銀行	19,500	232.00	4,524,000
大東銀行	8,200	605.00	4,961,000
トモニホールディングス	131,700	300.00	39,510,000
フィデアホールディングス	165,400	122.00	20,178,800
池田泉州ホールディングス	195,900	162.00	31,735,800
F P G	57,600	791.00	45,561,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,600	1,627.00	18,873,200
マーキュリアインベストメント	6,900	759.00	5,237,100
S B Iホールディングス	210,000	2,710.00	569,100,000
ジャフコ グループ	26,200	7,460.00	195,452,000
大和証券グループ本社	1,276,500	633.50	808,662,750
野村ホールディングス	2,602,000	592.00	1,540,384,000
岡三証券グループ	145,700	436.00	63,525,200
丸三証券	50,900	643.00	32,728,700
東洋証券	57,600	171.00	9,849,600

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	182,200	410.00	74,702,000
光世証券	4,400	654.00	2,877,600
水戸証券	46,200	304.00	14,044,800
いちよし証券	34,500	592.00	20,424,000
松井証券	83,700	829.00	69,387,300
マネックスグループ	153,100	767.00	117,427,700
極東証券	23,100	823.00	19,011,300
岩井コスモホールディングス	17,600	1,688.00	29,708,800
藍澤証券	30,800	1,094.00	33,695,200
マネーパートナーズグループ	19,100	250.00	4,775,000
スパークス・グループ	79,500	271.00	21,544,500
かんぽ生命保険	211,200	2,141.00	452,179,200
S O M P Oホールディングス	300,400	4,276.00	1,284,510,400
アニコム ホールディングス	47,900	939.00	44,978,100
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	413,800	3,365.00	1,392,437,000
第一生命ホールディングス	900,200	2,228.00	2,005,645,600
東京海上ホールディングス	561,200	5,134.00	2,881,200,800
T & Dホールディングス	509,300	1,470.00	748,671,000
アドバンスクリエイト	8,100	906.00	7,338,600
全国保証	44,400	4,815.00	213,786,000
イントラスト	5,200	720.00	3,744,000
日本モーゲージサービス	9,000	1,006.00	9,054,000
C a s a	5,000	969.00	4,845,000
アルヒ	25,300	1,579.00	39,948,700
プレミアグループ	8,000	3,515.00	28,120,000
クレディセゾン	99,700	1,442.00	143,767,400
芙蓉総合リース	17,900	7,240.00	129,596,000
みずほリース	26,400	3,585.00	94,644,000
東京センチュリー	39,600	6,140.00	243,144,000
日本証券金融	72,400	861.00	62,336,400
アイフル	286,700	378.00	108,372,600
リコーリース	13,500	3,475.00	46,912,500
イオンフィナンシャルサービス	104,500	1,348.00	140,866,000
アコム	343,000	501.00	171,843,000
ジャックス	18,900	2,639.00	49,877,100
オリエントコーポレーション	462,700	159.00	73,569,300
オリックス	1,034,600	1,966.50	2,034,540,900
三菱H C キャピタル	589,800	615.00	362,727,000
九州リースサービス	8,800	685.00	6,028,000
日本取引所グループ	460,400	2,526.50	1,163,200,600
イー・ギャランティ	19,700	2,231.00	43,950,700
アサックス	9,200	722.00	6,642,400

NECキャピタルソリューション	7,100	2,136.00	15,165,600
いちご	194,100	368.00	71,428,800
日本駐車場開発	196,800	160.00	31,488,000
スター・マイカ・ホールディングス	10,200	1,121.00	11,434,200
SREホールディングス	2,800	6,150.00	17,220,000
ADワークスグループ	34,200	167.00	5,711,400
ヒューリック	362,700	1,315.00	476,950,500
三栄建築設計	7,600	2,014.00	15,306,400
野村不動産ホールディングス	104,100	3,025.00	314,902,500
三重交通グループホールディングス	37,600	492.00	18,499,200
サムティ	25,000	2,052.00	51,300,000
ディア・ライフ	25,200	473.00	11,919,600
日本商業開発	11,600	1,884.00	21,854,400
プレサンスコーポレーション	28,900	1,506.00	43,523,400
ハウスコム	4,200	1,245.00	5,229,000
日本管理センター	10,400	1,316.00	13,686,400
サンセイランディック	6,800	888.00	6,038,400
フージャースホールディングス	27,800	752.00	20,905,600
オープンハウス	54,400	5,330.00	289,952,000
東急不動産ホールディングス	465,600	731.00	340,353,600
飯田グループホールディングス	142,600	3,035.00	432,791,000
イーランド	4,300	1,033.00	4,441,900
ムゲンエステート	13,500	529.00	7,141,500
ハウズドゥ	8,400	1,055.00	8,862,000
シーアールイー	5,500	1,584.00	8,712,000
グッドコムアセット	9,200	1,399.00	12,870,800
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,545.00	12,762,000
テンポイノベーション	6,600	969.00	6,395,400
フェイスネットワーク	2,500	1,393.00	3,482,500
パーク24	92,100	2,511.00	231,263,100
パラカ	5,300	1,649.00	8,739,700
三井不動産	777,200	2,747.00	2,134,968,400
三菱地所	1,120,200	1,933.50	2,165,906,700
平和不動産	29,500	4,235.00	124,932,500
東京建物	169,200	1,761.00	297,961,200
ダイビル	44,400	1,349.00	59,895,600
京阪神ビルディング	30,500	1,428.00	43,554,000
住友不動産	383,400	4,090.00	1,568,106,000
テーオーシー	35,500	704.00	24,992,000
東京楽天地	3,200	4,355.00	13,936,000
スターツコーポレーション	20,800	2,840.00	59,072,000
フジ住宅	22,200	633.00	14,052,600

空港施設	19,500	694.00	13,533,000
明和地所	10,500	627.00	6,583,500
ゴールドクレスト	16,200	1,820.00	29,484,000
エスリード	7,600	1,662.00	12,631,200
日神グループホールディングス	28,400	466.00	13,234,400
日本エスコン	30,900	788.00	24,349,200
タカラレーベン	71,400	355.00	25,347,000
A V A N T I A	10,500	898.00	9,429,000
イオンモール	86,300	1,882.00	162,416,600
毎日コムネット	8,000	700.00	5,600,000
ファースト住建	8,500	1,230.00	10,455,000
カチタス	42,700	3,190.00	136,213,000
トーセイ	24,900	1,127.00	28,062,300
穴吹興産	4,400	2,117.00	9,314,800
サンフロンティア不動産	22,600	1,027.00	23,210,200
エフ・ジェー・ネクスト	18,200	1,020.00	18,564,000
インテリックス	3,800	770.00	2,926,000
ランドビジネス	7,200	362.00	2,606,400
サンネクスタグループ	6,900	1,015.00	7,003,500
グランディハウス	15,100	430.00	6,493,000
日本空港ビルデング	59,500	5,470.00	325,465,000
明豊ファシリティワークス	7,900	843.00	6,659,700
日本工営	10,400	3,120.00	32,448,000
L I F U L L	51,200	363.00	18,585,600
ミクシィ	42,100	2,841.00	119,606,100
ジェイエシーリクルートメント	11,500	1,806.00	20,769,000
日本M&Aセンター	270,900	2,689.00	728,450,100
メンバーズ	5,000	3,315.00	16,575,000
中広	3,000	358.00	1,074,000
UTグループ	23,900	2,978.00	71,174,200
アイティメディア	5,700	1,752.00	9,986,400
タケエイ	18,600	1,315.00	24,459,000
E・Jホールディングス	8,900	1,104.00	9,825,600
夢真ビーネックスグループ	44,100	1,295.00	57,109,500
コシダカホールディングス	44,600	644.00	28,722,400
アルトナー	4,300	846.00	3,637,800
パソナグループ	18,000	2,033.00	36,594,000
C D S	4,300	1,525.00	6,557,500
リンクアンドモチベーション	30,300	634.00	19,210,200
G C A	21,900	1,013.00	22,184,700
エス・エム・エス	56,200	3,280.00	184,336,000
サニーサイドアップグループ	6,100	865.00	5,276,500

パーソルホールディングス	165,200	2,257.00	372,856,400
リニカル	9,700	843.00	8,177,100
クックパッド	52,900	260.00	13,754,000
アイ・ケイ・ケイ	8,400	684.00	5,745,600
学情	6,000	1,411.00	8,466,000
スタジオアリス	8,400	2,258.00	18,967,200
シミックホールディングス	9,300	1,561.00	14,517,300
エプロ	4,300	944.00	4,059,200
N J S	4,200	2,114.00	8,878,800
総合警備保障	65,700	5,060.00	332,442,000
カカクコム	122,000	3,445.00	420,290,000
アイロムグループ	5,900	2,120.00	12,508,000
セントケア・ホールディング	12,300	1,083.00	13,320,900
サイネックス	3,200	703.00	2,249,600
ルネサンス	10,600	1,355.00	14,363,000
ディップ	25,900	3,575.00	92,592,500
デジタルホールディングス	11,600	2,386.00	27,677,600
新日本科学	20,500	771.00	15,805,500
キャリアデザインセンター	4,400	1,100.00	4,840,000
ベネフィット・ワン	60,200	3,420.00	205,884,000
エムスリー	291,300	7,297.00	2,125,616,100
ツカダ・グローバルホールディング	13,100	429.00	5,619,900
アウトソーシング	94,700	2,068.00	195,839,600
ウェルネット	17,200	523.00	8,995,600
ワールドホールディングス	5,800	2,758.00	15,996,400
ディー・エヌ・エー	70,000	2,235.00	156,450,000
博報堂D Yホールディングス	229,900	1,795.00	412,670,500
ぐるなび	29,200	615.00	17,958,000
タカミヤ	20,500	531.00	10,885,500
ジャパンベストレスキューシステム	11,200	770.00	8,624,000
ファンコミュニケーションズ	46,100	385.00	17,748,500
ライク	4,500	2,099.00	9,445,500
ビジネス・ブレークスルー	7,500	426.00	3,195,000
エスプール	42,700	929.00	39,668,300
W D Bホールディングス	7,600	2,756.00	20,945,600
手間いらず	2,100	6,450.00	13,545,000
ティア	10,200	475.00	4,845,000
C D G	1,700	1,578.00	2,682,600
アドウェイズ	27,100	837.00	22,682,700
バリューコマース	11,200	3,125.00	35,000,000
インフォマート	167,300	970.00	162,281,000
J Pホールディングス	48,100	283.00	13,612,300

エコナックホールディングス	32,900	92.00	3,026,800	
E P Sホールディングス	25,000	1,798.00	44,950,000	
レグス	4,200	2,732.00	11,474,400	
プレステージ・インターナショナル	62,300	710.00	44,233,000	
アミューズ	9,100	2,369.00	21,557,900	
ドリームインキュベータ	5,300	974.00	5,162,200	
クイック	10,500	1,248.00	13,104,000	
T A C	10,100	233.00	2,353,300	
電通グループ	185,700	3,790.00	703,803,000	
イオンファンタジー	6,500	2,354.00	15,301,000	
シーティーエス	18,900	880.00	16,632,000	
ネクシィーズグループ	6,100	946.00	5,770,600	
H . U . グループホールディングス	46,300	2,902.00	134,362,600	
アルプス技研	14,700	1,996.00	29,341,200	
ダイオーズ	3,500	1,027.00	3,594,500	
日本空調サービス	17,700	726.00	12,850,200	
オリエンタルランド	175,600	16,225.00	2,849,110,000	
ダスキン	38,400	2,588.00	99,379,200	
明光ネットワークジャパン	19,900	592.00	11,780,800	
ファルコホールディングス	8,000	1,730.00	13,840,000	
ラウンドワン	56,500	1,478.00	83,507,000	
リゾートトラスト	75,800	1,900.00	144,020,000	
ビー・エム・エル	21,300	3,685.00	78,490,500	
りらいあコミュニケーションズ	25,300	1,331.00	33,674,300	
リソー教育	84,700	318.00	26,934,600	
早稲田アカデミー	7,300	913.00	6,664,900	
ユー・エス・エス	185,000	1,887.00	349,095,000	
東京個別指導学院	15,000	618.00	9,270,000	
サイバーエージェント	407,000	2,130.00	866,910,000	
楽天グループ	770,700	1,279.00	985,725,300	
クリーク・アンド・リバー社	8,800	1,526.00	13,428,800	
モーニングスター	24,700	441.00	10,892,700	
テー・オー・ダブリュー	29,700	346.00	10,276,200	
山田コンサルティンググループ	9,800	1,210.00	11,858,000	
セントラルスポーツ	6,300	2,655.00	16,726,500	
フルキャストホールディングス	14,200	2,182.00	30,984,400	
エン・ジャパン	29,400	3,810.00	112,014,000	
リソルホールディングス	1,900	4,150.00	7,885,000	
テクノプロ・ホールディングス	33,000	7,970.00	263,010,000	
アトラグループ	3,800	346.00	1,314,800	
インターワークス	5,400	433.00	2,338,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,700	13,570.00	90,919,000	



KeepEr 技研	10,700	2,571.00	27,509,700
ファーストロジック	3,600	723.00	2,602,800
三機サービス	3,400	1,035.00	3,519,000
Gunosy	10,600	910.00	9,646,000
デザインワン・ジャパン	5,300	227.00	1,203,100
イー・ガーディアン	6,800	2,704.00	18,387,200
リブセンス	10,300	224.00	2,307,200
ジャパンマテリアル	51,000	1,314.00	67,014,000
ベクトル	20,900	946.00	19,771,400
ウチヤマホールディングス	8,900	408.00	3,631,200
チャーム・ケア・コーポレーション	12,500	1,137.00	14,212,500
キャリアリンク	5,500	2,256.00	12,408,000
I B J	13,800	1,154.00	15,925,200
アサンテ	6,100	1,781.00	10,864,100
バリューHR	6,700	1,762.00	11,805,400
M&Aキャピタルパートナーズ	13,600	4,685.00	63,716,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,507.00	9,946,200
E R Iホールディングス	5,100	597.00	3,044,700
アビスト	2,700	2,971.00	8,021,700
シグマクシス	9,200	2,135.00	19,642,000
ウィルグループ	12,400	1,014.00	12,573,600
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	25,600	249.00	6,374,400
メドピア	12,800	4,610.00	59,008,000
レアジョブ	3,200	1,843.00	5,897,600
リクルートホールディングス	1,182,600	5,805.00	6,864,993,000
エラン	23,000	1,323.00	30,429,000
土木管理総合試験所	8,800	381.00	3,352,800
ネットマーケティング	8,700	422.00	3,671,400
日本郵政	1,249,300	905.50	1,131,241,150
ベルシステム24ホールディングス	27,800	1,728.00	48,038,400
鎌倉新書	16,900	1,200.00	20,280,000
S M N	3,900	812.00	3,166,800
グローバルキッズCOMPANY	3,300	999.00	3,296,700
エアトリ	10,300	3,025.00	31,157,500
アトラエ	11,600	2,162.00	25,079,200
ストライク	6,300	4,185.00	26,365,500
ソラスト	40,700	1,357.00	55,229,900
セラク	5,300	2,104.00	11,151,200
インソース	16,100	2,065.00	33,246,500
ベイカレント・コンサルティング	10,800	36,600.00	395,280,000
Orchestra Holdings	3,800	2,866.00	10,890,800
アイモバイル	4,900	1,366.00	6,693,400

キャリアインデックス	7,200	755.00	5,436,000
MS - J a p a n	7,000	1,098.00	7,686,000
船場	3,600	823.00	2,962,800
グレイステクノロジー	16,900	1,698.00	28,696,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,700	2,473.00	117,962,100
フルテック	2,500	1,401.00	3,502,500
GameWith	5,400	623.00	3,364,200
ソウルドアウト	4,100	1,670.00	6,847,000
MS&Consulting	3,100	612.00	1,897,200
ウェルビー	6,300	1,434.00	9,034,200
エル・ティー・エス	1,700	3,620.00	6,154,000
ミダック	3,600	6,690.00	24,084,000
日総工産	13,300	834.00	11,092,200
キュービーネットホールディングス	7,700	1,895.00	14,591,500
RPAホールディングス	19,600	757.00	14,837,200
スプリックス	4,900	1,375.00	6,737,500
マネジメントソリューションズ	8,200	2,006.00	16,449,200
プロレド・パートナーズ	3,100	3,150.00	9,765,000
テノ・ホールディングス	2,000	1,175.00	2,350,000
フロンティア・マネジメント	3,900	1,302.00	5,077,800
ピアラ	1,400	1,112.00	1,556,800
コプロ・ホールディングス	2,400	1,284.00	3,081,600
ギークス	3,000	1,822.00	5,466,000
カーブスホールディングス	45,600	916.00	41,769,600
フォーラムエンジニアリング	11,700	979.00	11,454,300
ダイレクトマーケティングミックス	8,900	4,015.00	35,733,500
ポピンズホールディングス	4,400	4,875.00	21,450,000
LITALICO	6,700	5,180.00	34,706,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,700	1,043.00	9,074,100
リログループ	90,400	2,477.00	223,920,800
東祥	10,400	2,037.00	21,184,800
エイチ・アイ・エス	25,800	2,597.00	67,002,600
ラックランド	4,800	2,673.00	12,830,400
共立メンテナンス	27,400	4,050.00	110,970,000
イチネンホールディングス	17,400	1,237.00	21,523,800
建設技術研究所	10,700	2,481.00	26,546,700
スペース	11,000	925.00	10,175,000
長大	6,700	1,925.00	12,897,500
燦ホールディングス	7,400	1,233.00	9,124,200
スバル興業	1,000	8,390.00	8,390,000
東京テアトル	6,400	1,270.00	8,128,000
タナベ経営	3,400	1,442.00	4,902,800

ナガワ	5,300	8,020.00	42,506,000	
東京都競馬	10,900	4,750.00	51,775,000	
カナモト	29,200	2,702.00	78,898,400	
西尾レントオール	15,300	3,280.00	50,184,000	
トランス・コスモス	15,800	2,933.00	46,341,400	
乃村工藝社	71,100	971.00	69,038,100	
藤田観光	6,500	2,522.00	16,393,000	
KNT-CTホールディングス	8,800	1,543.00	13,578,400	
日本管財	17,800	2,345.00	41,741,000	
トーカイ	16,100	2,374.00	38,221,400	
セコム	162,700	8,666.00	1,409,958,200	
セントラル警備保障	8,000	3,175.00	25,400,000	
丹青社	31,500	906.00	28,539,000	
メイテック	20,000	6,270.00	125,400,000	
応用地質	18,800	1,294.00	24,327,200	
船井総研ホールディングス	33,900	2,370.00	80,343,000	
進学会ホールディングス	7,100	421.00	2,989,100	
オオバ	11,900	757.00	9,008,300	
いであ	4,200	1,794.00	7,534,800	
学究社	5,000	1,368.00	6,840,000	
ベネッセホールディングス	60,600	2,672.00	161,923,200	
イオンディライト	20,400	3,400.00	69,360,000	
ナック	8,100	924.00	7,484,400	
ダイセキ	27,700	4,345.00	120,356,500	
ステップ	6,200	1,602.00	9,932,400	
合計	181,094,500		464,020,632,450	

## (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。

国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	277,668,080
国債証券	525,477,801,550
地方債証券	34,090,642,975
特殊債証券	39,412,975,021
社債証券	28,507,269,740
未収入金	546,501,300
未収利息	1,340,393,027
前払費用	46,842,981
流動資産合計	629,700,094,674
資産合計	629,700,094,674
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	268,764,571
未払利息	306
流動負債合計	568,764,877
負債合計	568,764,877
純資産の部	
元本等	
元本	445,819,467,688
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	183,311,862,109
元本等合計	629,131,329,797
純資産合計	629,131,329,797
負債純資産合計	629,700,094,674

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 6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、特殊債証券、社債証券</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>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>

	2021年 6月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	445,819,467,688口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 <span style="float: right;">101,260,000円</span>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 <span style="float: right;">1.4112円</span> (1万口当たり純資産額) <span style="float: right;">(14,112円)</span>

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 6月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2021年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	387,020,022,692円
期中追加設定元本額	75,665,788,236円
期中一部解約元本額	16,866,343,240円
期末元本額	445,819,467,688円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,702,815,555円

区分	2021年 6月10日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,063,855円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,559,486,808円
世界経済インデックスファンド	2,453,642,515円
D Cマイセレクション25	24,213,463,967円
D Cマイセレクション50	27,441,435,241円
D Cマイセレクション75	7,953,090,341円
D C日本債券インデックス・オープン	431,339,819円
D C日本債券インデックス・オープンS	92,374,798,974円
D C日本債券インデックス・オープンP	68,977,820,548円
D CマイセレクションS25	11,072,172,492円
D CマイセレクションS50	12,381,237,028円
D CマイセレクションS75	2,629,353,908円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	968,904,758円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	1,835,741,070円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	667,614,296円
D C世界経済インデックスファンド	2,906,899,876円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,061,107円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,651,160円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	40,798,833円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	11,186,019円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,015,770円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	126,476,433円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	191,750,726円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	38,495,032円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	36,450,878円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,503,411,844円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	820,852,323円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,482,031,062円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	418,732,613円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	83,939,090円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,107,140,846円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,264,891,633円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,538,051,502円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	146,833,416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	14,119,177,871円
分散投資コア戦略ファンドA	26,190,440,582円
分散投資コア戦略ファンドS	26,545,528,373円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	125,262,611円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,213,391,817円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	54,599,939円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,412,216円
S M T インデックスバランス・オープン	57,481,598円

区分	2021年 6月10日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	23,357,153円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	40,456,582円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	63,498,436円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,480,604円
グローバル経済コア	194,349,779円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	21,403,979円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	5,361,444円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	6,039,614円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2,937,251円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	823,040円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	289,757円
F O F s用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	77,633,717,191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)	44,347,888円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,043,960,350
地方債証券	54,121,009
特殊債券	46,086,601
社債券	46,395,580
合計	1,190,563,540

(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414回利付国債(2年)	2,360,000,000	2,365,711,200	
	第415回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,062,777,200	
	第416回利付国債(2年)	4,530,000,000	4,543,046,400	
	第417回利付国債(2年)	4,240,000,000	4,253,016,800	
	第418回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,043,400,800	
	第419回利付国債(2年)	660,000,000	662,290,200	
	第420回利付国債(2年)	1,250,000,000	1,254,587,500	
	第421回利付国債(2年)	590,000,000	592,283,300	
	第422回利付国債(2年)	130,000,000	130,536,900	
	第423回利付国債(2年)	370,000,000	370,936,100	
	第424回利付国債(2年)	570,000,000	571,504,800	
	第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,392,307,800	
	第134回利付国債(5年)	5,700,000,000	5,719,608,000	
	第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,096,646,400	
	第136回利付国債(5年)	4,400,000,000	4,420,504,000	
	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,796,233,600	
	第138回利付国債(5年)	7,050,000,000	7,092,864,000	
	第139回利付国債(5年)	6,070,000,000	6,110,547,600	
	第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	6,345,927,000	
	第141回利付国債(5年)	7,790,000,000	7,850,216,700	
	第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,424,761,600	
	第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,842,768,000	
	第144回利付国債(5年)	6,520,000,000	6,581,940,000	
	第145回利付国債(5年)	8,240,000,000	8,321,493,600	
	第146回利付国債(5年)	2,460,000,000	2,485,190,400	
	第147回利付国債(5年)	1,450,000,000	1,458,337,500	
	第1回利付国債(40年)	400,000,000	579,448,000	
	第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,586,847,700	
	第3回利付国債(40年)	550,000,000	775,434,000	
	第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,697,856,000	
	第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,464,830,000	
	第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,701,642,600	
	第7回利付国債(40年)	1,040,000,000	1,351,459,200	
	第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,495,815,300	
	第9回利付国債(40年)	1,220,000,000	1,112,969,400	
	第10回利付国債(40年)	2,370,000,000	2,530,946,700	
	第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,853,187,000	
	第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,600,645,500	
	第13回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,903,952,400	
	第14回利付国債(40年)	200,000,000	199,688,000	
	第325回利付国債(10年)	4,590,000,000	4,643,978,400	

第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,159,093,600	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,234,851,400	
第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,443,758,000	
第329回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,270,572,700	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,940,565,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	915,102,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,889,376,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,092,387,700	
第334回利付国債(10年)	4,900,000,000	5,010,103,000	
第335回利付国債(10年)	2,370,000,000	2,419,509,300	
第336回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,073,614,500	
第337回利付国債(10年)	2,850,000,000	2,893,918,500	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,652,476,800	
第339回利付国債(10年)	4,780,000,000	4,883,439,200	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,464,032,800	
第341回利付国債(10年)	3,440,000,000	3,506,529,600	
第342回利付国債(10年)	5,300,000,000	5,355,968,000	
第343回利付国債(10年)	4,820,000,000	4,872,345,200	
第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,713,969,600	
第345回利付国債(10年)	3,340,000,000	3,378,977,800	
第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	6,425,565,000	
第347回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,927,025,600	
第348回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,940,072,800	
第349回利付国債(10年)	4,130,000,000	4,181,501,100	
第350回利付国債(10年)	7,960,000,000	8,060,296,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,668,593,100	
第352回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,948,477,000	
第353回利付国債(10年)	4,300,000,000	4,351,987,000	
第354回利付国債(10年)	4,690,000,000	4,744,873,000	
第355回利付国債(10年)	4,270,000,000	4,318,122,900	
第356回利付国債(10年)	4,640,000,000	4,690,019,200	
第357回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,697,340,800	
第358回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,826,573,500	
第359回利付国債(10年)	4,540,000,000	4,578,862,400	
第360回利付国債(10年)	5,920,000,000	5,966,590,400	
第361回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,771,473,600	
第362回利付国債(10年)	3,300,000,000	3,317,655,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	135,716,900	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	193,644,800	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	144,738,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	139,860,600	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	60,662,000	

第6回利付国債(30年)	350,000,000	434,773,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	223,335,000	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	417,350,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	275,392,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,201,600	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	308,510,800	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	235,229,500	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	491,584,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	1,025,584,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	441,789,200	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	260,672,000	
第17回利付国債(30年)	950,000,000	1,229,290,500	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	442,997,250	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	682,761,900	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	633,676,800	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	647,760,000	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	531,244,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	572,588,000	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	507,303,800	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	457,919,000	
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,511,913,600	
第27回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,387,269,800	
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,901,069,600	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,246,033,100	
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,361,321,600	
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,453,309,000	
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,097,700,800	
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,355,899,000	
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,400,220,150	
第35回利付国債(30年)	2,240,000,000	2,917,667,200	
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,783,611,800	
第37回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,673,570,600	
第38回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,911,015,000	
第39回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,945,575,000	
第40回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,570,968,300	
第41回利付国債(30年)	990,000,000	1,245,647,700	
第42回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,889,235,000	
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,752,484,200	
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,539,688,800	
第45回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,498,373,700	
第46回利付国債(30年)	1,750,000,000	2,133,145,000	
第47回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,677,496,500	

第48回利付国債(30年)	1,860,000,000	2,229,637,800
第49回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,726,905,600
第50回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,950,915,200
第51回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,706,703,300
第52回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,886,698,000
第53回利付国債(30年)	880,000,000	888,852,800
第54回利付国債(30年)	2,110,000,000	2,229,067,300
第55回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,625,793,400
第56回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,772,349,600
第57回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,634,025,500
第58回利付国債(30年)	2,600,000,000	2,738,892,000
第59回利付国債(30年)	620,000,000	636,634,600
第60回利付国債(30年)	2,630,000,000	2,828,196,800
第61回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,699,209,200
第62回利付国債(30年)	20,000,000	19,408,200
第63回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,093,833,600
第64回利付国債(30年)	2,550,000,000	2,400,570,000
第65回利付国債(30年)	860,000,000	808,253,800
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	966,407,800
第67回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,392,783,900
第68回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,844,717,600
第69回利付国債(30年)	840,000,000	850,399,200
第70回利付国債(30年)	980,000,000	989,751,000
第58回利付国債(20年)	300,000,000	307,746,000
第59回利付国債(20年)	200,000,000	205,564,000
第60回利付国債(20年)	350,000,000	358,130,500
第61回利付国債(20年)	240,000,000	244,795,200
第62回利付国債(20年)	320,000,000	326,006,400
第63回利付国債(20年)	200,000,000	207,814,000
第64回利付国債(20年)	320,000,000	334,832,000
第65回利付国債(20年)	220,000,000	231,316,800
第66回利付国債(20年)	330,000,000	346,140,300
第67回利付国債(20年)	130,000,000	137,342,400
第68回利付国債(20年)	190,000,000	202,317,700
第69回利付国債(20年)	390,000,000	414,199,500
第70回利付国債(20年)	400,000,000	430,792,000
第71回利付国債(20年)	200,000,000	214,182,000
第72回利付国債(20年)	630,000,000	676,229,400
第73回利付国債(20年)	360,000,000	387,162,000
第74回利付国債(20年)	200,000,000	215,798,000
第75回利付国債(20年)	130,000,000	140,990,200
第76回利付国債(20年)	270,000,000	290,779,200
第77回利付国債(20年)	290,000,000	313,417,500

第78回利付国債(20年)	170,000,000	183,962,100	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	293,265,900	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	239,848,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	425,630,400	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	657,396,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	319,295,800	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	515,340,900	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	320,824,100	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	234,336,900	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	2,033,294,700	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	471,261,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	390,946,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	707,238,000	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	507,559,500	
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	460,122,500	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	688,116,600	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	698,730,600	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,802,010,600	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	457,964,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	500,984,000	
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,475,450,400	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	554,712,000	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	836,028,050	
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,480,739,400	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	467,252,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	184,640,000	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,367,277,800	
第106回利付国債(20年)	380,000,000	443,087,600	
第107回利付国債(20年)	260,000,000	302,455,400	
第108回利付国債(20年)	660,000,000	757,792,200	
第109回利付国債(20年)	520,000,000	599,118,000	
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,284,536,000	
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,144,920,100	
第112回利付国債(20年)	790,000,000	926,101,200	
第113回利付国債(20年)	1,720,000,000	2,023,975,600	
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,751,869,800	
第115回利付国債(20年)	700,000,000	832,720,000	
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,779,119,600	
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,280,080,800	
第118回利付国債(20年)	660,000,000	778,773,600	
第119回利付国債(20年)	530,000,000	615,812,300	

第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,795,875,900
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,761,930,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,095,429,000
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,238,745,300
第124回利付国債(20年)	610,000,000	724,490,900
第125回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,202,673,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	869,276,700
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,204,681,200
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,148,994,100
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,045,349,500
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,513,357,350
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,167,500,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,357,559,600
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,452,334,800
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,337,581,000
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,208,210,600
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,685,393,000
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,281,567,500
第138回利付国債(20年)	620,000,000	715,430,400
第139回利付国債(20年)	730,000,000	850,325,900
第140回利付国債(20年)	2,200,000,000	2,593,954,000
第141回利付国債(20年)	1,780,000,000	2,103,319,200
第142回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,216,890,600
第143回利付国債(20年)	1,800,000,000	2,110,464,000
第144回利付国債(20年)	1,440,000,000	1,671,652,800
第145回利付国債(20年)	2,595,000,000	3,079,175,100
第146回利付国債(20年)	2,730,000,000	3,245,942,700
第147回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,900,340,000
第148回利付国債(20年)	2,230,000,000	2,605,643,500
第149回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,346,829,200
第150回利付国債(20年)	3,260,000,000	3,778,144,400
第151回利付国債(20年)	1,495,000,000	1,695,225,350
第152回利付国債(20年)	3,290,000,000	3,733,459,100
第153回利付国債(20年)	2,570,000,000	2,955,654,200
第154回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,070,494,000
第155回利付国債(20年)	2,800,000,000	3,107,412,000
第156回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,659,332,000
第157回利付国債(20年)	2,780,000,000	2,757,871,200
第158回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,515,681,800
第159回利付国債(20年)	2,930,000,000	3,076,353,500
第160回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,639,315,200
第161回利付国債(20年)	1,890,000,000	1,981,230,300
第162回利付国債(20年)	520,000,000	544,627,200

	第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,731,130,100
	第164回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,707,559,000
	第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,684,936,000
	第166回利付国債(20年)	900,000,000	953,640,000
	第167回利付国債(20年)	2,770,000,000	2,838,585,200
	第168回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,446,232,400
	第169回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,668,587,700
	第170回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,325,732,800
	第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,269,940,500
	第172回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,802,436,000
	第173回利付国債(20年)	3,200,000,000	3,197,152,000
	第174回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,415,668,200
	第175回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,208,266,500
	第176回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,694,382,000
	国債証券合計	490,580,000,000	525,477,801,550
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,251,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,525,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,974,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	131,783,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,878,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,758,000
	第16回東京都公募公債(20年)	300,000,000	344,079,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,293,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,580,000
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	100,010,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,972,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,494,000
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	200,090,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	101,162,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	101,100,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	101,743,000
	第726回東京都公募公債	200,000,000	203,666,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	101,631,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,676,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,036,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,840,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	302,310,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	199,898,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,341,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,007,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,390,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,138,000

平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	201,952,000	
第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	101,595,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	271,666,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,299,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	234,220,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,619,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,685,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,146,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,882,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,950,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,840,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	199,814,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	234,042,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	234,154,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	116,844,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,050,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,807,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,698,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,744,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,459,790	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,165,000	
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	156,645,840	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,702,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	500,000,000	504,805,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,026,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,495,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	116,720,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,798,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,205,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	99,812,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	104,050,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,300,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	114,497,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,096,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	436,428,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,955,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,930,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	472,336,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	201,728,000	



平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,750,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,652,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	102,667,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	301,386,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	120,853,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	103,910,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,848,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,568,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,189,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,900,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,020,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,094,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,053,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	117,778,000	
平成24年度第18回愛知県公募公債(10年)	150,000,000	152,041,500	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,130,000	
平成25年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,062,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,906,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,884,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,769,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,378,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,200,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	310,743,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,994,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	102,673,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,984,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,408,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	116,607,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	233,958,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,175,000	
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	100,861,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	114,292,000	

第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	115,582,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	232,054,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	107,553,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	235,740,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	201,188,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,220,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	199,790,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,371,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,815,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,108,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,344,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,247,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,902,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,453,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,993,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,429,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,502,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	108,028,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	132,046,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,941,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,107,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	102,673,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,847,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	301,479,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	100,307,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	232,054,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,219,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,848,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,832,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,573,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,148,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,343,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	121,010,400	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	299,715,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	100,000,000	100,735,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,050,000	
第112回共同発行市場公募地方債	220,000,000	222,050,400	

第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,838,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,154,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,178,000	
第119回共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,400,000	
第121回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,049,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,576,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,595,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,606,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,966,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,773,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,478,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	114,212,000	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,989,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,893,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,797,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,729,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,106,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,330,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,231,532	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,207,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,502,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,413,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,754,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,306,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,832,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,163,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,842,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,225,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,746,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,578,494	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,112,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,877,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	202,180,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債(5年)	100,000,000	100,000,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,158,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	235,544,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	300,708,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	104,506,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	200,708,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	130,265,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	134,968,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	115,143,000	

第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	125,765,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,123,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,127,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	301,476,000	
平成24年度第2回京都市公募公債	122,500,000	123,754,400	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,081,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	101,388,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,686,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	135,342,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	232,462,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	118,447,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	117,150,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	98,774,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,718,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	350,580,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,813,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,216,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,058,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,500,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	228,968,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	301,470,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,355,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	108,288,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,209,000	
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	116,062,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,716,000	
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	102,142,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,363,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	117,073,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	115,794,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	203,614,000	
平成30年度第5回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,086,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,758,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	152,700,000	

	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,597,000
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,783,300
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,160,700
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	551,138,500
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	200,146,000
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	199,810,000
	平成24年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	101,196,000
	平成24年度第2回岡山県公募公債（10年）	150,000,000	151,809,000
	平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	200,000,000	202,742,000
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,366,000
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	114,310,000
	地方債証券合計	32,321,430,000	34,090,642,975
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,831,920
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	414,932,300
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	313,335,000
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,468,000
	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	95,494,000
	第14回道路債券	100,000,000	102,905,000
	第17回道路債券	100,000,000	102,340,000
	第21回道路債券	100,000,000	129,477,000
	第27回道路債券	400,000,000	426,688,000
	第28回道路債券	200,000,000	262,808,000
	第33回道路債券	200,000,000	266,592,000
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,463,000
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,605,000
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,426,000
	第42回道路債券	100,000,000	108,284,000
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,069,000
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	143,710,000
	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	233,884,000
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,073,000
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,142,000

第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,328,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	911,259,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,824,000	
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	131,601,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,046,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,635,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,068,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,646,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,607,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,830,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,796,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,000,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,486,000	
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	116,618,000	
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	101,396,000	
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	304,284,000	
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	202,414,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	619,164,000	
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	305,158,920	
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	635,680,440	
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	203,604,000	
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	150,717,280	
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	101,666,000	
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	270,198,990	
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	203,534,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,699,000	
	422,000,000	430,330,280	

第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	101,806,000	
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	230,954,000	
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	103,969,620	
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	101,948,000	
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	101,871,000	
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	229,662,000	
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	101,810,000	
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	101,635,000	
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	303,441,000	
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	111,852,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,338,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,988,000	
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	100,701,000	
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	94,808,000	
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	107,028,890	
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	317,488,360	
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	206,328,400	
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	100,841,000	
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	201,648,000	
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	100,933,000	
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	121,449,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,880,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,178,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,060,200	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	377,955,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	213,813,600	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,266,000	

第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	393,978,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,073,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	131,980,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	42,485,200	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	130,032,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	234,192,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	194,706,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	234,230,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,404,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	504,665,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,162,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,740,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,550,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,403,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,414,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,035,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,197,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,808,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,711,500	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,546,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,781,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,024,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,274,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,723,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,721,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,210,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,794,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,706,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,117,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,105,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,468,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,645,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	253,053,180	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,832,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,944,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,925,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,321,100	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,176,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,112,240	



第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,422,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,530,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,444,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,822,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,952,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,094,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	108,052,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,946,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	117,144,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,536,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,838,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,147,420	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,946,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,121,400	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,561,900	
第85回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,967,000	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,922,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	212,174,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	170,850,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	93,592,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	201,510,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,697,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	102,789,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,447,800	
第59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	11,454,000	11,719,732	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,860,000	12,167,529	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,126,000	12,477,654	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	167,124,000	167,102,273	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	119,238,000	119,303,580	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,950,000	12,245,762	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,867,000	13,281,960	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	215,790,000	215,332,525	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,295,000	10,351,725	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,480,000	21,788,023	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,732,000	13,134,585	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	235,182,000	234,420,010	

第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	83,833,000	83,808,688
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,379,000	11,620,007
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,305,000	13,779,988
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	272,868,000	272,731,566
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,428,000	11,671,187
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	188,208,000	188,243,759
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,379,000	13,872,149
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,273,000
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,622,000	18,703,990
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,873,000	19,040,821
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,907,000	21,329,156
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,787,000	23,219,277
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,913,000	25,628,757
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,452,000	26,172,198
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,622,000	56,241,341
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,607,000	11,839,256
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,771,000	25,156,849
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,800,000	12,048,154
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,529,000	11,819,876
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,853,000	26,322,309
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,780,000	10,937,388
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,781,000	26,314,200
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,891,000	25,299,374
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,704,000	13,199,201
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,388,000	54,204,576
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,907,000	29,476,210
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,453,000	12,876,526
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,584,000	39,726,663
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,602,000	37,568,654
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,503,000	37,493,298
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,780,000	81,969,230
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,210,000	89,093,871
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,465,000	45,400,061
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,752,000	46,071,293
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,046,000	46,438,578
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,203,000	40,112,385
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,021,000	39,638,793
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,644,000	46,048,784
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	178,161,000
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,217,000	121,150,411

第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,684,000	163,341,503	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,347,000	46,157,244	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,779,000	47,682,490	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,543,000	48,346,541	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,246,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,828,000	153,523,812	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,593,000	52,362,743	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,204,000	109,220,193	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,014,000	60,895,956	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,825,000	64,638,757	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,491,000	64,608,819	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,491,000	200,843,658	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,024,000	134,828,386	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,042,000	65,255,404	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,198,000	70,653,809	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,290,000	74,675,565	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,505,000	80,110,828	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,334,000	79,771,130	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,716,000	80,493,231	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,927,000	81,061,164	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,753,000	81,776,948	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,438,000	83,462,704	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,078,000	84,208,691	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,778,000	83,681,107	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,210,000	84,141,952	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,664,000	84,649,561	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,956,000	170,586,425	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,707,000	84,663,771	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,452,000	172,828,100	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,036,000	86,019,866	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,126,000	171,830,662	

第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,050,000	87,058,506	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,164,000	174,796,936	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,144,000	175,770,504	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	129,993,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,186,000	89,529,954	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,140,000	89,670,110	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,166,000	88,968,310	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,552,000	181,445,732	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,307,000	90,670,034	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,109,000	90,603,698	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,828,000	182,515,309	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,019,000	91,672,088	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,719,000	275,288,958	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,278,000	184,614,537	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,443,000	95,008,713	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,068,000	95,336,091	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,516,000	196,089,634	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,044,000	98,674,422	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,494,000	197,808,544	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,954,000	197,919,074	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,755,000	99,490,724	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,140,000	200,446,349	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,722,000	201,839,052	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,965,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,211,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,936,000	
第60回日本学生支援債券	200,000,000	199,978,000	
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	108,106,000	

	い第823号商工債	200,000,000	200,686,000	
	い第829号商工債	200,000,000	200,394,000	
	い第832号商工債	200,000,000	199,966,000	
	い第833号商工債	100,000,000	99,898,000	
	い第843号商工債	200,000,000	200,292,000	
	第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,124,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,122,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,256,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,146,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,118,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,826,000	
	第236号商工債（3年）	300,000,000	299,964,000	
	第254号商工債（3年）	300,000,000	300,123,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,059,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,676,000	
	第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,642,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,912,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,092,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	501,570,000	
	第73回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,022,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,037,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,237,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,515,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,025,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,860,000	
	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	37,880,796,000	39,412,975,021	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,361,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	299,742,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,281,000	
	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	100,680,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,296,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,285,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,002,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,205,000	

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	399,748,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,920,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,206,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,340,000	
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	199,422,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,966,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,357,000	
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	100,272,000	
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	199,770,000	
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	100,429,000	
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	199,828,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,883,000	
第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,236,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,132,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,271,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,957,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,427,000	
第10回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,304,000	
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	101,895,000	
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	99,850,000	
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	100,793,000	
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	200,970,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
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	101,176,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,757,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,604,000	
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	101,020,000	
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	200,466,000	
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	200,844,000	
第40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	100,118,000	
第42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	100,816,000	

第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,832,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,744,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,716,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,187,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,689,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,062,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	100,031,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,171,000	
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	199,918,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,578,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,999,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,472,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,354,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,921,000	
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	99,459,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,441,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,045,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	100,005,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,141,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,229,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,165,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,494,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,240,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,981,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,282,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,199,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,664,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,696,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,214,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,195,000	
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	100,127,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,129,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,696,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,918,000	
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	100,153,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,039,000	

第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,871,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,794,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,037,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,823,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,905,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	201,208,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,619,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,287,000	
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	100,226,000	
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	118,082,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	112,358,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,182,000	
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	101,390,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,371,000	
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	304,242,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,351,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,330,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,970,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,706,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,170,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,764,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,348,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,237,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,334,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,724,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,945,000	
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	199,846,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,334,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,094,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,225,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,334,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,908,000	
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	200,528,000	
	100,000,000	100,183,000	



第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債			
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,316,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,688,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,696,000	
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	100,381,000	
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	200,298,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,448,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,920,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,250,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,256,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,242,000	
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	101,870,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,294,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,713,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,480,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,372,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,646,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,599,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,144,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,032,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,882,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,323,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,436,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	233,204,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,872,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,779,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,984,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,868,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,924,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,834,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,363,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,086,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,698,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	501,570,000	

第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,495,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,964,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,571,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,220,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,783,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,452,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,919,000	
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	194,954,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,923,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,050,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,728,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,699,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	400,472,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,903,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,308,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,458,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,702,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,648,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,596,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,566,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,269,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,948,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,158,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,655,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,578,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,574,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,026,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,606,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	202,022,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,972,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,709,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,346,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	201,866,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,526,740	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,886,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,151,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,875,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	203,142,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,285,000	

第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,942,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,267,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,206,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	203,198,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,228,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,597,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,896,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,395,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,254,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,999,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,712,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,432,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,764,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,298,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,459,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,465,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,017,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	205,500,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	404,964,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,549,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	304,392,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,768,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,376,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,926,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,202,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,912,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,614,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,484,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,639,000	
第6回S C S K株式会社無担保社債	100,000,000	100,045,000	
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	100,671,000	
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	203,246,000	
社債券合計	28,126,000,000	28,507,269,740	
合計		627,488,689,286	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,794,645,368
コール・ローン	394,000,996
株式	494,972,353,442
投資信託受益証券	303,129,139
投資証券	11,671,469,697
派生商品評価勘定	338,666,684
未収入金	77,356,017
未収配当金	642,692,598
差入委託証拠金	3,183,681,640
流動資産合計	521,377,995,581
資産合計	521,377,995,581
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	876,233
前受金	337,552,089
未払金	70,398,041
未払解約金	180,940,294
未払利息	434
流動負債合計	589,767,091
負債合計	589,767,091
純資産の部	
元本等	
元本	137,902,365,955
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	382,885,862,535
元本等合計	520,788,228,490
純資産合計	520,788,228,490
負債純資産合計	521,377,995,581

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2021年 6月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2021年 6月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2021年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,902,365,955口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.7765円 (1万口当たり純資産額) (37,765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 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 6月10日現在
期首	2020年 6月11日
期首元本額	153,028,332,972円
期中追加設定元本額	18,412,918,009円
期中一部解約元本額	33,538,885,026円
期末元本額	137,902,365,955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)	2,010,796,989円
S B I 資産設計オープン(分配型)	7,005,685円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,474,661,735円
世界経済インデックスファンド	8,399,284,635円
外国株式インデックス・オープン	823,460,255円
D C マイセレクション 2 5	838,931,595円
D C マイセレクション 5 0	4,105,663,092円
D C マイセレクション 7 5	4,536,902,468円
D C 外国株式インデックス・オープン	10,925,292,718円
D C マイセレクション S 2 5	395,835,415円
D C マイセレクション S 5 0	1,910,286,544円
D C マイセレクション S 7 5	1,468,148,544円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	67,803,344円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	177,107,242円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	126,241,436円
D C 世界経済インデックスファンド	9,952,033,346円
外国株式インデックス・オープン(S M A 専用)	1,831,908,637円
マイセレクション 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	6,345,507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)	30,727,646円
バランス 3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	24,960,537円
バランス 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	91,520,868円
バランス 2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	15,025,805円
バランス 5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	48,779,274円
バランス A ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	401,290,201円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	222,132,451円
バランス C ( 5 0 ) V A 1(適格機関投資家専用)	1,595,310,573円
世界バランス V A 1(適格機関投資家専用)	656,620,295円
世界バランス V A 2(適格機関投資家専用)	42,979,362円
バランス D ( 3 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	219,177,268円
バランス E ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	75,931,212円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,357,231,684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)	1,434,047,865円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,078,302,225円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,313,100,388円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,692,604,693円



区分	2021年 6月10日現在
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
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,258,884,741円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,131,391,014円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,054,658,220円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	641,500,861円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30,878,252円
SMT インデックスバランス・オープン	170,876,110円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	725,232,709円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	26,740,756,058円
SMT 世界経済インデックス・オープン	159,796,273円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	523,434,535円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	96,501,684円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,272,010円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	108,521,878円
グローバル経済コア	706,978,386円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,504,223円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,119,790円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	685,358,023円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	74,811,313円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,009,832円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	8,191,692円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	3,518,022円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2,622,775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)	609,744,813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)	874,758,984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)	1,370,692,582円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	787,075,441円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	122,666,220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)	294,802,711円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	284,799,149円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	282,822,494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 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	2,297,500,674
投資信託受益証券	2,845,655
投資証券	528,733,645
合計	2,829,079,974

(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 6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	13,221,145,444	-	13,558,697,533	337,552,089
	合計	13,221,145,444	-	13,558,697,533	337,552,089

(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 6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	135,718,000	-	135,964,512	246,512
	アメリカドル	135,718,000	-	135,964,512	246,512
	売建	178,713,200	-	178,721,350	8,150
	アメリカドル	178,713,200	-	178,721,350	8,150
	合計	314,431,200	-	314,685,862	238,362

(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	25.81	1,496,463.80	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	88.22	1,679,179.48	
	CHEVRON CORP	166,092	107.78	17,901,395.76	
	CONOCOPHILLIPS	117,327	59.68	7,002,075.36	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	29.93	1,706,010.00	
	EOG RESOURCES INC	51,325	85.81	4,404,198.25	
	EXXON MOBIL	365,193	62.65	22,879,341.45	
	HALLIBURTON CO	77,539	24.26	1,881,096.14	
	HESS CORP	24,844	88.88	2,208,134.72	
	KINDER MORGAN INC	179,427	18.83	3,378,610.41	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,189	63.61	3,637,792.29	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	28.35	2,242,655.10	
	ONEOK INC	37,709	54.84	2,067,961.56	
	PHILLIPS 66	38,113	92.45	3,523,546.85	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	167.75	3,011,783.50	
	SCHLUMBERGER	122,666	35.76	4,386,536.16	
	VALERO ENERGY CORP	34,683	81.93	2,841,578.19	
	WILLIAMS COS	104,984	28.13	2,953,199.92	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,118	297.35	5,684,737.30	
	ALBEMARLE CORP	10,180	174.37	1,775,086.60	
	AMCOR PLC	132,975	12.07	1,605,008.25	
	AVERY DENNISON CORP	7,457	218.12	1,626,520.84	
	BALL CORP	27,925	80.90	2,259,132.50	
	CELANESE CORP-SERIES A	9,842	162.28	1,597,159.76	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	55.50	1,058,440.50	
	CORTEVA INC	64,900	45.49	2,952,301.00	
	CROWN HOLDINGS INC	11,212	99.69	1,117,724.28	
	DOW INC	63,659	68.84	4,382,285.56	
	DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	84.17	3,883,519.63	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,641	126.74	1,602,120.34	
	ECOLAB INC	22,189	212.76	4,720,931.64	
	FMC CORP	12,118	118.31	1,433,680.58	
FREEMPORT-MCMORAN INC	125,342	40.70	5,101,419.40		
INT'L PAPER CO	33,803	63.28	2,139,053.84		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	147.09	3,115,954.56		

LINDE PLC	45,090	290.48	13,097,743.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	112.05	2,540,509.65
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	359.10	1,910,771.10
MOSAIC CO/THE	31,911	34.95	1,115,289.45
NEWMONT CORPORATION	68,576	69.99	4,799,634.24
NUCOR CORP	25,565	107.58	2,750,282.70
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	142.99	1,271,181.10
PPG INDUSTRIES INC	20,538	177.11	3,637,485.18
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	91.61	1,138,712.30
SEALED AIR CORP	14,689	57.88	850,199.32
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,917	276.96	6,070,132.32
STEEL DYNAMICS INC	18,273	64.51	1,178,791.23
VULCAN MATERIALS CO	11,347	178.62	2,026,801.14
WESTROCK CO	24,734	56.92	1,407,859.28
3 M COMPANY	50,115	202.74	10,160,315.10
ALLEGION PLC	7,601	138.09	1,049,622.09
AMETEK INC	19,666	135.71	2,668,872.86
BOEING CO	47,686	248.06	11,828,989.16
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	46.19	3,261,152.57
CATERPILLAR	47,231	234.65	11,082,754.15
CUMMINS INC	12,914	256.77	3,315,927.78
DEERE&CO	25,864	349.53	9,040,243.92
DOVER CORP	12,202	150.66	1,838,353.32
EATON CORP	34,431	146.41	5,041,042.71
EMERSON ELECTRIC CO	51,393	97.90	5,031,374.70
FASTENAL CO	48,796	52.61	2,567,157.56
FORTIVE CORP	25,722	71.07	1,828,062.54
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	100.24	1,284,074.40
GENERAC HOLDINGS INC	5,800	343.71	1,993,518.00
GENERAL DYNAMICS CORP	21,212	191.87	4,069,946.44
GENERAL ELECTRIC CO	761,269	13.73	10,452,223.37
GRAINGER (WW) INC	3,846	458.55	1,763,583.30
HEICO CORP	3,640	145.23	528,637.20
HEICO CORP-CLASS A	6,449	134.14	865,068.86
HONEYWELL INTL INC	59,921	227.81	13,650,603.01
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	35.03	1,280,346.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	221.03	778,467.66
IDEX CORP	6,916	221.01	1,528,505.16
ILLINOIS TOOL WORKS	27,403	232.32	6,366,264.96
INGERSOLL-RAND INC	31,562	47.67	1,504,560.54
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	62.75	1,261,275.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	63,375	66.86	4,237,252.50

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	217.51	3,933,885.86
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	338.23	1,035,660.26
LOCKHEED MARTIN CORP	21,652	386.80	8,374,993.60
MASCO CORP	23,467	58.41	1,370,707.47
NORDSON CORP	4,880	222.10	1,083,848.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,571	372.60	5,056,554.60
OTIS WORLDWIDE CORP	35,040	80.75	2,829,480.00
OWENS CORNING	8,642	102.25	883,644.50
PACCAR INC	30,155	92.59	2,792,051.45
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	305.40	3,430,863.60
PENTAIR PLC	14,533	69.20	1,005,683.60
PLUG POWER INC	41,884	32.43	1,358,298.12
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	131,986	88.85	11,726,956.10
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	279.15	2,774,192.70
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,326	450.95	4,205,559.70
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	59.59	824,010.52
SMITH (A.O.) CORP	12,146	68.44	831,272.24
SNAP-ON INC	4,900	244.42	1,197,658.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	206.57	2,833,727.26
SUNRUN INC	13,917	43.29	602,466.93
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	418.77	1,632,784.23
TEXTRON	18,893	69.06	1,304,750.58
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	182.29	3,762,830.18
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	664.00	2,938,200.00
UNITED RENTALS INC	6,103	314.71	1,920,675.13
WABTEC CORP	15,024	81.39	1,222,803.36
XYLEM INC	15,209	118.45	1,801,506.05
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	87.39	993,099.96
CINTAS CORP	8,043	347.88	2,797,998.84
CLARIVATE PLC	27,357	26.39	721,951.23
COPART INC	18,067	122.53	2,213,749.51
COSTAR GROUP INC	3,403	848.31	2,886,798.93
EQUIFAX INC	10,409	228.64	2,379,913.76
IHS MARKIT LTD	32,602	106.74	3,479,937.48
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	141.52	1,701,919.52
LEIDOS HOLDINGS	11,220	104.93	1,177,314.60
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	109.23	2,185,364.61
ROBERT HALF INTL INC	9,566	91.31	873,471.46
ROLLINS INC	21,849	33.05	722,109.45
TRANSUNION	17,091	105.47	1,802,587.77
VERISK ANALYTICS INC	13,390	169.92	2,275,228.80
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	120.29	2,700,991.66

WASTE MANAGEMENT INC	36,263	139.58	5,061,589.54
AMERCO	1,000	561.72	561,720.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	99.00	1,117,908.00
CSX CORP	65,822	97.82	6,438,708.04
DELTA AIR LINES INC	14,609	46.52	679,610.68
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	123.74	1,766,017.28
FEDEX CORP	21,597	293.11	6,330,296.67
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	165.58	1,167,670.16
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	296.07	2,358,197.55
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	47.49	508,143.00
LYFT INC-A	21,288	55.38	1,178,929.44
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,987	273.76	6,019,161.12
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	249.77	1,998,909.31
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	58.42	790,597.86
UBER TECHNOLOGIES INC	103,109	49.14	5,066,776.26
UNION PACIFIC CORP	57,701	221.50	12,780,771.50
UNITED PARCEL SERVICE B	62,170	201.06	12,499,900.20
XPO LOGISTICS INC	8,001	143.89	1,151,263.89
APTIV PLC	23,540	158.33	3,727,088.20
AUTOLIV INC	6,776	103.85	703,687.60
BORGWARNER INC	19,781	53.12	1,050,766.72
FORD MOTOR COMPANY	334,463	15.48	5,177,487.24
GENERAL MOTORS CO	114,044	62.77	7,158,541.88
LEAR CORP	5,287	194.44	1,028,004.28
TESLA INC	66,189	598.78	39,632,649.42
DR HORTON INC	29,632	90.68	2,687,029.76
GARMIN LTD	12,854	142.17	1,827,453.18
HASBRO INC	12,468	95.40	1,189,447.20
LENNAR CORP-CL A	24,928	93.90	2,340,739.20
LULULEMON ATHLETICA INC	10,777	327.22	3,526,449.94
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	198.40	1,004,300.80
NEWELL BRANDS INC	31,461	27.97	879,964.17
NIKE B	109,235	131.84	14,401,542.40
NVR INC	297	4,792.95	1,423,506.15
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	106.97	2,325,099.92
PULTE GROUP INC	24,818	55.84	1,385,837.12
VF CORP	28,638	78.46	2,246,937.48
WHIRLPOOL CORP	5,220	229.90	1,200,078.00
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	144.85	675,725.25
ARAMARK	20,955	37.22	779,945.10
BOOKING HOLDINGS INC	3,556	2,314.06	8,228,797.36
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	110.83	1,946,174.80

CARNIVAL CORPORATION	70,520	30.45	2,147,334.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,328.57	3,187,239.43
DARDEN RESTAURANTS INC	12,063	138.67	1,672,776.21
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	442.71	1,439,250.21
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	54.48	853,919.52
EXPEDIA GROUP INC	11,638	172.80	2,011,046.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	126.45	3,007,992.60
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	55.09	1,617,993.30
MARRIOTT INTL A	24,361	143.82	3,503,599.02
MCDONALD'S CORP	64,866	231.47	15,014,533.02
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	17.29	305,375.98
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	43.54	1,439,606.56
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	92.79	1,787,784.93
STARBUCKS CORP	102,054	111.39	11,367,795.06
VAIL RESORTS INC	3,574	319.94	1,143,465.56
WYNN RESORTS LTD	9,302	126.67	1,178,284.34
YUM BRANDS INC	25,844	117.53	3,037,445.32
ACTIVISION BLIZZARD INC	66,954	96.53	6,463,069.62
ALPHABET INC-CL A	25,977	2,407.94	62,551,057.38
ALPHABET INC-CL C	25,465	2,491.40	63,443,501.00
ALTICE USA INC- A	22,505	34.49	776,197.45
CABLE ONE INC	445	1,772.56	788,789.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,659	676.47	7,886,963.73
COMCAST CORP-CL A	394,334	56.26	22,185,230.84
DISCOVERY INC - A	12,804	30.56	391,290.24
DISCOVERY INC-C	28,190	28.65	807,643.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	40.44	814,138.08
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	145.82	3,637,334.08
FACEBOOK INC-A	207,790	330.25	68,622,647.50
FOX CORP - CLASS A	27,658	37.64	1,041,047.12
FOX CORP- CLASS B	15,092	36.03	543,764.76
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	153.83	1,033,891.43
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	33.52	1,134,115.68
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	155.79	401,782.41
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	159.33	2,153,504.28
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	45.29	846,605.97
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	45.36	783,095.04
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	45.36	289,578.24
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	88.17	1,226,268.36
MATCH GROUP INC	21,851	141.77	3,097,816.27
NETFLIX INC	38,504	485.81	18,705,628.24
NEWS CORP-CLASS A	33,479	26.53	888,197.87

OMNICOM GROUP	18,031	83.53	1,506,129.43
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	66.12	3,026,114.04
ROKU INC	9,741	339.64	3,308,433.24
SEA LTD-ADR	638	263.08	167,845.04
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.85	681,903.80
SNAP INC - A	81,742	61.77	5,049,203.34
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	183.59	1,787,799.42
THE WALT DISNEY CO	156,656	176.04	27,577,722.24
TWITTER INC	70,140	59.71	4,188,059.40
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	42.25	2,052,758.50
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	113.80	625,558.60
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	111.40	1,495,767.80
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	197.03	1,218,827.58
AMAZON.COM	36,986	3,281.15	121,356,613.90
AUTOZONE INC	1,986	1,386.85	2,754,284.10
BEST BUY COMPANY INC	19,870	114.99	2,284,851.30
BURLINGTON STORES INC	5,808	304.99	1,771,381.92
CARMAX INC	13,891	115.00	1,597,465.00
CARVANA CO	5,700	264.51	1,507,707.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	77.77	534,902.06
DOLLAR GENERAL CORP	20,962	204.93	4,295,742.66
DOLLAR TREE INC	20,151	98.87	1,992,329.37
EBAY	59,339	65.96	3,914,000.44
ETSY INC	11,000	167.30	1,840,300.00
GENUINE PARTS CO	12,119	128.39	1,555,958.41
HOME DEPOT	92,922	307.34	28,558,647.48
L BRANDS INC	19,806	65.46	1,296,500.76
LKQ CORP	26,705	49.49	1,321,630.45
LOWES COMPANIES	63,738	190.60	12,148,462.80
MERCADOLIBRE INC	3,877	1,316.66	5,104,690.82
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,067	527.98	3,203,254.66
POOL CORP	3,700	433.62	1,604,394.00
ROSS STORES INC	31,643	120.09	3,800,007.87
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,484	231.94	10,085,678.96
TJX COMPANIES INC	103,121	65.03	6,705,958.63
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	181.04	1,798,089.28
ULTA BEAUTY INC	4,520	332.68	1,503,713.60
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	323.50	1,941,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	38,401	379.96	14,590,843.96
KROGER CO	61,306	38.28	2,346,793.68
SYSCO CORP	43,568	79.46	3,461,913.28
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	53.43	3,382,653.30



WALMART INC	134,198	139.08	18,664,257.84
ALTRIA GROUP INC	161,290	49.90	8,048,371.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	68.11	3,292,369.29
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	1,038.51	772,651.44
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	75.19	1,971,481.80
BUNGE LIMITED	11,604	88.79	1,030,319.16
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.92	728,704.48
COCA-COLA CO	355,696	55.48	19,734,014.08
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	19,221	61.75	1,186,896.75
CONAGRA BRANDS INC	41,157	37.31	1,535,567.67
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,911	236.67	3,528,986.37
GENERAL MILLS INC	53,282	62.12	3,309,877.84
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	172.86	2,166,281.52
HORMEL FOODS CORP	27,157	48.28	1,311,139.96
JM SMUCKER CO	9,145	135.97	1,243,445.65
KELLOGG CO	21,630	64.80	1,401,624.00
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	34.98	2,084,668.08
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	43.04	2,467,827.52
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	82.50	1,066,230.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	88.13	1,858,485.44
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	60.74	1,105,650.22
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	121,364	63.31	7,683,554.84
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	93.24	3,194,215.92
PEPSICO INC	118,953	146.10	17,379,033.30
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,448	96.75	13,104,594.00
TYSON FOODS INC	25,074	77.40	1,940,727.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	84.54	1,779,989.70
CLOROX COMPANY	10,830	175.70	1,902,831.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,441	82.56	5,815,608.96
ESTEE LAUDER CO-CL A	20,159	297.84	6,004,156.56
KIMBERLY-CLARK CORP	28,913	129.30	3,738,450.90
PROCTER & GAMBLE CO	212,538	134.79	28,647,997.02
ABBOTT LABORATORIES	152,754	109.05	16,657,823.70
ABIOMED INC	3,781	293.82	1,110,933.42
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,653	585.50	3,895,331.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	117.40	1,513,990.40
ANTHEM INC	21,058	385.96	8,127,545.68
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	82.35	3,625,376.40
BECTON DICKINSON & CO	25,112	243.35	6,111,005.20
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,665	42.33	5,234,739.45
CARDINAL HEALTH	24,692	58.56	1,445,963.52
CENTENE CORP	51,303	71.66	3,676,372.98

CERNER CORP	27,382	80.03	2,191,381.46
CIGNA CORP	30,245	242.01	7,319,592.45
CVS HEALTH CORP	113,622	84.95	9,652,188.90
DANAHER CORP	55,620	240.70	13,387,734.00
DAVITA INC	5,784	120.44	696,624.96
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	65.69	1,326,149.72
DEXCOM INC	8,405	390.03	3,278,202.15
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,513	97.08	5,195,042.04
HCA HEALTHCARE INC	23,291	208.31	4,851,748.21
HENRY SCHEIN INC	11,747	77.60	911,567.20
HOLOGIC INC	21,687	61.00	1,322,907.00
HUMANA INC	11,040	422.75	4,667,160.00
IDEXX LABORATORIES INC	7,438	566.66	4,214,817.08
INSULET CORP	5,923	272.93	1,616,564.39
INTUITIVE SURGICAL INC	10,199	840.24	8,569,607.76
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	259.19	2,147,389.15
MASIMO CORP	4,835	212.62	1,028,017.70
MCKESSON CORP	13,893	190.55	2,647,311.15
MEDTRONIC PLC	117,112	123.11	14,417,658.32
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	248.35	1,226,849.00
NOVOCURE LTD	7,933	211.89	1,680,923.37
OAK STREET HEALTH INC	7,613	57.91	440,868.83
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	127.50	1,445,212.50
RESMED INC	12,370	211.96	2,621,945.20
STERIS PLC	7,163	195.54	1,400,653.02
STRYKER CORP	29,094	253.13	7,364,564.22
TELADOC HEALTH INC	11,375	150.43	1,711,141.25
TELEFLEX INC	3,934	393.31	1,547,281.54
THE COOPER COS INC	4,134	372.41	1,539,542.94
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,910	401.10	32,854,101.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	159.47	1,155,838.56
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	290.64	3,422,286.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	335.93	2,122,069.81
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,277	158.22	2,891,786.94
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	186.25	1,053,243.75
ABBVIE INC	152,263	114.00	17,357,982.00
AGILENT TECHNOLOGIES	26,029	140.13	3,647,443.77
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,936	179.18	3,392,952.48
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	157.41	1,678,777.65
AMGEN	49,749	239.52	11,915,880.48
AVANTOR INC	47,985	31.87	1,529,281.95
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	581.16	1,076,889.48

BIO-TECHNE CORP	3,245	429.16	1,392,624.20
BIOGEN INC	13,488	406.94	5,488,806.72
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	82.05	1,408,880.55
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	193,007	65.40	12,622,657.80
CATALENT INC	15,232	107.30	1,634,393.60
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	345.91	1,454,205.64
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	33.90	1,222,467.90
EXACT SCIENCES CORP	14,756	119.20	1,758,915.20
GILEAD SCIENCES INC	107,975	68.65	7,412,483.75
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	90.83	1,628,218.58
ILLUMINA INC	12,501	433.94	5,424,683.94
INCYTE CORP	17,504	86.20	1,508,844.80
IQVIA HOLDINGS INC	16,726	239.38	4,003,869.88
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	181.84	903,926.64
JOHNSON & JOHNSON	226,967	165.59	37,583,465.53
LILLY (ELI) & CO	70,198	226.00	15,864,748.00
MERCK & CO	218,163	74.04	16,152,788.52
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,269.09	2,602,903.59
MODERNA INC	27,089	217.44	5,890,232.16
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	98.42	834,011.08
NOVAVAX INC	5,754	209.64	1,206,268.56
PERKINELMER INC	9,372	141.40	1,325,200.80
PFIZER	484,175	39.81	19,275,006.75
PPD INC	11,027	46.50	512,755.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,176	521.85	4,788,495.60
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	45.99	714,408.66
SEAGEN INC	11,471	155.59	1,784,772.89
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	10.73	862,702.73
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,944	448.21	15,214,040.24
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	213.56	4,796,130.48
VIATRIS INC	103,541	15.45	1,599,708.45
WATERS CORP	5,228	328.00	1,714,784.00
ZOETIS INC	40,822	176.69	7,212,839.18
BANK OF AMERICA CORP	670,589	42.32	28,379,326.48
CITIGROUP	181,157	78.14	14,155,607.98
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	48.44	1,745,826.04
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	41.15	2,525,005.15
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	194.65	2,886,075.55
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	14.99	1,912,454.18
JPMORGAN CHASE & CO	263,503	162.94	42,935,178.82
KEY CORP	83,212	22.26	1,852,299.12
M & T BANK CORP	11,721	157.66	1,847,932.86

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,707	190.79	7,003,328.53
REGIONS FINL CORP	81,824	21.90	1,791,945.60
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	594.23	2,610,452.39
TRUIST FINANCIAL CORP	115,723	58.45	6,764,009.35
US BANCORP	122,617	59.25	7,265,057.25
WELLS FARGO & CO	356,388	45.92	16,365,336.96
ALLY FINANCIAL INC	31,445	54.69	1,719,727.05
AMERICAN EXPRESS	59,420	164.09	9,750,227.80
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	260.72	2,655,433.20
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	57.20	866,751.60
BANK NEW YORK CO	71,298	50.62	3,609,104.76
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	118,353	288.58	34,154,308.74
BLACKROCK INC	13,255	870.94	11,544,309.70
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,302	160.60	6,472,501.20
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	43.74	550,905.30
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	114.11	1,012,726.25
CME GROUP INC	31,096	215.51	6,701,498.96
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,121	123.03	3,213,666.63
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	31.02	1,017,921.30
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	321.78	1,012,963.44
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	34.79	906,975.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	145.69	628,798.04
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,769	382.78	11,394,977.82
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,552	110.85	5,381,989.20
INVESCO LTD	35,765	28.70	1,026,455.50
KKR & CO INC	43,643	55.28	2,412,585.04
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	433.62	1,390,619.34
MOODY'S CORP	14,787	338.78	5,009,539.86
MORGAN STANLEY	122,211	92.67	11,325,293.37
MSCI INC	7,235	465.83	3,370,280.05
NASDAQ INC	9,657	169.12	1,633,191.84
NORTHERN TRUST CORP	17,625	118.62	2,090,677.50
PRICE T ROWE GROUP INC	20,087	194.48	3,906,519.76
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	129.22	1,334,067.28
S&P GLOBAL INC	20,689	384.61	7,957,196.29
SCHWAB (CHARLES) CORP	124,071	72.85	9,038,572.35
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	63.18	774,649.98
STATE STREET CORP	29,894	84.57	2,528,135.58
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	50.07	2,478,915.63
THE BLACKSTONE GROUP INC	58,748	94.20	5,534,061.60
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	83.22	754,056.42
VOYA FINANCIAL INC	10,050	64.32	646,416.00

AFLAC	58,037	56.59	3,284,313.83
ALLEGHANY CORP	1,276	701.51	895,126.76
ALLSTATE CORP	26,425	133.03	3,515,317.75
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	124.01	783,619.19
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	52.16	3,923,840.32
AON PLC	19,359	245.75	4,757,474.25
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	39.06	1,329,250.86
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	144.39	2,362,076.01
ASSURANT INC	4,726	162.76	769,203.76
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	62.53	638,243.71
BROWN & BROWN INC	19,873	51.72	1,027,831.56
CHUBB LTD	38,652	167.30	6,466,479.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	121.14	1,549,501.74
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	190.31	412,211.46
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	257.65	847,153.20
FNF GROUP	24,961	47.35	1,181,903.35
GLOBE LIFE INC	8,106	104.82	849,670.92
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	66.00	2,004,486.00
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	68.28	1,117,333.92
LOEWS CORP	18,851	56.45	1,064,138.95
MARKEL CORP	1,156	1,197.26	1,384,032.56
MARSH & MCLENNAN COS	44,622	137.42	6,131,955.24
METLIFE INC	64,294	64.68	4,158,535.92
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	65.08	1,501,525.76
PROGRESSIVE CORP	50,582	94.82	4,796,185.24
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,851	106.09	3,697,342.59
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	124.85	830,502.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	149.81	728,675.84
TRAVELERS COS INC/THE	22,437	154.74	3,471,901.38
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	254.51	2,804,954.71
WR BERKLEY CORP	11,715	75.45	883,896.75
CBRE GROUP INC-A	30,111	89.04	2,681,083.44
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.89	482,643.00
WEYERHAEUSER CO	63,665	36.03	2,293,849.95
ACCENTURE PLC-CL A	55,165	282.11	15,562,598.15
ADOBE INC	41,289	514.68	21,250,622.52
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	117.79	1,610,542.67
ANSYS INC	7,474	326.85	2,442,876.90
AUTODESK INC	18,964	275.50	5,224,582.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,764	198.19	7,286,257.16
AVALARA INC	7,698	130.32	1,003,203.36
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	62.71	877,689.16

BLACK KNIGHT INC	14,413	73.26	1,055,896.38
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	159.07	1,549,659.94
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,740	125.19	3,097,200.60
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	86.21	1,060,038.16
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	119.70	1,255,174.20
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	118.07	1,233,123.08
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	90.13	1,600,889.06
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	71.25	3,277,998.75
COUPA SOFTWARE INC	6,059	217.36	1,316,984.24
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,694	213.95	3,357,731.30
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	132.59	411,029.00
DATADOG INC - CLASS A	15,807	91.72	1,449,818.04
DOCUSIGN INC	15,540	237.75	3,694,635.00
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	29.07	838,524.15
DYNATRACE INC	17,890	53.23	952,284.70
EPAM SYSTEMS INC	4,753	492.98	2,343,133.94
FAIR ISAAC CORP	2,615	491.19	1,284,461.85
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	53,834	145.13	7,812,928.42
FISERV INC	51,693	111.11	5,743,609.23
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,154	271.23	1,940,379.42
FORTINET INC	12,295	225.52	2,772,768.40
GARTNER INC	7,500	230.29	1,727,175.00
GLOBAL PAYMENTS INC	25,292	191.95	4,854,799.40
GODADDY INC - CLASS A	15,914	81.14	1,291,261.96
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	106.56	844,274.88
HUBSPOT INC	4,000	497.35	1,989,400.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,449	150.67	11,669,240.83
INTUIT INC	23,568	468.33	11,037,601.44
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	159.72	1,004,798.52
MASTERCARD INC-CLASS A	76,521	363.33	27,802,374.93
MICROSOFT CORP	619,180	253.59	157,017,856.20
MONGODB INC	4,623	330.30	1,526,976.90
NORTONLIFELOCK INC	50,376	28.60	1,440,753.60
OKTA INC	10,230	217.16	2,221,546.80
ORACLE CORP	164,854	84.52	13,933,460.08
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	43,290	24.17	1,046,319.30
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	352.39	2,928,713.29
PAYCHEX INC	27,703	103.58	2,869,476.74
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	327.68	1,387,724.80
PAYPAL HOLDINGS INC	95,999	263.60	25,305,336.40
PTC INC	9,984	134.74	1,345,244.16
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	261.27	1,670,299.11

SALESFORCE.COM INC	79,266	236.09	18,713,909.94
SERVICENOW INC	16,939	464.71	7,871,722.69
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	41,035	44.02	1,806,360.70
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	247.01	484,139.60
SPLUNK INC	14,752	116.07	1,712,264.64
SQUARE INC - A	33,292	210.21	6,998,311.32
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	73.02	1,411,841.70
SYNOPSYS INC	13,492	256.06	3,454,761.52
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,578	585.30	2,094,203.40
TWILIO INC - A	13,692	314.61	4,307,640.12
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	416.31	1,545,759.03
UNITY SOFTWARE INC	4,329	98.66	427,099.14
VERISIGN INC	8,760	217.81	1,908,015.60
VISA INC-CLASS A SHARES	146,419	232.31	34,014,597.89
VMWARE INC-CLASS A	7,867	162.00	1,274,454.00
WESTERN UNION CO	38,757	25.17	975,513.69
WIX.COM LTD	5,010	266.04	1,332,860.40
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	225.46	3,495,757.30
ZENDESK INC	10,500	136.50	1,433,250.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	333.63	5,853,538.35
ZSCALER INC	6,234	195.99	1,221,801.66
AMPHENOL CORPORATION	51,451	68.14	3,505,871.14
APPLE INC	1,450,831	127.13	184,444,145.03
ARISTA NETWORKS INC	5,179	359.73	1,863,041.67
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	121.11	738,771.00
CDW CORP/DE	11,982	165.81	1,986,735.42
CISCO SYSTEMS	364,089	54.02	19,668,087.78
COGNEX CORP	16,230	78.95	1,281,358.50
CORNING	64,989	42.76	2,778,929.64
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	103.96	2,238,258.80
F5 NETWORKS INC	5,350	187.74	1,004,409.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	15.65	1,708,181.85
HP INC	106,353	30.05	3,195,907.65
IPG PHOTONICS CORP	3,207	203.20	651,662.40
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	28.48	891,537.92
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	146.97	2,352,107.88
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,918	209.12	3,119,652.16
NETAPP INC	20,586	82.01	1,688,257.86
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	99.33	1,781,980.20
TE CONNECTIVITY LTD	29,387	135.69	3,987,522.03
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	78.16	1,655,116.16
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	74.86	1,930,639.40

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	505.35	2,330,674.20
AT&T INC	614,997	29.01	17,841,062.97
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	27.62	428,551.92
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	27.64	930,915.20
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	15.28	1,316,081.68
T-MOBILE US INC	53,388	147.27	7,862,450.76
VERIZON COMMUNICATIONS	356,926	57.05	20,362,628.30
AES CORP	61,761	25.20	1,556,377.20
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	58.30	1,211,357.40
AMEREN CORPORATION	20,898	85.36	1,783,853.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	44,128	84.45	3,726,609.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	157.60	2,437,126.40
ATMOS ENERGY CORP	11,419	101.15	1,155,031.85
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.77	1,241,134.74
CMS ENERGY CORP	26,742	59.93	1,602,648.06
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	76.88	2,209,915.60
DOMINION ENERGY INC	69,073	76.50	5,284,084.50
DTE ENERGY COMPANY	16,240	138.99	2,257,197.60
DUKE ENERGY CORP	66,012	101.39	6,692,956.68
EDISON INTL	32,117	56.89	1,827,136.13
ENERGY CORP	16,926	107.62	1,821,576.12
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	47.51	989,823.34
EVERGY INC	21,330	63.36	1,351,468.80
EVERSOURCE ENERGY	29,303	82.56	2,419,255.68
EXELON CORP	86,723	46.36	4,020,478.28
FIRSTENERGY CORP	45,787	38.49	1,762,341.63
NEXTERA ENERGY INC	170,459	72.45	12,349,754.55
NISOURCE INC	35,781	25.62	916,709.22
NRG ENERGY INC	23,078	36.67	846,270.26
PG&E CORP	135,327	10.28	1,391,161.56
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	87.16	938,887.52
PPL CORPORATION	69,904	28.99	2,026,516.96
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	61.13	2,644,361.54
SEMPRA ENERGY	27,056	139.44	3,772,688.64
SOUTHERN CO	91,389	63.63	5,815,082.07
UGI CORP	18,019	47.86	862,389.34
VISTRA CORP	37,797	18.28	690,929.16
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	92.91	2,491,939.11
XCEL ENERGY INC	46,423	69.35	3,219,435.05
ADVANCED MICRO DEVICES	104,401	79.96	8,347,903.96
ANALOG DEVICES	31,938	166.37	5,313,525.06
APPLIED MATERIALS	79,412	134.65	10,692,825.80



	BROADCOM INC	35,233	463.93	16,345,645.69
	ENPHASE ENERGY INC	11,000	136.97	1,506,670.00
	INTEL CORP	350,418	57.00	19,973,826.00
	KLA CORP	13,649	314.16	4,287,969.84
	LAM RESEARCH CORP	12,499	634.09	7,925,490.91
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,440	50.35	3,546,654.00
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,641	102.98	2,331,570.18
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	151.81	3,401,151.24
	MICRON TECHNOLOGY	96,673	78.66	7,604,298.18
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,953	340.51	1,346,036.03
	NVIDIA CORP	53,433	694.33	37,100,134.89
	NXP SEMICONDUCTORS NV	24,180	197.38	4,772,648.40
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	37.24	1,340,491.04
	QORVO INC	9,678	181.55	1,757,040.90
	QUALCOMM	98,431	132.89	13,080,495.59
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	168.53	2,419,922.27
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	235.24	1,082,104.00
	TERADYNE INC	14,398	124.71	1,795,574.58
	TEXAS INSTRUMENTS	79,929	186.45	14,902,762.05
	XILINX INC	20,982	125.94	2,642,473.08
	アメリカドル 小計	27,376,286		3,216,003,598.26 (352,634,794,549)
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	25.87	695,385.60
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	44.83	4,607,896.38
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	12.01	1,160,958.66
	ENBRIDGE	173,165	48.19	8,344,821.35
	IMPERIAL OIL	24,763	41.25	1,021,473.75
	INTER PIPELINE LTD	35,455	20.20	716,191.00
	KEYERA CORP	18,607	34.62	644,174.34
	PARKLAND CORP	14,075	41.40	582,705.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	39.17	1,788,737.22
	SUNCOR ENERGY	132,181	30.32	4,007,727.92
	TC ENERGY CORP	82,366	64.47	5,310,136.02
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	85.67	1,738,501.31
	B2GOLD CORP	90,243	5.91	533,336.13
	BARRICK GOLD CORP	153,589	27.89	4,283,597.21
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	68.34	897,919.26
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	28.55	1,570,250.00
	FRANCO-NEVADA CORP	16,953	185.89	3,151,393.17
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	8.70	451,068.90
	KINROSS GOLD CORP	108,451	9.42	1,021,608.42
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	51.90	1,215,913.20

LUNDIN MINING CORP	62,243	12.85	799,822.55
NUTRIEN LTD	48,966	78.87	3,861,948.42
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	38.23	703,852.53
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	28.35	1,149,904.35
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	89.11	695,058.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	57.36	2,267,326.08
YAMANA GOLD INC	81,672	6.14	501,466.08
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	21.95	432,941.80
CAE INC	25,999	38.25	994,461.75
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	107.24	826,284.20
WSP GLOBAL INC	10,656	136.60	1,455,609.60
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	39.03	527,100.15
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	69.90	716,125.50
THOMSON REUTERS CORP	15,013	117.99	1,771,383.87
AIR CANADA	13,805	28.73	396,617.65
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	133.14	8,104,231.80
CP RAILWAY LIMITED	57,581	97.43	5,610,116.83
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	119.40	2,779,870.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	43.49	742,765.71
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	82.05	1,893,139.65
QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.36	491,872.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.34	1,287,235.48
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	202.77	1,096,782.93
DOLLARAMA INC	26,700	53.34	1,424,178.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	44.81	3,322,795.93
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	41.42	631,779.26
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	75.46	974,414.98
METRO INC	18,840	58.49	1,101,951.60
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	117.91	811,574.53
SAPUTO INC	24,489	36.49	893,603.61
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	37.85	1,052,230.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	31.13	653,387.57
BANK MONTREAL	55,894	127.15	7,106,922.10
BANK NOVA SCOTIA	104,760	80.97	8,482,417.20
CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	144.40	5,601,276.00
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	91.91	2,508,131.99
ROYAL BANK OF CANADA	122,804	124.92	15,340,675.68
TORONTO-DOMINION BANK	156,322	87.37	13,657,853.14
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,862	60.02	6,653,937.24
IGM FINANCIAL INC	7,685	44.45	341,598.25
ONEX CORP	6,603	86.40	570,499.20
TMX GROUP LTD	4,685	130.77	612,657.45

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	562.78	1,200,409.74
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.67	872,305.96
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	70.14	708,343.86
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	167.58	2,185,745.94
	MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	25.00	4,076,400.00
	POWER CORP OF CANADA	51,551	39.68	2,045,543.68
	SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	64.55	3,272,814.10
	FIRSTSERVICE CORP	3,690	205.91	759,807.90
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	18.30	721,020.00
	CGI INC - CL A	18,428	108.71	2,003,307.88
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	1,772.76	2,944,554.36
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	8,296	85.74	711,299.04
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	83.00	356,983.00
	OPEN TEXT CORP	24,643	59.59	1,468,476.37
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,710	1,472.02	14,293,314.20
	BCE INC	6,203	61.26	379,995.78
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	62.47	1,910,582.48
	TELUS CORP	32,908	27.49	904,640.92
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.16	992,832.88
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	24.90	607,435.50
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	45.16	236,683.56
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	50.99	575,932.05
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	35.63	367,844.12
	EMERA INC	23,704	57.03	1,351,839.12
	FORTIS INC	42,633	55.97	2,386,169.01
	HYDRO ONE LTD	32,299	30.45	983,504.55
	NORTHLAND POWER INC	17,854	41.00	732,014.00
	カナダドル 小計	3,516,775		203,641,396.30 (18,431,582,779)
ユーロ	ENI	218,529	10.44	2,282,316.87
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	9.62	473,639.83
	NESTE OIL OYJ	37,233	55.44	2,064,197.52
	OMV AG	12,549	50.32	631,465.68
	REPSOL SA	127,332	11.25	1,433,248.99
	TENARIS SA	40,648	9.53	387,619.32
	TOTALENERGIES SE	217,070	40.01	8,686,056.05
	VOPAK	6,360	39.35	250,266.00
	AIR LIQUIDE	40,492	141.98	5,749,054.16
	AKZO NOBEL	15,301	105.45	1,613,490.45
	ARCELORMITTAL	61,651	26.47	1,631,901.97
	ARKEMA	5,949	107.60	640,112.40
	BASF SE	78,752	67.45	5,311,822.40

COVESTRO AG	17,254	54.68	943,448.72
CRH PLC	64,773	42.71	2,766,454.83
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	28.76	568,125.04
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	41.30	237,970.60
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	74.00	965,034.00
KONINKLIJKE DSM NV	14,947	152.30	2,276,428.10
LANXESS	7,293	61.52	448,665.36
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	23,039	43.60	1,004,500.40
SOLVAY SA	6,906	112.45	776,579.70
STORA ENSO OYJ R	54,792	14.68	804,620.52
SYMRISE AG	11,456	110.90	1,270,470.40
UMICORE	17,605	49.58	872,855.90
UPM KYMMENE OYJ	45,603	31.89	1,454,279.67
VOESTALPINE AG	7,152	35.30	252,465.60
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,693	25.28	497,839.04
AIRBUS SE	50,151	110.60	5,546,700.60
ALSTOM	24,388	45.62	1,112,580.56
BOUYGUES ORD	21,446	33.95	728,091.70
BRENTAG SE	12,514	76.76	960,574.64
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	14.82	1,378,645.32
DASSAULT AVIATION SA	213	1,019.00	217,047.00
EIFFAGE	7,964	90.86	723,609.04
FERROVIAL SA	41,438	25.25	1,046,309.50
GEA GROUP AG	13,382	33.98	454,720.36
KINGSPAN GROUP PLC	14,482	78.86	1,142,050.52
KION GROUP AG	5,887	90.26	531,360.62
KNORR-BREMSE AG	6,822	99.94	681,790.68
KONE OYJ-B	29,051	66.62	1,935,377.62
LEGRAND SA	21,768	88.22	1,920,372.96
MTU AERO ENGINES AG	4,753	209.90	997,654.70
PRYSMIAN SPA	21,155	29.78	629,995.90
RATIONAL AG	483	714.60	345,151.80
SAFRAN SA	28,410	124.66	3,541,590.60
SAINT-GOBAIN	43,973	56.96	2,504,702.08
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,506	131.76	6,127,630.56
SIEMENS	66,090	136.00	8,988,240.00
SIEMENS ENERGY AG	36,181	25.33	916,464.73
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	25.29	567,381.15
THALES SA	9,665	86.18	832,929.70
VINCI S.A.	45,934	95.64	4,393,127.76
WARTSILA OYJ	41,917	12.14	509,081.96
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.29	659,169.17

RANDSTAD NV	11,218	64.08	718,849.44
TELEPERFORMANCE	4,734	314.50	1,488,843.00
WOLTERS KLUWER	22,949	80.52	1,847,853.48
ADP	2,382	122.70	292,271.40
AENA SME SA	6,542	144.95	948,262.90
ATLANTIA SPA	46,597	15.78	735,533.64
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	10.89	253,478.62
DEUTSCHE POST AG-REG	85,364	56.67	4,837,577.88
GETLINK	44,101	12.73	561,405.73
INPOST SA	12,480	15.78	197,034.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	94.60	2,713,506.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	80.30	400,777.30
CONTINENTAL AG	9,928	129.38	1,284,484.64
DAIMLER AG	73,367	78.38	5,750,505.46
FAURECIA	10,948	44.61	488,390.28
FERRARI NV	10,170	174.80	1,777,716.00
MICHELIN	13,839	130.50	1,805,989.50
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	97.18	1,363,241.04
RENAULT SA	17,362	34.61	600,985.63
STELLANTIS NV	170,174	17.23	2,932,438.36
VALEO SA	21,538	27.70	596,602.60
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,304	231.00	3,766,224.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	301.40	749,280.40
ADIDAS AG	16,242	293.50	4,767,027.00
ESSILORLUXOTTICA	25,177	146.40	3,685,912.80
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,193.00	3,258,083.00
KERING	6,473	744.60	4,819,795.80
LVMH	24,043	662.50	15,928,487.50
MONCLER SPA	18,219	57.60	1,049,414.40
PUMA SE	9,220	92.70	854,694.00
SEB SA	2,282	153.20	349,602.40
ACCOR	14,436	35.37	510,601.32
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	160.70	2,333,042.60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	48.16	390,481.28
SODEXO	8,135	81.96	666,744.60
BOLLORE	83,646	4.45	372,893.86
PUBLICIS GROUPE	17,077	55.96	955,628.92
SCOUT24 AG	7,492	66.64	499,266.88
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	58.14	411,107.94
VIVENDI	61,243	29.00	1,776,047.00
DELIVERY HERO SE	13,414	110.55	1,482,917.70
HELLOFRESH SE	13,805	83.76	1,156,306.80

INDITEX	95,060	31.60	3,003,896.00
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	77.55	881,898.60
PROSUS	43,038	84.81	3,650,052.78
ZALANDO SE	13,985	93.80	1,311,793.00
CARREFOUR	52,544	17.15	901,129.60
COLRUYT SA	5,424	52.02	282,156.48
JERONIMO MARTINS	24,901	15.86	394,929.86
KESKO OYJ-B SHS	25,583	29.91	765,187.53
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	24.52	2,143,485.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	64.74	4,129,635.12
DANONE (GROUPE)	54,643	58.81	3,213,554.83
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.13	546,472.39
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	83.70	895,673.70
HEINEKEN NV	22,407	98.70	2,211,570.90
JDE PEET'S BV	7,000	31.78	222,460.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	108.45	1,415,272.50
PERNOD-RICARD	18,224	180.80	3,294,899.20
REMY COINTREAU	2,382	166.70	397,079.40
BEIERSDORF AG	9,190	100.50	923,595.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	80.20	704,156.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	93.08	1,343,982.12
LOREAL	21,631	382.00	8,263,042.00
AMPLIFON SPA	11,650	39.43	459,359.50
BIOMERIEUX	4,175	91.42	381,678.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	152.55	523,246.50
DIASORIN SPA	2,070	144.85	299,839.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	68.28	1,192,988.16
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	45.23	1,523,921.91
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	46.47	3,588,567.12
ORPEA	4,336	106.15	460,266.40
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	409.70	911,172.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	47.43	1,164,216.78
ARGENX SE	4,178	236.40	987,679.20
BAYER	83,832	53.01	4,443,934.32
EUROFINS SCIENTIFIC	12,420	84.86	1,053,961.20
GRIFOLS SA	27,685	22.10	611,838.50
IPSEN	3,532	90.60	319,999.20
MERCK KGAA	10,555	154.55	1,631,275.25
ORION OYJ-CLASS B	9,854	37.57	370,214.78
QIAGEN N.V.	21,801	38.62	841,954.62
RECORDATI SPA	9,859	47.80	471,260.20
SANOFI	97,536	86.50	8,436,864.00

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	365.30	883,660.70
UCB (GROUPE)	11,875	79.94	949,287.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.75	429,310.43
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	5.26	3,037,599.63
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.38	4,971,378.44
BNP PARIBAS	97,090	56.23	5,459,370.70
CAIXABANK	380,168	2.77	1,056,106.70
COMMERZBANK AG	94,388	6.62	624,848.56
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	12.10	1,300,517.22
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	33.90	810,379.50
FINECOBANK SPA	53,120	13.94	740,492.80
ING GROEP NV-CVA	343,429	11.03	3,788,708.72
INTESA SANPAOLO	1,441,455	2.45	3,536,609.84
KBC GROEP NV	21,052	67.40	1,418,904.80
MEDIOBANCA	53,990	9.96	538,064.34
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.72	258,792.80
SOCIETE GENERALE	67,846	26.17	1,775,869.05
UNICREDIT SPA	189,030	10.76	2,035,096.98
AMUNDI SA	6,226	74.10	461,346.60
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	12.01	2,130,346.73
DEUTSCHE BOERSE	16,510	133.35	2,201,608.50
EURAZEO SA	3,357	73.05	245,228.85
EXOR NV	10,345	70.60	730,357.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,615	93.88	996,536.20
NATIXIS	89,751	4.00	359,004.00
SOFINA	1,238	355.80	440,480.40
WENDEL	2,023	115.00	232,645.00
AEGON	166,267	3.73	620,674.71
AGEAS	16,065	48.98	786,863.70
ALLIANZ SE-REG	35,536	217.60	7,732,633.60
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	17.18	1,676,201.06
AXA SA	166,887	22.46	3,748,282.02
CNP ASSURANCES	16,287	14.56	237,138.72
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	141.45	818,854.05
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,376	231.30	2,862,568.80
NN GROUP NV	22,611	40.86	923,885.46
POSTE ITALIANE SPA	46,035	12.08	556,102.80
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	38.45	1,656,233.75
SCOR SE	13,354	25.95	346,536.30
AROUNDTOWN SA	94,068	7.10	668,635.34
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	51.20	1,438,310.40
LEG IMMOBILIEN SE	6,992	121.20	847,430.40

VONOVIA SE	45,080	53.78	2,424,402.40
ADYEN NV	1,666	1,924.40	3,206,050.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	64.54	2,523,126.76
ATOS SE	9,750	53.20	518,700.00
BECHTLE AG	2,553	156.30	399,033.90
CAPGEMINI SA	13,914	150.30	2,091,274.20
DASSAULT SYSTEMES SA	11,425	189.10	2,160,467.50
EDENRED	22,756	47.22	1,074,538.32
NEMETSCHEK SE	5,455	60.12	327,954.60
NEXI SPA	41,348	17.41	720,075.42
SAP SE	90,249	115.06	10,384,049.94
TEAMVIEWER AG	14,174	30.79	436,417.46
WORLDLINE SA	20,332	76.78	1,561,090.96
NOKIA OYJ	450,608	4.57	2,062,432.81
CELLNEX TELECOM SA	41,435	50.68	2,099,925.80
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	17.38	4,955,601.12
ELISA A	13,387	50.02	669,617.74
ILIAD SA	1,253	134.30	168,277.90
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.46	287,590.50
KPN (KON.)	282,927	2.63	746,361.42
ORANGE	171,535	10.58	1,816,212.58
PROXIMUS	13,141	17.32	227,602.12
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.45	387,058.60
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.49	233,192.91
TELEFONICA	434,645	3.96	1,724,236.71
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.24	221,516.46
TELEFONICA SA-RTS	434,645	0.20	86,929.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	33.85	322,015.05
E.ON SE	185,377	10.10	1,872,307.70
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	18.97	407,210.02
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.96	472,868.76
ELIA GROUP SA/NV	2,925	90.40	264,420.00
ENAGAS	25,299	19.54	494,342.46
ENDESA	25,972	21.71	563,852.12
ENEL	692,930	8.01	5,552,448.09
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.52	1,021,983.83
ENGIE	158,224	12.29	1,944,889.40
FORTUM OYJ	41,901	23.76	995,567.76
IBERDROLA SA	498,312	10.66	5,314,497.48
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	21.78	507,691.80
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	16.90	669,780.80
RWE STAMM	55,390	30.88	1,710,443.20



	SNAM SPA	189,497	4.98	944,642.54
	SUEZ	32,549	20.08	653,583.92
	TERNA SPA	130,230	6.42	837,118.44
	UNIPER SE	7,335	29.81	218,656.35
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	25.81	1,120,850.87
	VERBUND AG	6,430	74.95	481,928.50
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	266.90	1,125,517.30
	ASML HOLDING NV	36,125	562.40	20,316,700.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	112,361	33.00	3,707,913.00
	STMICROELECTRONICS	55,076	30.56	1,683,397.94
	ユーロ 小計	16,734,971		410,688,016.90 (54,822,743,375)
イギリスポンド	BP PLC	1,757,685	3.24	5,708,082.03
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	354,259	14.02	4,967,419.69
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,099	13.33	4,266,919.67
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	31.02	3,380,049.65
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	15.28	548,058.96
	BHP GROUP PLC	182,400	21.31	3,886,944.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,112	69.52	911,546.24
	EVRAZ PLC	43,000	6.24	268,664.00
	GLENCORE PLC	875,677	3.18	2,790,344.76
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	31.45	529,869.60
	MONDI PLC	36,710	19.04	698,958.40
	RIO TINTO PLC REG	96,096	60.68	5,831,105.28
	ASHTED GROUP PLC	37,034	51.36	1,902,066.24
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.34	1,389,475.56
	BUNZL PLC	24,880	22.82	567,761.60
	DCC PLC	9,127	60.86	555,469.22
	FERGUSON PLC	19,417	97.26	1,888,497.42
	MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.64	750,004.92
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786,119	1.12	884,855.54
	SMITHS GROUP PLC	37,146	15.88	589,878.48
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	130.25	718,198.50
	EXPERIAN PLC	79,162	27.03	2,139,748.86
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	53.54	743,670.60
	RELX PLC	166,847	18.86	3,146,734.42
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	4.76	669,949.12
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.41	715,028.22
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	22.37	666,089.12
	PERSIMMON PLC	25,686	31.13	799,605.18
	TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.67	595,121.64
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	46.03	544,488.87

COMPASS GROUP PLC	155,632	16.46	2,561,702.72
ENTAIN PLC	49,630	17.72	879,691.75
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	52.10	835,736.10
WHITBREAD PLC	17,434	33.31	580,726.54
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.77	562,320.73
INFORMA PLC	141,175	5.64	797,356.40
PEARSON	66,305	8.52	565,051.21
WPP PLC	113,065	10.04	1,135,737.92
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	9.21	381,302.57
KINGFISHER PLC	198,587	3.39	674,600.03
NEXT PLC	11,468	81.74	937,394.32
OCADO GROUP PLC	44,612	19.15	854,319.80
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.76	369,951.48
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.62	388,786.03
TESCO PLC	666,000	2.26	1,508,823.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	23.54	788,354.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO	188,273	28.11	5,292,354.03
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.39	473,964.40
DIAGEO	200,801	34.60	6,947,714.60
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	16.20	1,312,378.13
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	64.55	3,907,469.70
UNILEVER PLC	227,095	42.76	9,710,582.20
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	15.06	1,033,040.70
ASTRAZENECA	113,182	81.30	9,201,696.60
GLAXOSMITHKLINE	430,042	13.80	5,936,299.76
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	24.46	402,464.84
BARCLAYS	1,516,252	1.80	2,736,834.86
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,754,485	4.38	7,686,398.78
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,190,268	0.48	2,985,875.76
NATWEST GROUP PLC	369,149	2.04	753,433.10
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.97	1,056,493.95
3I GROUP PLC	88,121	12.08	1,064,501.68
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	16.43	543,653.36
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	74.96	2,068,296.32
M&G PLC	229,107	2.41	553,751.61
SCHRODERS PLC	11,794	35.58	419,630.52
ST JAMES'S PLACE PLC	50,535	14.26	720,629.10
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	210,980	2.77	584,414.60
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	30.39	493,989.45
AVIVA PIC	332,730	4.14	1,377,502.20
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.92	332,957.52
LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.74	1,410,351.39

	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	7.15	364,963.15	
	PRUDENTIAL	225,330	14.51	3,270,664.95	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	34.89	380,894.13	
	SAGE GROUP PLC	95,210	6.52	621,150.04	
	HALMA PLC	31,069	26.80	832,649.20	
	BT GROUP PLC	769,485	1.83	1,409,311.77	
	VODAFONE GROUP PLC	2,359,596	1.28	3,025,945.91	
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.13	2,800,718.80	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	24.69	554,734.92	
	SSE PLC	92,294	15.46	1,426,865.24	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.05	588,729.00	
	イギリスポンド 小計	25,504,232		151,159,767.26 (23,391,973,983)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.50	339,347.99	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	848.00	486,752.00	
	GIVAUDAN-REG	795	4,169.00	3,314,355.00	
	HOLCIM LTD	45,387	55.52	2,519,886.24	
	SIKA AG-BR	12,505	291.80	3,648,959.00	
	ABB LTD	149,042	31.15	4,642,658.30	
	GEBERIT AG-REG	2,964	667.40	1,978,173.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	261.80	552,921.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	270.40	1,018,867.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	61.70	899,154.10	
	SGS SA	506	2,806.00	1,419,836.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	318.00	1,455,486.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	45,940	116.25	5,340,525.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	330.80	821,376.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	63.95	251,835.10	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,074.00	580,720.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	92,500.00	925,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	8,770.00	719,140.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	248,795	113.92	28,342,726.40	
	ALCON INC	42,603	62.42	2,659,279.26	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	325.50	1,522,363.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,388.50	1,185,779.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,536	645.00	4,215,720.00	
	NOVARTIS	191,990	82.25	15,791,177.50	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	361.20	1,010,998.80	
	ROCHE HOLDING GENUSS	60,854	340.15	20,699,488.10	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	136.85	613,909.10	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	82.20	234,598.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.66	2,061,746.75	

	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	60.54	1,144,024.38
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,941	1,372.50	2,664,022.50
	UBS GROUP AG	315,017	14.60	4,600,823.28
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	146.30	638,160.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	456.20	1,299,713.80
	SWISS RE LTD	24,674	83.88	2,069,655.12
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	370.90	4,725,266.00
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	94.25	702,916.50
	TEMENOS AG - REG	6,511	142.60	928,468.60
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	124.65	1,830,609.90
	SWISSCOM	2,187	522.60	1,142,926.20
	スイスフラン 小計	1,498,047		130,999,367.62 (16,027,772,628)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	298.10	5,133,878.20
	BOLIDEN AB	23,903	347.90	8,315,853.70
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	134.80	7,679,151.60
	ALFA LAVAL AB	27,268	302.50	8,248,570.00
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	259.60	22,467,860.80
	ATLAS COPCO A	58,390	509.80	29,767,222.00
	ATLAS COPCO B	31,902	436.30	13,918,842.60
	EPIROC AB-A	58,039	182.70	10,603,725.30
	EPIROC AB-A RED SHS	58,039	3.00	174,117.00
	EPIROC AB-B	37,972	161.05	6,115,390.60
	EPIROC AB-B RED SHS	37,972	3.00	113,916.00
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	275.50	3,857,551.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	88.40	9,513,961.60
	SANDVIK AB	96,684	227.70	22,014,946.80
	SKANSKA B	32,007	243.10	7,780,901.70
	SKF AB-B	35,405	223.60	7,916,558.00
	VOLVO AB-A SHS	13,514	233.00	3,148,762.00
	VOLVO B	123,279	226.10	27,873,381.90
	SECURITAS B	29,533	132.70	3,919,029.10
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	235.10	5,000,341.90
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	117.60	4,552,531.20
	EVOLUTION AB	14,096	1,594.00	22,469,024.00
	EMBRACER GROUP AB	18,755	249.00	4,669,995.00
	HENNES & MAURITZ B	65,999	210.55	13,896,089.45
	ICA GRUPPEN AB	9,493	406.10	3,855,107.30
	SWEDISH MATCH AB	127,270	78.64	10,008,512.80
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	291.20	14,406,828.80
	NORDEA BANK ABP	280,957	91.66	25,752,518.62
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	108.15	14,975,530.50

	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	92.60	12,145,971.60	
	SWEDBANK AB-A	72,526	151.52	10,989,139.52	
	EQT AB	20,102	325.00	6,533,150.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	340.60	3,445,169.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	325.00	3,629,600.00	
	INVESTOR AB-B SHS	157,664	194.95	30,736,596.80	
	KINNEVIK AB - B	18,792	311.90	5,861,224.80	
	KINNEVIK AB-B-RED	18,792	174.00	3,269,808.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	543.80	3,958,864.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	573.20	5,416,740.00	
	SINCH AB	3,315	1,586.50	5,259,247.50	
	ERICSSON (LM) B	253,862	108.42	27,523,718.04	
	HEXAGON AB-B SHS	169,708	121.00	20,534,668.00	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	114.40	5,721,372.80	
	TELIA CO AB	230,643	36.45	8,408,090.56	
	スウェーデンクローナ 小計	2,875,360		471,583,460.09 (6,253,196,680)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	191.10	14,594,307.00	
	NORSK HYDRO	126,800	53.26	6,753,368.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	466.30	7,651,050.40	
	ADEVINTA ASA	19,117	161.90	3,095,042.30	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	362.20	3,359,042.80	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	420.00	2,974,440.00	
	MOWI ASA	40,968	230.10	9,426,736.80	
	ORKLA	69,804	88.38	6,169,277.52	
	DNB ASA	85,517	186.45	15,944,644.65	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	187.05	3,474,266.70	
	TELENOR ASA	65,744	143.15	9,411,253.60	
	ノルウェークローネ 小計	535,658		82,853,429.77 (1,097,807,944)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	556.00	5,752,932.00	
	NOVOZYMES A/S	19,125	455.40	8,709,525.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,058.00	2,308,790.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	217.80	19,030,275.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,500.00	5,232,500.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,290.00	9,401,060.00	
	DSV PANALPINA A S	18,142	1,477.00	26,795,734.00	
	PANDORA A/S	9,401	819.20	7,701,299.20	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,126.00	9,735,396.00	
	AMBU A/S-B	13,555	241.70	3,276,243.50	
	COLOPLAST-B	9,208	981.40	9,036,731.20	
	DEMANT A/S	11,604	343.20	3,982,492.80	

	GN STORE NORD A/S	11,967	529.80	6,340,116.60
	GENMAB A/S	5,192	2,607.00	13,535,544.00
	NOVO NORDISK A/S-B	147,877	506.90	74,958,851.30
	DANSKE BANK A/S	64,813	113.35	7,346,553.55
	TRYG A/S	29,772	145.15	4,321,405.80
	ORSTED A/S	15,439	857.60	13,240,486.40
	デンマーククローネ 小計	464,031		230,705,936.35 (4,141,171,557)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	29.72	613,093.88
	OIL SEARCH LTD	186,117	4.21	783,552.57
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.84	801,479.80
	SANTOS	156,437	7.67	1,199,871.79
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	30.79	394,512.27
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	23.76	1,767,839.04
	BHP GROUP LTD	252,353	48.67	12,282,020.51
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	22.32	1,101,000.96
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.90	598,554.60
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	22.65	3,136,639.95
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	43.51	1,607,607.48
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	27.50	2,037,695.00
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.90	1,107,745.20
	ORICA LTD	38,288	14.20	543,689.60
	RIO TINTO LTD	32,028	124.80	3,997,094.40
	SOUTH32 LTD	341,133	2.99	1,019,987.67
	REECE LTD	16,814	23.02	387,058.28
	BRAMBLES LTD	137,883	11.11	1,531,880.13
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.72	712,346.52
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.81	408,850.00
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.42	3,366,969.06
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	40.80	2,152,281.60
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.47	378,190.16
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	116.22	411,535.02
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.08	924,626.04
	REA GROUP LTD	5,276	165.03	870,698.28
	SEEK LTD	31,593	29.95	946,210.35
WESFARMERS LTD	100,575	54.33	5,464,239.75	
COLES GROUP LTD	115,478	16.76	1,935,411.28	
WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	42.63	4,685,079.63	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.91	840,107.58	
COCHLEAR LIMITED	6,220	234.55	1,458,901.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	63.49	1,031,585.52	
SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	35.63	1,427,907.88	

	CSL LIMITED	38,878	294.11	11,434,408.58	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	28.73	6,886,035.13	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	152,346	101.08	15,399,133.68	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	26.56	7,400,625.28	
	WESTPAC BANKING	318,928	26.55	8,467,538.40	
	ASX LTD	18,195	74.11	1,348,431.45	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	151.41	4,513,986.33	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	49.35	538,507.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	5.22	1,197,504.54	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.11	839,264.60	
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	11.23	1,550,537.33	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	11.26	1,343,926.04	
	AFTERPAY LTD	19,934	98.84	1,970,276.56	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.13	715,784.88	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	29.89	412,511.89	
	XERO LTD	11,340	129.28	1,466,035.20	
	TELSTRA CORP	308,467	3.57	1,101,227.19	
	AGL ENERGY LTD	64,235	9.16	588,392.60	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.80	336,861.00	
	オーストラリアドル 小計	5,725,037		129,437,250.68 (10,962,040,760)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.70	907,606.70	
	A2 MILK CO LTD	66,854	6.15	411,152.10	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	29.35	1,600,162.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.90	468,489.30	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.79	829,235.22	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.52	421,276.76	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.40	596,937.60	
	ニュージーランドドル 小計	623,837		5,234,859.68 (411,407,622)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	60.00	13,769,760.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	135.70	15,944,750.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	30.25	5,203,000.00	
	MTR CORP	151,000	43.25	6,530,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	62.75	10,918,500.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	33.95	6,722,100.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.72	1,151,040.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	13.06	1,838,848.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	16.00	2,755,200.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	25.95	3,786,105.00	
	WH GROUP LTD	936,500	7.31	6,845,815.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	15.74	1,718,178.40	

	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	28.50	8,022,750.00	
	HANG SENG BANK	59,400	160.80	9,551,520.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	104,100	466.40	48,552,240.00	
	AIA GROUP LTD	1,045,200	96.35	100,705,020.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	207,496	51.60	10,706,793.60	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.40	3,830,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	19.78	3,421,940.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	38.40	4,808,755.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	41.90	5,714,112.50	
	SINO LAND CO	315,400	12.70	4,005,580.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	122.20	14,480,700.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	58.55	2,371,275.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	23.20	2,231,840.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	44.60	7,002,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	47.90	3,233,250.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	78.00	10,725,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.20	11,036,815.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	48.45	6,661,875.00	
	香港ドル 小計	6,942,612		334,246,513.10 (4,722,903,230)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.21	715,333.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.88	571,912.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.02	543,826.64	
	SINGAPORE AIRLINES-MCB RTS	226,413	0.00	226.41	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.88	541,200.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.78	853,708.00	
	DBS GROUP	155,200	29.72	4,612,544.00	
	OCBC BANK	291,200	12.36	3,599,232.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.03	2,444,217.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	10.47	819,801.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.70	826,950.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.66	327,848.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.42	352,450.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	19.00	488,300.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.34	1,760,248.62		
	シンガポールドル 小計	3,123,388		18,457,796.67 (1,527,751,830)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	23.84	1,615,303.04	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	424.00	909,904.00	
	BANK HAPUALIM BM	98,310	27.15	2,669,116.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	25.45	2,770,588.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	16.25	1,616,875.00	



	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	102.40	1,280,307.20	
	AZRIELI GROUP	4,323	241.20	1,042,707.60	
	NICE LTD	5,891	726.80	4,281,578.80	
	イスラエルシェケル 小計	399,293		16,186,380.94 (547,206,505)	
	合 計	95,319,527		494,972,353,442 (494,972,353,442)	

## (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	1,053,743.73	
		LENDLEASE GROUP	64,786	817,599.32	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	758,515.59	
		オーストラリアドル 小計	303,750	2,629,858.64 (222,722,728)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,752,975.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,937,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	5,690,475.00 (80,406,411)	
		投資信託受益証券合計	899,250	303,129,139 (303,129,139)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	863,211.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,089,097.82	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,586	10,302,847.86	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,195,619.58	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,534,389.00	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,594,489.02	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,167,310.04	
		CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	7,264,540.31	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,924	3,848,893.12	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,539,782.80	
		EQUINIX INC	7,704	6,240,317.04	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,259,692.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32,077	2,545,309.95	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,708,320.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,723,338.76	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,566,621.65	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,205,897.29	
		INVITATION HOMES INC	51,458	1,927,102.10	
IRON MOUNTAIN INC	27,546	1,295,212.92			

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,082,779.04	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,619,930.07	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	784,284.19	
	PROLOGIS INC	63,163	7,807,578.43	
	PUBLIC STORAGE	13,912	4,087,902.08	
	REALTY INCOME CORP	31,608	2,242,903.68	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	844,992.94	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,586	3,035,982.06	
	SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,820,383.84	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,589,185.15	
	UDR INC	28,059	1,393,690.53	
	VENTAS INC	31,565	1,821,300.50	
	VEREIT INC	21,159	1,042,715.52	
	VICI PROPERTIES INC	49,459	1,614,836.35	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	772,731.90	
	WELLTOWER INC	35,679	2,812,932.36	
	WP CAREY INC	16,500	1,272,150.00	
	アメリカドル 小計	1,058,468	89,518,272.10	(9,815,678,535)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	506,025.78	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	338,921.20	
	カナダドル 小計	24,377	844,946.98	(76,476,151)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	404,899.20	
	GECINA SA	4,459	606,646.95	
	KLEPIERRE	17,225	443,716.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	863,478.45	
	ユーロ 小計	37,101	2,318,740.60	(309,528,682)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	411,364.52	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	481,162.94	
	SEGRO PLC	106,999	1,155,054.20	
	イギリスポンド 小計	252,762	2,047,581.66	(316,863,261)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,000,176.70	
	GOODMAN GROUP	139,848	2,831,922.00	
	GPT GROUP	167,884	797,449.00	
	MIRVAC GROUP	392,919	1,151,252.67	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,382,122.92	
	STOCKLAND	207,412	976,910.52	
	VICINITY CENTERS	365,149	606,147.34	
	オーストラリアドル 小計	1,853,965	8,745,981.15	(740,697,143)

香港ドル	LINK REIT	170,500	12,915,375.00	
香港ドル 小計		170,500	12,915,375.00	(182,494,248)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	838,207.10	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	917,104.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	468,600.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	551,631.70	
シンガポールドル 小計		1,203,783	2,775,542.80	(229,731,677)
投資証券合計		4,600,956	11,671,469,697	(11,671,469,697)
合計			11,974,598,836	(11,974,598,836)

(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 601銘柄	97.3%			69.6%
	投資証券 36銘柄			2.7%	1.9%
カナダドル	株式 89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	99.4%			10.8%
	投資証券 4銘柄			0.6%	0.1%
イギリスポンド	株式 83銘柄	98.7%			4.6%
	投資証券 3銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.2%
スウェーデンクローナ	株式 44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 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 53銘柄	91.9%			2.2%
	投資信託受 益証券 3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.2%	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	30銘柄	94.7%			0.9%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	15銘柄	86.9%			0.3%
	投資証券	4銘柄			13.1%	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。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 6月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	140,845,742
コール・ローン	4,178,428,764
国債証券	300,030,790,537
派生商品評価勘定	27,377,992
未収入金	21,242,043
未収利息	1,593,810,124
前払費用	50,836,966
差入委託証拠金	446,001,116
流動資産合計	306,489,333,284
資産合計	306,489,333,284
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,300,484
前受金	19,551,976
未払解約金	295,973,588
未払利息	4,608
流動負債合計	320,830,656
負債合計	320,830,656
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	99,315,132,569
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	206,853,370,059
元本等合計	306,168,502,628
純資産合計	306,168,502,628
負債純資産合計	306,489,333,284

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 6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>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)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>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,315,132,569口

	2021年 6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)	3,0828円 (30,828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 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
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 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2021年 6月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	96,103,991,147円
期中追加設定元本額	16,586,103,416円
期中一部解約元本額	13,374,961,994円
期末元本額	99,315,132,569円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,435,208,752円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	613,650,280円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	404,171,534円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,059,018,972円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,391,523円

区分	2021年 6月10日現在
SMT グローバル債券インデックス・オープン	7,236,344,708円
世界経済インデックスファンド	9,379,755,096円
DCマイセレクション25	1,891,368,272円
DCマイセレクション50	1,594,192,938円
DCマイセレクション75	1,080,819,981円
DC外国債券インデックス・オープン	2,147,640,444円
DCマイセレクションS25	860,354,115円
DCマイセレクションS50	684,139,913円
DCマイセレクションS75	358,924,835円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	38,022,151円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	81,114,760円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	41,047,907円
DC世界経済インデックスファンド	11,133,104,762円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	668,257,526円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	3,926,857円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,388,520円
マイセレクション75VA1（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VA1（適格機関投資家専用）	32,068,266円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	66,579,413円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	106,881,548円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	88,131,764円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	95,372,951円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,598,674,939円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	481,949,100円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,919,758,076円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	399,363,690円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	61,138,545円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	504,026,017円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	190,814,607円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	232,767,930円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	802,540,027円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,578,777,921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	628,534,416円
コア投資戦略ファンド（安定型）	879,380,958円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,337,888,027円
分散投資コア戦略ファンドA	1,164,439,715円
分散投資コア戦略ファンドS	2,447,192,293円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	447,829,879円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,611,816,499円
コア投資戦略ファンド（切替型）	911,215,909円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	225,441,673円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	100,609,140円



区分	2021年 6月10日現在
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)	1,211,353,164円
SMT インデックスバランス・オープン	193,883,356円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	20,901,118,995円
SMT 世界経済インデックス・オープン	176,921,490円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	189,165,294円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	301,714,383円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,322,757円
グローバル経済コア	765,691,678円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,757,257円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	540,788円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	245,707,323円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,131,700円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	4,358,603円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,372,356円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,603,622円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,221,004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)	491,178,493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)	10,519,592,950円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	337,343,092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)	339,634,223円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	186,424,730円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,389,629,698
合計	1,389,629,698

(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 6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	3,951,973,691	-	3,971,525,667	19,551,976
合計		3,951,973,691	-	3,971,525,667	19,551,976

## (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 6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	3,968,670,820	-	3,971,117,303	2,446,483
	アメリカドル	1,779,374,281	-	1,781,711,750	2,337,469
	カナダドル	184,614,646	-	184,627,752	13,106
	ユーロ	1,714,741,780	-	1,715,406,895	665,115
	イギリスポンド	289,940,113	-	289,370,906	569,207
	売建	65,077,413	-	64,998,364	79,049
	イギリスポンド	65,077,413	-	64,998,364	79,049
	合計	4,033,748,233	-	4,036,115,667	2,525,532

## (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	9,972,656.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,696,017.18	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,496,923.80	

T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,048,980.44	
T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,987,500.00	
T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,242,636.73	
T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,400,374.97	
T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,998,984.44	
T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,170,220.72	
T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,015,000.00	
T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	988,203.13	
T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,869,921.90	
T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,386,621.07	
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,541,500.00	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,888,750.00	
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	7,019,960.92	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,960,312.48	
T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,143,378.93	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,674,687.52	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,964,609.39	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,948,437.52	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,396,679.74	
T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,820,535.38	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,224,230.48	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,865,121.87	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,404,433.58	
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,897,261.70	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,512,736.73	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,238,964.82	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,160,367.25	
T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,829,761.79	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,429,589.85	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,703,906.30	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,305,429.73	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	11,020,195.34	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,579,433.64	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,571,457.10	
T 1.125% 02/29/28	2,000,000.00	2,001,406.26	
T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	6,844,703.12	
T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	7,867,945.35	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,188,222.68	
T 1.25% 05/15/50	10,650,000.00	8,497,535.20	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,655,751.96	
T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,301,289.04	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,125,000.00	

T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,159,765.62
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,566,503.90
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,109,531.24
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,085,644.55
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,489,765.69
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,336,351.57
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,203,203.14
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,531,161.75
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,983,117.16
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,098,281.24
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,167,382.80
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,701,546.89
T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,668,847.68
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,816,425.76
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,452,792.98
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,597,480.46
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,367,805.08
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,028,945.31
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,545,605.47
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,909,257.81
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,093,750.00
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,584,960.95
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,604,546.87
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,255,014.09
T 1.625% 11/15/50	8,050,000.00	7,072,679.68
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,143,889.82
T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,682,335.92
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,750,989.22
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,803,654.87
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,706,120.15
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,123,593.75
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,505,375.00
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,472,424.97
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,260,946.29
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,098,671.89
T 1.875% 02/15/41	3,000,000.00	2,892,890.64
T 1.875% 02/15/51	9,900,000.00	9,245,671.86
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,183,867.21
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,478,085.53
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,087,265.64
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,293,437.50
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,721,772.27
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,632,903.31

T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,360,378.91	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,786,476.54	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,551,125.00	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,843,421.88	
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,129,960.96	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,069,250.00	
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,462,187.52	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,806,776.56	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,485,730.44	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,212,500.00	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,620,550.82	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	8,048,144.55	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,397,304.67	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,190,582.07	
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,413,018.75	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,586,796.87	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,694,980.45	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,792,304.68	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,713,500.00	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,222,255.87	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,732,734.37	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,942,062.50	
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,184,277.35	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,092,324.98	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,806,882.80	
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,635,195.31	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,662,064.06	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,324,218.75	
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	7,827,539.10	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,677,251.16	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,372,656.25	
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,419,903.92	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,264,687.52	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,222,520.52	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,412,882.85	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,383,773.43	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,780,166.02	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,109,535.17	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	10,985,878.12	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,460,101.56	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,838,212.87	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,148,062.50	

T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,714,238.29
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,335,842.95
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,202,031.25
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,249,519.56
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,776,695.30
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,078,471.07
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,989,199.20
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,055,195.31
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,445,742.19
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,536,265.62
T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	7,927,441.42
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,526,121.11
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,497,718.75
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,133,504.70
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,412,425.79
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,367,656.24
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,098,870.34
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,707,656.25
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,404,194.55
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,175,439.08
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,978,486.73
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	9,956,950.00
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	4,896,289.08
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,043,720.71
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,659,667.97
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,284,597.64
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,244,140.62
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,156,933.60
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,937,857.85
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	4,808,593.75
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,538,823.03
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,476,922.27
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,782,734.37
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,065,800.77
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,299,632.06
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,263,085.90
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,846,773.48
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,055,585.94
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,236,867.18
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,124,257.83
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,113,220.31
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	4,900,078.12
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,533,343.79

T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,058,027.35	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,700,889.06	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,655,640.62	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	952,213.28	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,060,375.00	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,543,125.00	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,564,843.76	
T 3.75% 11/15/43	4,500,000.00	5,831,367.21	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,882,847.66	
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,273,375.00	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,214,148.43	
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,233,203.16	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,871,353.12	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,067,109.37	
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,680,253.93	
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,395,234.37	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,630,500.00	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,517,382.80	
T 3% 11/15/44	4,050,000.00	4,699,898.43	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,217,390.62	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,200,957.04	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,362,421.88	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,623,632.82	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,704,558.60	
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,732,795.31	
T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,161,903.12	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	760,375.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,369,640.62	
T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,376,996.87	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,086,386.72	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,588,812.50	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,675,984.37	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,649,410.16	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,560,281.25	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,117,628.90	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,911,224.61	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,484,109.37	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,868,753.91	
アメリカドル 小計	1,162,010,000.00	1,209,165,720.72	(132,585,021,276)
カナダドル			
CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,059,479.80	
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,216,889.60	

	CAN 0.25% 04/01/24	700,000.00	695,338.00	
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,596,776.00	
	CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	910,464.10	
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,770,212.40	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	3,948,344.40	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,225,480.40	
	CAN 1.25% 03/01/25	2,400,000.00	2,454,240.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,576,220.20	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,094,995.20	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,402,309.60	
	CAN 1.5% 06/01/31	650,000.00	651,475.50	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	618,330.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,711,187.80	
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,730,795.80	
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,524,350.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,412,401.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,912,680.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,359,892.80	
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	317,883.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,761,493.10	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,212,854.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	682,567.20	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,388,600.00	
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,465,892.70	
	CAN 2% 12/01/51	4,530,000.00	4,585,537.80	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,480,000.00	1,944,512.80	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,435,612.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,571,906.70	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,410,000.00	2,050,633.50	
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,200,496.40	
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>65,130,000.00</b>	<b>68,489,852.30</b>	<b>(6,199,016,531)</b>
メキシコ ペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,993,761.00	
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	33,718,377.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,980,000.00	45,557,443.80	
	MBONO 6.5% 06/09/22	33,080,000.00	33,686,356.40	
	MBONO 6.75% 03/09/23	33,850,000.00	34,875,316.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	41,340,707.70	
	MBONO 7.75% 05/29/31	24,180,000.00	26,464,768.20	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	25,563,266.30	
	MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,176,394.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	39,970,000.00	45,080,164.50	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	29,650,624.80	



	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	36,824,301.00	
	MBONO 8% 11/07/47	23,430,000.00	25,384,999.20	
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	37,109,351.40	
	メキシコペソ 小計	411,460,000.00	441,425,832.60 (2,451,943,929)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,390,234.90	
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	1,000,305.60	
	BGB 0.4% 06/22/40	710,000.00	684,432.90	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,681,981.20	
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	533,798.40	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,420,000.00	2,555,786.20	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,811,240.60	
	BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,249,362.50	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,561,898.00	
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	439,128.90	
	BGB 0% 10/22/31	630,000.00	625,010.40	
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,693,500.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	831,520.80	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,630,332.00	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,209,690.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,292,172.00	
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,451,205.20	
	BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,175,168.60	
	BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,219,827.00	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,961,111.00	
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,074,242.40	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,352,994.20	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,995,444.00	
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,393,147.10	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,400,000.00	4,035,120.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,235,765.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,418,502.00	
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,538,535.60	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,898,866.60	
	BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,414,343.80	
	BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,224,532.10	
	BKO 0% 06/10/22	900,000.00	906,039.00	
	BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	5,001,084.00	
	BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,045,732.50	
	BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,664,224.80	
	BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,876,140.50	
	BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	590,057.20	

BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,788,466.50
BTPS 0.5% 07/15/28	620,000.00	622,027.40
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,132,144.50
BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,809,466.50
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,220,300.60
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,331,045.00
BTPS 0.9% 04/01/31	2,500,000.00	2,529,425.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,229,067.40
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,046,740.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	970,744.20
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,641,146.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,279,327.60
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,474,367.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,007,300.00
BTPS 0% 04/15/24	2,000,000.00	2,012,940.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,065,615.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,055,546.40
BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,494,848.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,438,483.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,037,202.80
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,532,936.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,562,046.90
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,041,231.20
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,247,519.10
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,750,337.40
BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,088,662.40
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,392,768.00
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,892,137.80
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,123,020.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,907,549.00
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,194,668.00
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,033,180.00
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,523,328.00
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	721,407.90
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,543,089.20
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,095,833.60
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,070,584.00
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,076,938.80
BTPS 2.45% 10/01/23	910,000.00	968,695.00
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,278,512.00
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,221,665.50
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,017,722.80
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,577,914.80

BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,212,736.40	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,542,348.50	
BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	2,978,690.80	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,277,556.60	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,797,904.60	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,564,971.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,835,872.40	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,889,517.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,922,676.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,424,254.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,154,204.80	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,012,512.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,107,362.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,518,464.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,912,868.40	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,494,648.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,737,331.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,885,795.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,900,562.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,195,652.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,925,117.60	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,501,752.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,734,625.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,707,656.80	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,359,535.80	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,381,908.30	
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,068,463.40	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	5,005,368.00	
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,903,893.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,934,282.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	978,672.00	
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,075,164.00	
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,096,053.30	
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,292,880.40	
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,134,430.00	
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,163,380.00	
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,552,400.50	
DBR 0.5% 08/15/27	5,690,000.00	6,060,874.20	
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,674,493.90	
DBR 0% 02/15/31	800,000.00	819,400.00	
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,821,381.80	
DBR 0% 05/15/36	620,000.00	614,544.00	

DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,488,504.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,607,135.00
DBR 0% 08/15/30	6,450,000.00	6,628,987.50
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	692,324.40
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,038,686.60
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,230,156.80
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,497,339.20
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,070,644.80
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,149,437.20
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,440,590.40
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,876,356.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,760,583.00
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,144,360.90
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,110,320.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,912,875.20
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,416,023.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,800,000.00	5,926,632.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,031,113.80
DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,266,623.40
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,768,575.00
DBR 4.25% 07/04/39	2,720,000.00	4,787,553.60
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,519,025.50
DBR 4.75% 07/04/34	3,390,000.00	5,584,686.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,353,199.70
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,461,214.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,340,391.20
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,817,117.10
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,978,475.00
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,411,004.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,851,007.20
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,822,655.80
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,333,912.80
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,624,615.50
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,110,246.50
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	769,408.20
FRTR 0.5% 06/25/44	910,000.00	870,942.80
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,357,838.70
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,623,984.00
FRTR 0.75% 11/25/28	6,200,000.00	6,639,332.00
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,073,226.50
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,557,190.00
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,323,890.60
FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	968,582.00

FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,353,374.20	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,053,589.50	
FRTR 0% 03/25/25	6,690,000.00	6,829,687.20	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,300,081.20	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,031,000.40	
FRTR 0% 11/25/31	1,670,000.00	1,651,546.50	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,744,099.90	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,830,000.00	5,419,260.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,742,224.10	
FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	4,748,817.20	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,635,281.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,056,522.10	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,643,401.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,499,539.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,028,231.00	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,639,462.40	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,451,698.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	5,972,412.60	
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,846,187.80	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,158,149.40	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,581,791.20	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,224,593.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,595,171.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,609,498.60	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000.00	8,206,003.20	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	5,916,115.20	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	4,547,688.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,314,677.80	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,361,130.80	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,500,791.10	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,107,010.40	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,450,145.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,173,050.00	
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	957,909.30	
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,045,171.90	
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	764,096.40	
IRISH 0.55% 04/22/41	490,000.00	481,606.30	
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,152,539.80	
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,409.60	
IRISH 0% 10/18/31	730,000.00	719,787.30	
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,314,444.00	
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	755,043.10	

IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	968,626.60
IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	909,058.80
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	978,120.60
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,520,408.20
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,473,380.70
IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,403,865.50
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,077,437.20
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,091,284.80
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,848,934.60
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,393,760.60
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,782,931.50
NETHER 0.5% 01/15/40	1,290,000.00	1,358,679.60
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,445,140.80
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,266,857.40
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,750,248.00
NETHER 0% 01/15/24	2,060,000.00	2,098,336.60
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,889,588.00
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	677,264.00
NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	872,317.60
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,952,313.60
NETHER 0% 07/15/31	1,170,000.00	1,182,823.20
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,041,423.20
NETHER 2.25% 07/15/22	1,220,000.00	1,259,430.40
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,621,374.20
NETHER 2.75% 01/15/47	2,100,000.00	3,378,795.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,156,980.90
NETHER 3.75% 01/15/23	2,330,000.00	2,497,899.80
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,534,815.80
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,504,241.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,416,602.40
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	226,564.00
OBL 0% 04/05/24	4,250,000.00	4,335,255.00
OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,193,850.10
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,848,250.00
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,248,926.60
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,198,355.20
OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,465,035.40
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,535,790.80
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,572,189.50
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,868,659.80
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	938,416.00
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,737,919.80
RAGB 0.75% 03/20/51	790,000.00	812,838.90

RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,219,027.20	
RAGB 0.85% 06/30/20	400,000.00	364,356.00	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,464,920.50	
RAGB 0% 02/20/31	590,000.00	590,902.70	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	950,692.50	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,520,415.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,350,000.00	1,375,947.00	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,668.80	
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	384,753.60	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,540,953.70	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,137,659.70	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	429,755.70	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,066,764.60	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,405,996.20	
RAGB 2.1% 09/20/17	780,000.00	1,282,015.80	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,260,000.00	1,622,917.80	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,317,102.10	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,499,594.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	975,113.70	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,916,186.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,650,966.80	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,665,971.20	
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	527,509.80	
RFGB 0.125% 04/15/52	490,000.00	427,304.50	
RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	404,976.00	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	387,812.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	651,434.00	
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	919,894.50	
RFGB 0.5% 09/15/28	1,030,000.00	1,089,966.60	
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	803,160.40	
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	539,620.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	733,111.20	
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,343.00	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,794.80	
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	634,983.30	
RFGB 1.125% 04/15/34	710,000.00	797,337.10	
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	598,441.90	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	676,292.50	
RFGB 1.625% 09/15/22	930,000.00	957,100.20	
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	856,290.60	
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	512,752.80	
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	786,253.80	

RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	987,683.40
SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,116,758.20
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,341,891.40
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,660,220.40
SPGB 0.45% 10/31/22	3,060,000.00	3,104,553.60
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,960,146.00
SPGB 0.6% 10/31/29	3,400,000.00	3,513,628.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,110,600.00
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	949,814.40
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,385,226.50
SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,428,992.70
SPGB 0% 01/31/28	780,000.00	780,639.60
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,404,918.60
SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,276,972.20
SPGB 1.2% 10/31/40	1,810,000.00	1,847,991.90
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,309,768.50
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,736,729.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,730,484.20
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,624,225.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,968,119.10
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,336,065.60
SPGB 1.45% 10/31/71	560,000.00	500,080.00
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,910,601.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,290,218.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,154,222.50
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,119,465.30
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,382,352.40
SPGB 1% 10/31/50	2,430,000.00	2,218,249.80
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,121,741.40
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,942,664.40
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,441,056.50
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	3,995,028.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,250,000.00	3,055,185.00
SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	3,020,560.60
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,834,244.00
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,787,283.50
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	3,010,755.60
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,437,166.80
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,383,588.00
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,739,168.00
SPGB 4.9% 07/30/40	2,550,000.00	4,291,522.50
SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,904,284.10
SPGB 5.15% 10/31/44	2,100,000.00	3,814,272.00



	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,306,829.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,066,283.60	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,589,737.20	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,524,117.00	
	ユーロ 小計	788,990,000.00	921,973,794.80 (123,074,281,867)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	3,000,000.00	2,974,860.00	
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,515,321.80	
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,969,019.90	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,200,110.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	1,986,037.50	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,333,630.20	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,166,852.50	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,046,499.80	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,729,189.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,950,000.00	2,767,513.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	2,550,000.00	2,150,364.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,953,097.10	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,260,000.00	1,152,421.20	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,728,118.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,135,433.60	
	UKT 1.25% 07/31/51	180,000.00	178,837.20	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,807,140.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,117,360.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,681,401.50	
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,369,950.00	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,046,334.80	
	UKT 1.625% 10/22/71	900,000.00	1,078,191.00	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,447,238.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,916,887.60	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,186,549.60	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,193,729.30	
	UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,640,400.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,622,500.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,793,139.20	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,756,339.20	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,913,998.40	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,810,000.00	3,919,191.30	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,723,739.50	
UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,570,615.80		
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,630,064.00		
UKT 4.25% 03/07/36	2,390,000.00	3,432,494.10		

	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,845,101.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,820,000.00	2,745,542.80	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,700,978.30	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,070,000.00	3,173,993.10	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,599,572.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,594,149.80	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,081,494.30	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,541,348.30	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,790,963.80	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,780,000.00	2,435,093.40	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,598,766.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,872,654.40	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,123,568.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,745,337.50	
	イギリスポンド 小計	106,280,000.00	127,683,131.70 (19,758,964,630)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,970,000.00	5,851,555.20	
	SGB 0.75% 05/12/28	8,380,000.00	8,765,061.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,754,616.70	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,050,125.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,527,083.90	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,486,087.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	10,050,000.00	11,120,626.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	8,567,261.40	
	SGB 3.5% 06/01/22	14,000,000.00	14,526,400.00	
	スウェーデンクローナ 小計	76,950,000.00	83,648,817.20 (1,109,183,316)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,924,550.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,040,000.00	5,001,343.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,838,268.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	5,360,000.00	5,516,351.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,905,134.10	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,841,543.20	
	NGB 2% 04/26/28	6,100,000.00	6,368,583.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,579,221.00	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,798,729.60	
	ノルウェークローネ 小計	56,270,000.00	57,773,724.10 (765,501,844)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	8,020,000.00	8,112,470.60	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,870,000.00	3,571,042.50	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,941,833.60	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	14,993,819.60	
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,084,466.90	

	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,794,487.40	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,330,000.00	9,153,837.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	15,750,000.00	27,641,250.00	
デンマーククローネ 小計		71,180,000.00	85,293,207.60	(1,531,013,076)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,500,000.00	1,415,760.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,539,992.80	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,221,586.80	
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,600,000.00	2,472,626.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,127,010.90	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,059,240.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,050,000.00	6,375,006.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,428,084.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,017,573.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,522,771.60	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,065,593.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,260,000.00	6,826,154.40	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	4,073,772.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	783,174.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,651,325.70	
ポーランドズロチ 小計		61,150,000.00	64,579,671.20	(1,926,056,403)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,930,175.80	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,310,492.60	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,640,000.00	3,595,046.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,648,045.60	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,196,699.00	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	1,791,318.10	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,633,554.30	
	ACGB 1% 11/21/31	3,750,000.00	3,560,962.50	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,152,729.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,769,024.00	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,261,530.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,161,457.90	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,486,191.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,771,027.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,371,929.70	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,148,804.10	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,854,867.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,150,000.00	3,524,062.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,863,078.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,740,666.00	
ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,148,138.60		

	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,017,175.40	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,884,943.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,309,721.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,509,759.10	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,841,559.20	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,754,425.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,560,547.50	
	オーストラリアドル 小計	71,860,000.00	76,797,932.10 (6,504,016,869)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	386,786.40	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	818,648.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	423,675.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	787,374.80	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	943,551.30	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	523,922.70	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	466,704.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,151,608.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,465,146.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,042,875.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,122,718.90	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	659,378.10	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	853,601.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	427,010.90	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,397,398.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	983,027.10	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,001,686.40	
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,316,977.80	
	シンガポールドル 小計	14,460,000.00	15,772,092.60 (1,305,456,104)	
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,528,230.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	725,466.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,392,816.80	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,563,287.90	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,430,000.00	3,594,777.20	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,125,861.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	522,395.50	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,537,920.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	965,870.10	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,367,131.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,082,736.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,576,695.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,192,884.50	

	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,085,343.50	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,536,724.80	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	634,704.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,517,254.60	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,004,633.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	731,834.40	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,352,076.80	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,140,560.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,108,987.30	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,139,831.80	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,650,000.00	2,890,620.00	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,058,437.60	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,563,797.60	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,465,158.80	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,509,191.30	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,580,000.00	1,706,810.80	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,698,309.60	
	マレーシアリングット 小計	51,510,000.00	54,320,347.40 (1,445,116,794)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	699,656.71	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,428,320.92	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,804,323.32	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,045,983.41	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,808,204.28	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,143,214.01	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,920,000.00	2,862,198.01	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,880,000.00	3,133,883.80	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,481,290.44	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,930,827.71	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,052,692.38	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,288,381.86	
	イスラエルシェケル 小計	36,100,000.00	40,678,976.85 (1,375,217,898)	
	合計		300,030,790,537 (300,030,790,537)	

## 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 211銘柄	100.0%	44.2%
カナダドル	国債証券 32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 339銘柄	100.0%	41.0%
イギリスポンド	国債証券 50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%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年 6月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,108,606,598
コール・ローン	59,861,955
株式	94,353,352,702
投資信託受益証券	241,885,779
投資証券	75,320,955
派生商品評価勘定	131,131,002
未収入金	1,892,794
未収配当金	197,930,348
前払金	822,475
差入委託証拠金	885,011,647
流動資産合計	100,055,816,255
資産合計	100,055,816,255
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,819,094

項目	2021年 6月10日現在
	金額（円）
前受金	129,248,292
未払解約金	14,237,535
未払利息	66
流動負債合計	145,304,987
負債合計	145,304,987
純資産の部	
元本等	
元本	26,074,272,136
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,836,239,132
元本等合計	99,910,511,268
純資産合計	99,910,511,268
負債純資産合計	100,055,816,255

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 6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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

	2021年 6月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2021年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,074,272,136口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.8318円 (1万口当たり純資産額) (38,318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 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。



	2021年 6月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2021年 6月10日現在

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	25,324,856,282円
期中追加設定元本額	3,894,930,956円
期中一部解約元本額	3,145,515,102円
期末元本額	26,074,272,136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	7,467,751,425円
世界経済インデックスファンド	3,991,238,527円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,961,142,351円
DC 世界経済インデックスファンド	4,694,675,468円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	194,806,543円
分散投資コア戦略ファンドA	282,739,656円
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）	609,752,616円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	544,563,209円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	309,705,994円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	15,442,964円
SMT インデックスバランス・オープン	82,965,630円
SMT 世界経済インデックス・オープン	113,039,592円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	375,562,878円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	66,165,514円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,942,335円

区分	2021年 6月10日現在
グローバル経済コア	348,616,285円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	28,400,599円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	6,031,448円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	4,084,085円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,757,440円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,259,095円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	555,077,279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)	89,564,522円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,777,419,629
投資信託受益証券	51,521,716
投資証券	16,296,322
合計	10,845,237,667

(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 6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	5,067,689,116	-	5,196,937,408	129,248,292
	合計	5,067,689,116	-	5,196,937,408	129,248,292

## (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 6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	35,024,000	-	35,087,616	63,616
	アメリカドル	35,024,000	-	35,087,616	63,616
合計		35,024,000	-	35,087,616	63,616

## (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	7.61	4,386,909.09	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	39,446	90.74	3,579,330.04	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,717	223.60	2,172,721.20	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	7.52	1,009,033.39	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.98	613,812.29	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	25,084	43.40	1,088,645.60	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	5.55	86,086.05	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	10.63	179,965.90	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,882	36.47	2,439,186.54	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	36.08	707,095.84	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	21.28	570,687.04	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	104.40	828,727.20	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	22.78	883,248.94	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,585	66.59	638,265.15	
	51JOB INC-ADR	2,701	73.27	197,902.27	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,721	31.56	1,411,394.76	
	LI AUTO INC - ADR	46,720	27.43	1,281,529.60	
	NIO INC - ADR	132,230	42.74	5,651,510.20	
	XPENG INC - ADR	32,153	38.07	1,224,064.71	
	GAOTU TECHEDU INC	16,359	15.50	253,564.50	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	56.76	1,087,691.88		
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	156,180	9.02	1,408,743.60		

TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	28.85	1,184,523.30
YUM CHINA HOLDINGS INC	42,341	68.60	2,904,592.60
AUTOHOME INC-ADR	6,571	70.67	464,372.57
BAIDU INC - SPON ADR	26,907	186.73	5,024,344.11
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	16,053	107.04	1,718,313.12
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	5,000	7.96	39,800.00
HUYA INC-ADR	8,211	16.02	131,540.22
IQIYI INC-ADR	28,984	14.88	431,281.92
JOYY INC	6,185	73.05	451,814.25
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	19,368	23.00	445,464.00
MOMO INC-SPON ADR	15,529	14.62	227,033.98
NETEASE INC-ADR	40,751	110.32	4,495,650.32
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	64,895	15.57	1,010,415.15
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	49.51	259,877.99
YANDEX NV-A	30,372	68.53	2,081,393.16
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	35.88	125,867.04
DADA NEXUS LTD-ADR	7,696	30.89	237,729.44
JD.COM INC-ADR	85,581	72.64	6,216,603.84
OZON HOLDINGS PLC - ADR	3,921	57.53	225,575.13
PINDUODUO INC-ADR	44,003	125.52	5,523,256.56
TRIP.COM GROUP LTD	48,611	37.69	1,832,148.59
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	41,109	22.25	914,675.25
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	15.25	608,871.50
ADECOAGRO SA	17,629	11.50	202,733.50
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,157	9.27	75,615.39
BEIGENE LTD-ADR	4,248	347.85	1,477,666.80
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	5,009	28.80	144,259.20
HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	30.54	221,201.22
I-MAB-SPONSORED ADR	2,944	76.03	223,832.32
ZAI LAB LTD-ADR	7,677	171.34	1,315,377.18
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	141,961	3.16	449,306.56
CREDICORP LTD	6,128	125.39	768,389.92
SBERBANK-SPONSORED ADR	268,967	17.44	4,692,129.31
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	11,906	72.68	865,328.08
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.41	533,032.17
360 DIGITECH INC	8,061	39.21	316,071.81
LUFAX HOLDING LTD	12,385	12.16	150,601.60
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	44.37	89,671.77
UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	10,604	26.92	285,459.68
KE HOLDINGS INC	35,590	47.69	1,697,287.10
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.95	51,928.12
21VIANET GROUP INC-ADR	7,475	21.21	158,544.75

	AGORA INC-ADR	4,630	42.14	195,108.20
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	12,493	15.61	195,015.73
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	9,050	74.88	677,664.00
	GLOBANT SA	3,899	208.87	814,384.13
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	39.85	221,486.30
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	10,976	12.69	139,285.44
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	9.39	374,229.06
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,948	68.75	340,175.00
	アメリカドル 小計	3,273,360		84,931,044.17 (9,312,688,993)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	16.63	25,696,027.43
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	323,292	92.17	29,797,823.64
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	298.44	4,327,380.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	54.28	5,257,126.56
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	65.01	2,437,875.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	361.17	8,417,066.85
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	220.23	9,619,646.40
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	163.65	2,778,777.00
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	223,390	57.48	12,840,457.20
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	73.56	2,309,784.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	511,980	64.81	33,181,423.80
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	111.52	5,628,972.00
	BEACLE SAB DE CV	48,100	53.13	2,555,553.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	185,340	169.51	31,416,983.40
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	219.71	5,703,671.60
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	45.25	8,226,450.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	36.76	6,682,968.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	254,500	132.79	33,795,055.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	20.66	5,216,650.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,435,740	15.66	53,803,688.40
	TELESITES SAB DE CV	74,800	19.40	1,451,120.00
	メキシコペソ 小計	7,559,055		291,144,499.28 (1,617,191,235)
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	24.82	2,936,206.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	375,100	29.51	11,069,201.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	484,940	28.66	13,898,380.40
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	20.60	1,557,360.00
	BRADSPAR SA -PREF	24,000	70.20	1,684,800.00
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	57.03	1,100,679.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	44.78	2,821,140.00
	GERDAU SA-PREF	105,000	32.07	3,367,350.00
	SUZANO SA	74,079	59.70	4,422,516.30

VALE SA	393,678	112.20	44,170,671.60
WEG SA	171,144	34.25	5,861,682.00
CCR SA	125,600	13.80	1,733,280.00
LOCALIZA RENT A CAR	61,952	65.54	4,060,334.08
RUMO SA	114,200	20.82	2,377,644.00
ALPARGATAS SA - PREF	10,300	47.70	491,310.00
B2W CIA DIGITAL	22,349	66.14	1,478,162.86
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	96,618	22.30	2,154,581.40
LOJAS RENNER S.A.	82,907	47.90	3,971,245.30
MAGAZINE LUIZA SA	305,500	20.27	6,192,485.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	27.64	2,100,640.00
VIA VAREJO SA	135,900	15.08	2,049,372.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	22.85	948,275.00
RAIA DROGASIL SA	122,500	27.91	3,418,975.00
AMBEV SA	476,800	19.31	9,207,008.00
BRF SA	52,500	27.46	1,441,650.00
JBS SA	110,000	29.52	3,247,200.00
NATURA &CO HOLDING SA	100,308	56.54	5,671,414.32
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	100,500	15.60	1,567,800.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	86.85	4,724,640.00
REDE D'OR SAO LUIZ SA	22,600	68.94	1,558,044.00
HYPERA SA	35,300	35.30	1,246,090.00
BANCO BRADESCO S.A.	161,367	23.97	3,867,966.99
BANCO BRADESCO SA-PREF	475,802	28.10	13,370,036.20
BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	35.60	3,143,480.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	486,581	33.26	16,183,684.06
ITAUSA SA	503,167	11.98	6,027,940.66
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	637,309	16.40	10,451,867.60
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	24.28	1,675,320.00
TOTVS SA	57,900	35.21	2,038,659.00
TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	45.86	2,398,478.00
TIM SA	96,100	12.72	1,222,392.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	14,500	44.79	649,455.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	45.22	1,519,392.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	113,867	13.76	1,566,809.92
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	79,000	6.17	487,430.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	38.09	1,321,723.00
CPFL ENERGIA SA	43,700	29.09	1,271,233.00
ENGIE BRASIL SA	29,250	40.79	1,193,107.50
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	80,900	24.50	1,982,050.00
ブラジルリアル 小計	7,109,218		222,901,162.19 (4,826,166,803)

チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	7,322.50	327,535,425.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,663.80	226,218,567.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	12,523	34,496.00	431,993,408.00	
	FALABELLA SA	70,837	3,090.00	218,886,330.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,420.00	195,942,960.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,535.00	48,260,975.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	73.03	355,118,599.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	33,228.00	181,291,968.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	38.30	240,517,144.30	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,247.30	51,887,680.00	
	COLBUN SA	1,215,680	108.45	131,840,496.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	98.00	342,148,870.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	42.18	108,034,706.04	
チリペソ 小計		18,867,218		2,859,677,128.54 (435,554,563)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,370.00	1,158,880,230.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	28,340.00	832,515,840.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	28,260.00	1,081,736,280.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	19,880.00	413,901,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	23,360.00	1,179,936,960.00	
コロンビアペソ 小計		627,964		4,666,970,910.00 (142,547,959)	
ユーロ	OPAP SA	17,668	13.42	237,104.56	
	JUMBO SA	7,201	15.48	111,471.48	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.84	237,531.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.98	392,580.86	
ユーロ 小計		333,851		978,687.90 (130,645,047)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	35,948	16.65	598,713.94	
イギリスポンド 小計		35,948		598,713.94 (92,650,982)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	102.60	1,190,467.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	19.02	2,220,680.10	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	15.30	1,523,359.80	
	KOC HOLDING AS	89,884	19.29	1,733,862.36	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	89,157	8.14	725,737.98	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	181.50	1,179,931.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	62.65	2,682,923.60	
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.45	1,505,949.45	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.36	2,006,333.12	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.27	911,773.24	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	16.35	2,339,537.85	



	トルコリラ 小計	1,288,706		18,020,556.80 (230,210,811)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	799.50	5,966,668.50	
	MONETA MONEY BANK AS	14,764	79.35	1,171,523.40	
	CEZ AS	18,145	637.50	11,567,437.50	
	チェココルナ 小計	40,372		18,705,629.40 (98,309,305)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,392.00	101,313,160.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,915.00	120,133,870.00	
	OTP BANK NYRT	22,061	16,705.00	368,529,005.00	
	ハンガリーフォリント 小計	79,594		589,976,035.00 (227,305,376)	
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	80.28	2,465,639.64	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	200,051	6.33	1,267,523.13	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	195.35	2,565,336.20	
	LPP SA	124	11,400.00	1,413,600.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	176.50	1,183,256.00	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	29.98	1,082,218.04	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	59.64	2,338,066.92	
	DINO POLSKA SA	5,945	279.80	1,663,411.00	
	BANK PEKAO SA	15,847	95.80	1,518,142.60	
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	39.14	3,652,231.68	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	263.40	952,191.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	37.55	2,329,752.20	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.72	374,300.05	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.23	649,881.56	
	ポーランドズロチ 小計	625,942		23,455,550.02 (699,550,051)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.63	1,464,960.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,495,400	4.16	10,380,864.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	331,000	17.52	5,799,120.00	
	PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LT	90,000	2.52	226,800.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,148,000	3.41	7,324,680.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	11.22	1,593,240.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.29	1,458,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	105,500	42.85	4,520,675.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	11.08	2,426,520.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	4.91	2,297,880.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	9.93	4,091,160.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	7.98	2,298,240.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	14,800	108.80	1,610,240.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	16.98	1,409,340.00	

LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.35	1,054,100.00
MMG LIMITED	304,000	3.88	1,179,520.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	10.86	1,400,940.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	15.38	780,535.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	8.13	735,765.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	11.50	8,383,500.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	5.71	1,570,250.00
BOC AVIATION LTD	23,800	68.25	1,624,350.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.44	674,240.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	33.10	5,279,450.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	19.94	2,552,320.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.09	1,938,660.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	5.69	967,300.00
CITIC LTD	443,000	9.18	4,066,740.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	11.78	3,392,640.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	27.50	2,145,000.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	8.92	1,427,200.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	16.96	924,320.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	211,800	16.82	3,562,476.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	12.82	402,753.12
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	38.55	2,401,665.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	8.47	984,214.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	36.15	1,500,225.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.54	1,748,235.96
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	79.90	10,866,400.00
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	64,000	20.00	1,280,000.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	12.56	2,260,800.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	6.23	1,333,220.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.32	1,319,360.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	11.50	1,903,790.50
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.34	939,840.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	398,500	17.20	6,854,200.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	6.20	1,554,798.80
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	9.36	1,460,160.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	11.46	1,465,986.12
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.66	586,080.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.30	2,686,400.00
BYD CO LTD-H	83,000	199.50	16,558,500.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.72	2,053,520.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	52.50	3,066,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	567,000	21.75	12,332,250.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	23.55	8,307,262.50

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	6.95	2,490,490.80
MINTH GROUP LTD	64,000	35.50	2,272,000.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	16.48	1,779,840.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	154.90	17,193,900.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	4.14	803,160.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	188,400	31.00	5,840,400.00
LI NING CO LTD	217,000	73.20	15,884,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	190.00	16,112,000.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	15.20	684,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	18.56	1,299,200.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	7.54	723,840.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	40.75	4,727,000.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	27.55	1,570,350.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.08	1,566,000.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	90.00	2,898,000.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	26,500	203.40	5,390,100.00
TENCENT HOLDINGS LTD	578,800	603.00	349,016,400.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,523,688	208.00	316,927,104.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	41.50	2,241,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	1.22	1,472,488.76
HENGTECH NETWORKS GROUP LTD	268,000	6.86	1,838,480.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	26,150	103.50	2,706,525.00
MEITUAN-CLASS B	364,500	293.20	106,871,400.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	20.50	1,402,200.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	11.90	1,356,600.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	63.75	4,335,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	5.94	1,538,460.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	109.01	1,656,952.00
CHINA FEIHE LTD	346,000	19.24	6,657,040.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	46.25	12,996,250.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	148,000	71.80	10,626,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.79	1,178,340.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	22,800	43.70	996,360.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	115,000	47.15	5,422,250.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	14.54	3,315,120.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	86.65	3,985,900.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.78	702,400.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.85	3,276,000.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	54.70	2,625,600.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	52,500	53.20	2,793,000.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	26.60	665,000.00

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	18.08	7,629,760.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	18.50	2,294,000.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	67.40	4,448,400.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	89.00	4,779,300.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	17.06	4,162,640.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	17.68	2,270,112.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	26.50	3,317,800.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	20,500	73.25	1,501,625.00
3SBIO INC	119,000	10.06	1,197,140.00
AKESO INC	25,000	63.50	1,587,500.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	335.40	3,354,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	21.00	2,100,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	12.16	11,626,905.60
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	5.37	845,775.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	5.02	833,320.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	33.20	2,722,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	163.00	831,300.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	32.50	3,965,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	114,500	89.45	10,242,025.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	12,800	177.00	2,265,600.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	59.55	4,347,150.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	8.49	9,449,370.00
SSY GROUP LTD	114,000	5.15	587,100.00
WUXI APPTec CO LTD-H	32,088	168.20	5,397,201.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	334,500	122.40	40,942,800.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	2.82	7,966,500.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,279,200	2.85	23,595,720.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	5.22	5,734,039.50
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	3.20	1,172,800.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.18	3,976,016.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,450,620	6.25	59,066,375.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	3.23	1,211,250.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	392,423	68.65	26,939,838.95
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	4.07	2,744,808.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.24	489,240.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,924,515	5.03	29,800,310.45
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.49	5,813,910.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.65	1,372,800.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	9.81	1,314,540.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.72	2,279,760.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.02	945,540.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	21.60	2,851,200.00

CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	20.75	5,156,375.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	8.30	1,992,000.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.50	930,300.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	7.15	2,553,980.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	11.40	1,545,840.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	805,000	15.92	12,815,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	26.75	7,934,050.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	13.84	2,546,892.16
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	28.35	2,732,940.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.93	2,751,270.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.59	5,231,695.92
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	629,500	81.45	51,272,775.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	41.45	1,894,265.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	10.84	1,539,280.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	7.50	945,000.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	11.54	2,146,440.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	3.05	1,762,900.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	331,540	19.20	6,365,568.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	8.05	644,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	317,111	36.25	11,495,273.75
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	32,000	43.95	1,406,400.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	25.75	4,593,800.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.89	1,901,640.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	800,964	9.55	7,649,206.20
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	8.86	642,350.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	9.67	1,307,384.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	60,000	34.70	2,082,000.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.37	525,720.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	11.96	1,823,900.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	12.46	1,869,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	45.60	8,983,200.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	59.00	472,000.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	178,000	8.03	1,429,340.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	8.07	1,646,280.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.63	883,680.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	22.50	2,981,250.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	20.80	1,560,000.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	28.95	7,266,450.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	64,000	22.80	1,459,200.00
WHARF HOLDINGS	100,000	28.05	2,805,000.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.89	1,092,420.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	4.90	641,900.00

	CHINA YOUZAN LTD	1,456,000	1.64	2,387,840.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	28.15	6,812,300.00	
	KINGSOFT CORP LTD	92,000	53.05	4,880,600.00	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	32,000	39.30	1,257,600.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	15.84	1,251,360.00	
	WEIMOB INC	149,000	17.20	2,562,800.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	54.40	3,889,600.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	51.65	3,124,825.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	41.90	2,807,300.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	17.16	1,184,040.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	9.12	6,675,840.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	70,500	194.10	13,684,050.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	27.90	39,221,820.00	
	ZTE CORP-H	82,908	22.10	1,832,266.80	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.09	4,976,940.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.55	1,639,225.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.04	1,854,400.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.71	1,352,610.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	305,600	29.45	8,999,920.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	11.18	3,790,020.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.66	1,105,560.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	48.55	5,146,300.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	9.98	1,750,492.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	73,300	141.90	10,401,270.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	11.24	3,596,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	2.87	1,061,900.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	6.94	2,498,400.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	23.10	1,478,400.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	41.80	1,881,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	428,273	13.48	5,773,120.04	
	香港ドル 小計	90,492,362		1,740,394,272.53 (24,591,771,070)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.92	1,207,910.56	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	18.72	469,872.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.05	2,172,695.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	5.10	1,471,860.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	8.01	305,982.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.25	756,778.50	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.09	649,157.46	
	MISC BHD	125,040	6.82	852,772.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.30	301,000.00	

	GENTING BHD	188,500	5.14	968,890.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.97	1,098,009.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	26.30	152,540.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.02	1,086,766.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,146	21.76	764,776.96	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	134.80	970,560.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	18.64	1,369,667.20	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.97	745,056.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.25	1,049,945.50	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	181,300	8.43	1,528,359.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.39	1,235,927.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	128,200	3.70	474,340.00	
	SUPERMAX CORP BHD	161,715	3.87	625,837.05	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	4.84	2,443,716.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	30,500	3.00	91,500.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	635,119	4.65	2,953,303.35	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	18.84	1,154,741.28	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	18.20	302,720.60	
	MALAYAN BANKING BHD	411,105	8.20	3,371,061.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,481,600	4.20	6,222,720.00	
	RHB BANK BHD	206,419	5.38	1,110,534.22	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.85	1,098,362.65	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.21	1,312,257.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.55	1,218,945.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.09	429,661.68	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.24	1,226,120.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	225,575	9.93	2,239,959.75	
	マレーシアリングット 小計	8,280,059		45,434,305.36 (1,208,716,086)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	121.00	16,262,400.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	40.75	48,794,050.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	58.50	7,025,850.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	43.25	8,926,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	62.25	14,002,141.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	56.50	5,683,900.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	424.00	34,344,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	64.75	27,719,475.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.35	6,821,950.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	9.55	7,730,725.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.10	4,132,530.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.50	12,151,723.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	37.75	6,878,050.00	

	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	14.70	6,924,214.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	30.75	8,886,750.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	35.25	6,260,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	592,000	60.75	35,964,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	134.00	6,204,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	326,300	27.25	8,891,675.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	37.25	2,458,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	18.00	3,328,200.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	907,200	22.00	19,958,400.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	133.00	4,362,400.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	43.50	3,201,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	120.50	6,253,950.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	11.20	4,912,880.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	105.00	9,313,500.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	18.70	3,087,370.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	72.50	7,358,750.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	62.25	5,590,050.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	74.50	5,684,350.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	55.50	12,559,650.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.30	7,237,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	28,000	578.00	16,184,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	173.50	20,767,950.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	64.25	15,657,725.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.18	3,057,280.62	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	43.75	2,336,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	176.50	2,982,850.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	129,400	63.75	8,249,250.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	75.00	5,115,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	34.75	10,014,950.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	51.25	2,782,875.00	
	タイパーツ 小計	12,714,866		456,060,164.62 (1,605,331,779)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	40.15	9,553,291.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	835.00	23,613,800.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	610.50	4,186,809.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	61.40	18,635,698.20	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	1,000.00	22,805,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	150.00	14,416,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	205.00	12,507,050.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	143.00	13,665,080.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	102,805	85.65	8,805,248.25	
	BDO UNIBANK INC	219,911	110.30	24,256,183.30	



	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	49.10	7,919,191.70	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.15	9,776,155.00	
	AYALA LAND INC	794,100	38.30	30,414,030.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,003,150	37.60	37,718,440.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	1,820.00	8,535,800.00	
	PLDT INC	10,460	1,312.00	13,723,520.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	275.40	8,016,894.00	
	フィリピンベソ 小計	5,533,289		268,548,690.45 (616,695,212)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,215.00	1,748,749,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,375.00	4,696,037,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,460.00	2,425,068,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	860.00	2,478,950,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,525.00	2,081,805,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	11,675.00	2,218,250,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	604,200	2,850.00	1,721,970,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	10,400.00	3,594,240,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	5,325.00	11,812,980,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	7,300.00	5,783,790,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	32,875.00	1,959,350,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,150.00	1,312,150,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,275.00	2,692,602,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	5,300.00	3,955,920,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,440.00	3,968,496,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,066,100	32,650.00	34,808,165,000.00	
	BANK MANDIRI	1,691,296	6,150.00	10,401,470,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	5,625.00	4,557,375,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,531,700	4,220.00	23,343,774,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,100,000	1,235.00	1,358,500,000.00	
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,789,600	3,390.00	16,236,744,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	3,250.00	3,497,325,000.00		
	インドネシアルピア 小計	30,120,196		146,653,711,900.00 (1,129,233,581)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	47,750.00	314,815,750.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	103,500.00	460,264,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	274,500.00	1,533,357,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	43,500.00	538,573,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	50,700.00	367,169,400.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	430,000.00	336,690,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	206,000.00	390,988,000.00	
	LG CHEM LTD	4,588	802,000.00	3,679,576,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	363,500.00	318,789,500.00	

LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	273,000.00	526,890,000.00
POSCO	7,515	333,500.00	2,506,252,500.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	141,500.00	474,025,000.00
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	748	253,000.00	189,244,000.00
SKC CO LTD	1,734	132,000.00	228,888,000.00
CJ CORP	1,230	109,000.00	134,070,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	50,300.00	216,692,400.00
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	17,992	26,100.00	469,591,200.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	42,800.00	289,328,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	56,900.00	555,799,200.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	5,180	73,000.00	378,140,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	34,800.00	248,437,200.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	138,000.00	600,852,000.00
LG CORP	9,026	97,900.00	883,645,400.00
SAMSUNG C&T CORP	8,727	140,000.00	1,221,780,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	21,200.00	392,539,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	7,050.00	418,107,300.00
SK HOLDINGS CO LTD	3,592	269,000.00	966,248,000.00
S-1 CORPORATION	840	82,500.00	69,300,000.00
CJ LOGISTICS	862	166,000.00	143,092,000.00
HMM CO LTD	25,309	43,750.00	1,107,268,750.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	192,500.00	305,305,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	16,389	34,000.00	557,226,000.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	6,460.00	192,094,560.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	52,700.00	372,378,200.00
HANON SYSTEMS	19,000	17,400.00	330,600,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,328	287,500.00	1,819,300,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	239,500.00	3,567,831,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	118,000.00	360,018,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	115,500.00	398,359,500.00
KIA CORP	26,820	90,300.00	2,421,846,000.00
COWAY CO LTD	5,058	78,300.00	396,041,400.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	54,600.00	222,768,000.00
HLB INC	10,012	32,900.00	329,394,800.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	150,500.00	1,658,359,500.00
KANGWON LAND INC	7,703	28,450.00	219,150,350.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	24,750.00	125,482,500.00
HYBE CO LTD	841	262,000.00	220,342,000.00
KAKAO CORP	30,701	129,000.00	3,960,429,000.00
NAVER CORP	12,477	358,500.00	4,473,004,500.00
NCSOFT CORPORATION	1,643	858,000.00	1,409,694,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	138,500.00	341,402,500.00

PEARL ABYSS CORP	4,605	59,200.00	272,616,000.00
CJ ENM CO LTD	830	165,400.00	137,282,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	99,900.00	304,794,900.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	122,500.00	126,665,000.00
SHINSEGAE CO LTD	881	306,500.00	270,026,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	185,000.00	101,565,000.00
EMART	1,864	157,000.00	292,648,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	464,000.00	359,600,000.00
KT&G CORP	13,223	84,300.00	1,114,698,900.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,348	117,500.00	158,390,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	281,000.00	807,313,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,517,000.00	1,450,252,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	83	714,000.00	59,262,000.00
PACIFIC CORP	3,393	77,000.00	261,261,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,678	116,100.00	1,007,515,800.00
ALTEOGEN INC	2,841	71,600.00	203,415,600.00
CELLTRION INC	9,922	261,500.00	2,594,603,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,911	135,800.00	259,513,800.00
GREEN CROSS CORP	564	324,500.00	183,018,000.00
HANMI PHARM CO LTD	499	328,000.00	163,672,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,638	834,000.00	1,366,092,000.00
SEEGENE INC	3,838	60,600.00	232,582,800.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	61,100.00	186,293,900.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,470	119,000.00	174,930,000.00
YUHAN CORPORATION	5,817	64,200.00	373,451,400.00
HANA FINANCIAL GROUP	29,188	46,050.00	1,344,107,400.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,850.00	307,380,500.00
KB FINANCIAL GROUP INC	38,842	56,900.00	2,210,109,800.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,219	42,150.00	1,905,980,850.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	11,550.00	686,139,300.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	106,500.00	490,113,000.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,405.00	211,017,120.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	9,810.00	304,257,150.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	12,850.00	155,574,950.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	45,600.00	263,385,600.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	50,200.00	211,291,800.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	219,500.00	682,206,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	82,500.00	611,902,500.00
DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	81,000.00	117,531,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	186,000.00	692,850,000.00
KMW CO LTD	1,901	53,500.00	101,703,500.00
LG DISPLAY CO LTD	24,071	23,050.00	554,836,550.00

	LG INNOTEK CO LTD	1,415	209,000.00	295,735,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	174,500.00	977,723,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	478,574	81,100.00	38,812,351,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	83,239	74,200.00	6,176,333,800.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,575	606,000.00	3,378,450,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	15,900.00	351,787,500.00	
	SK TELECOM	3,705	327,500.00	1,213,387,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	26,200.00	693,225,800.00	
	SK HYNIX INC	54,927	122,500.00	6,728,557,500.00	
	韓国ウォン 小計	1,567,557		125,580,842,730.00 (12,357,154,924)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	110.00	12,346,400.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	50.60	11,849,305.60	
	CHINA STEEL	1,266,261	36.10	45,712,022.10	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	356,061	85.60	30,478,821.60	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	103.00	40,048,872.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	501,752	84.80	42,548,569.60	
	TAIWAN CEMENT	486,511	51.30	24,958,014.30	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	962.00	11,544,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	31.50	10,962,882.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	22,532	384.50	8,663,554.00	
	EVERGREEN MARINE	266,039	116.00	30,860,524.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	29.35	4,402,500.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	28,000	160.00	4,480,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	141,000	113.00	15,933,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	47.00	8,321,867.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	624.00	12,440,688.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	238.00	10,340,624.00	
	GIANT MANUFACTURING	34,464	316.50	10,907,856.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	404.00	6,464,000.00	
	POU CHEN	273,780	37.35	10,225,683.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	568.00	17,040,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	264.00	15,719,616.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	494,395	73.30	36,239,153.50	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	211.50	4,230,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	16.75	9,745,920.50	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,786,237	22.45	40,101,020.65	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,122,970	25.70	28,860,329.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,002,216	22.10	22,148,973.60	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	772,097	18.20	14,052,165.40	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,056,339	32.95	34,806,370.05	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	13.60	15,733,690.40	

TAISHIN FINANCIAL HOLDING	965,570	15.15	14,628,385.50
TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	9.48	4,744,275.48
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	823,289	20.95	17,247,904.55
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	45.00	14,888,745.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,302	203.00	27,872,306.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	25.50	26,932,054.50
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	54.30	48,225,078.90
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	12.45	15,646,911.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	326,258	24.45	7,977,008.10
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	712,082	72.90	51,910,777.80
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	9.73	11,632,575.01
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	52.10	7,693,086.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	288.00	13,824,000.00
ACER INC	255,803	31.05	7,942,683.15
ADVANTECH CO LTD	29,336	326.50	9,578,204.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	386.00	27,827,512.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	23.85	22,540,396.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	178.00	12,406,600.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	22.30	17,282,500.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	22.95	9,908,892.00
DELTA ELECTRONICS INC	198,903	295.00	58,676,385.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	63.40	5,886,690.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,255,248	109.50	137,449,656.00
INVENTEC CO LTD	280,511	25.20	7,068,877.20
LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	2,950.00	26,668,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	65.30	14,722,015.60
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	169.00	10,140,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	361.50	7,591,500.00
PEGATRON CORP	200,474	72.70	14,574,459.80
QUANTA COMPUTER INC	286,270	85.10	24,361,577.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	54.10	6,930,210.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	127.00	12,700,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	205.50	5,548,500.00
WISTRON CORP	242,695	30.20	7,329,389.00
WIWYNN CORP	8,000	926.00	7,408,000.00
WPG HOLDINGS LTD	143,692	50.40	7,242,076.80
YAGEO CORPORATION	38,764	496.00	19,226,944.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	96.00	5,752,512.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	366,315	114.00	41,759,910.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	65.60	10,299,200.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	143,200	102.50	14,678,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	314,315	114.00	35,831,910.00

	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,410.00	4,230,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	873.00	20,952,000.00	
	MEDIATEK INC	152,804	967.00	147,761,468.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	77.20	8,878,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	513.00	29,777,085.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	476.50	5,526,923.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	69,770	103.50	7,221,195.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	497.50	25,344,640.00	
	SILERGY CORP	7,000	3,180.00	22,260,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,476,389	586.00	1,451,163,954.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,230,000	50.70	62,361,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	114.00	10,146,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	332.00	10,624,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	32.95	11,499,550.00	
	新台湾ドル 小計	32,954,802		3,262,467,945.69 (12,889,358,359)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	485.05	32,071,506.00	
	COAL INDIA LTD	84,540	156.40	13,222,056.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	300.35	17,848,298.75	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	114.95	22,273,286.75	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	124.05	31,348,551.45	
	PETRONET LNG LTD	83,779	228.30	19,126,745.70	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	285,779	2,175.00	621,569,325.00	
	ACC LTD	5,315	2,004.40	10,653,386.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	334.35	24,585,758.55	
	ASIAN PAINTS LTD	37,699	2,943.55	110,968,891.45	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	802.50	23,632,822.50	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,492.05	47,042,844.45	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	147,807	383.15	56,632,252.05	
	JSW STEEL LTD	80,284	697.85	56,026,189.40	
	PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,812.15	22,910,586.05	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	2,076.05	25,468,981.40	
	SHREE CEMENT LTD	901	28,407.35	25,595,022.35	
	TATA STEEL LTD	67,202	1,101.00	73,989,402.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	9,760	6,724.75	65,633,560.00	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	845.55	45,832,192.20	
	VEDANTA LTD	147,245	269.95	39,748,787.75	
	ADANI ENTERPRISES LTD	26,979	1,594.65	43,022,062.35	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	116,287	150.70	17,524,450.90	
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,027.25	24,115,721.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	71,836	1,519.30	109,140,434.80	
	SIEMENS INDIA LTD	5,926	2,079.95	12,325,783.70	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	45,467	852.60	38,765,164.20
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	706.80	18,698,394.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,793.05	14,989,898.00
BAJAJ AUTO LTD	5,820	4,224.50	24,586,590.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,248.75	19,858,711.25
BHARAT FORGE LTD	30,322	756.30	22,932,528.60
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,729.05	40,076,099.25
HERO MOTOCORP LTD	12,238	3,023.50	37,001,593.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	83,591	804.45	67,244,779.95
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,994	7,239.00	101,302,566.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	247.20	30,758,107.20
MRF LTD	133	80,228.15	10,670,343.95
TATA MOTORS LTD	190,082	343.35	65,264,654.70
PAGE INDUSTRIES LTD	601	30,178.90	18,137,518.90
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	1,730.75	56,924,367.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	3,163.00	27,790,118.00
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	4,677.35	36,740,584.25
TRENT LTD	19,255	844.85	16,267,586.75
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	3,194.70	55,983,922.80
ITC LTD	289,062	212.50	61,425,675.00
NESTLE INDIA LIMITED	3,198	17,557.15	56,147,765.70
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	702.85	42,882,987.05
UNITED SPIRITS LTD	32,483	632.60	20,548,745.80
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,700.25	16,264,591.50
DABUR INDIA LTD	58,111	558.60	32,460,804.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	853.25	32,819,408.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	83,473	2,356.00	196,662,388.00
MARICO LTD	42,465	487.30	20,693,194.50
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	3,305.90	33,435,872.60
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	958.95	33,961,214.25
BIOCON LTD	58,256	404.50	23,564,552.00
CIPLA LTD	49,816	958.65	47,756,108.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,267.45	63,081,445.90
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	5,222.80	66,037,083.20
IPCA LABORATORIES LTD	9,167	2,039.60	18,697,013.20
LUPIN LTD	26,552	1,219.85	32,389,457.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	78,858	672.85	53,059,605.30
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,798.65	17,099,751.50
AXIS BANK LTD	229,173	736.75	168,843,207.75
BANDHAN BANK LTD	74,811	317.50	23,752,492.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	170,867	2,544.75	434,813,798.25
ICICI BANK LTD	511,368	636.10	325,281,184.80

	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	56,150	1,782.90	100,109,835.00	
	STATE BANK OF INDIA	187,504	421.45	79,023,560.80	
	YES BANK LTD	1,020,164	14.20	14,486,328.80	
	BAJAJ FINANCE LTD	28,025	5,674.50	159,027,862.50	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	555.80	21,422,199.40	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	3,029.70	12,406,621.50	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,469.10	18,250,629.30	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	2,128.45	24,949,690.90	
	REC LTD	48,168	163.95	7,897,143.60	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	17,588	1,105.20	19,438,257.60	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,437.05	30,488,452.80	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	11,558.85	44,940,808.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	74,097	684.90	50,749,035.30	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,473.90	34,695,606.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	571.15	18,123,731.80	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	41,424	998.60	41,366,006.40	
	DLF LTD	56,420	297.85	16,804,697.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	109,406	971.30	106,266,047.80	
	INFOSYS LTD	342,781	1,415.30	485,137,949.30	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	3,936.50	22,658,494.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	94,235	3,200.25	301,575,558.75	
	TECH MAHINDRA LTD	62,414	1,052.25	65,675,131.50	
	WIPRO LTD	144,908	544.20	78,858,933.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	241,735	540.00	130,536,900.00	
	INDUS TOWERS LTD	90,578	251.30	22,762,251.40	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,239.15	52,763,007.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,949	1,588.20	42,800,401.80	
	ADANI TRANSMISSION LTD	27,228	1,571.50	42,788,802.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	162.40	28,382,323.20	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	531.80	14,211,823.20	
	NTPC LTD	513,123	118.10	60,599,826.30	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	242.10	48,750,466.50	
	インドルピー 小計	8,314,296		6,315,929,157.70 (9,537,053,028)	
パキスタンル ピー	LUCKY CEMENT	31,357	914.28	28,669,077.96	
	HABIB BANK LTD	66,500	132.63	8,819,895.00	
	MCB BANK LTD	53,300	165.28	8,809,424.00	
	パキスタンルピー 小計	151,157		46,298,396.96 (32,871,861)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	21,829	17.74	387,246.46	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.04	902,202.08	
	MESAI EED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.91	851,448.15	



	INDUSTRIES QATAR	196,788	12.70	2,499,207.60	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	5.34	1,089,306.60	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.44	1,805,850.68	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	9.57	944,096.66	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	17.30	1,976,179.00	
	QATAR NATIONAL BANK	448,253	17.55	7,866,840.15	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.14	651,518.60	
	OORED00 QSC	72,800	7.00	509,600.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	16.50	1,029,946.50	
	カタールリアル 小計	2,573,602		20,513,442.48 (610,890,317)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	156.96	3,534,739.20	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	5,158	252.00	1,299,816.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,680.10	10,280,531.90	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,424	297.13	11,714,053.12	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	149.01	14,469,169.02	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	63.44	3,571,735.44	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	79,345	246.77	19,579,965.65	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	604.02	3,244,795.44	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	218.92	7,432,334.00	
	SASOL LTD	57,207	230.81	13,203,947.67	
	SIBANYE STILLWATER LTD	266,701	64.90	17,308,894.90	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	199.62	5,529,873.24	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	137.20	5,560,578.80	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	224.17	6,391,086.70	
	NASPERS LTD-N SHS	43,648	2,939.50	128,303,296.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	54.81	6,056,230.95	
	BID CORP LTD	35,017	308.49	10,802,394.33	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	258.83	6,967,962.43	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,265	157.60	6,976,164.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	190.67	4,437,653.58	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	219.76	2,861,934.48	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	165.16	6,151,219.04	
	ABSA GROUP LTD	73,296	148.03	10,850,006.88	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,544	1,730.00	14,781,120.00	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	177.80	6,762,978.60	
	STANDARD BANK GROUP LTD	127,912	139.33	17,821,978.96	
FIRSTRAND LTD	509,757	57.62	29,372,198.34		
REINET INVESTMENTS SCA	17,187	285.42	4,905,513.54		
REMGRO LTD	55,441	122.65	6,799,838.65		
DISCOVERY LIMITED	48,488	140.00	6,788,320.00		
OLD MUTUAL LTD	489,612	13.85	6,781,126.20		

	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	34.04	3,447,162.72	
	SANLAM LTD	167,172	64.00	10,699,008.00	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	33,499	97.63	3,270,507.37	
	MTN GROUP LTD	173,000	106.00	18,338,000.00	
	VODACOM GROUP	62,331	134.36	8,374,793.16	
	南アフリカランド 小計	3,005,371		444,670,928.31 (3,548,474,007)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	271,405	4.42	1,199,610.10	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	227,621	7.50	1,707,157.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	61,141	5.59	341,778.19	
	DUBAI ISLAMIC BANK	215,945	5.00	1,079,725.00	
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	13.55	3,594,760.80	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	445,149	16.92	7,531,921.08	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	3.81	1,400,323.59	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.06	1,563,262.40	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	174,383	22.12	3,857,351.96	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	2,413,519		22,275,890.62 (666,049,129)	
クウェートディ ナール	AGILITY	142,931	0.92	132,211.17	
	BOUBYAN BANK K.S.C	130,019	0.69	90,623.24	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	443,151	0.74	331,476.94	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	660,861	0.83	554,462.37	
	MABANEE CO KPSC	67,003	0.72	48,778.18	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.59	127,495.00	
	クウェートディナール 小計	1,658,965		1,285,046.90 (469,530,436)	
香港・オフショ ア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	90,900	5.18	470,862.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	20.54	410,800.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	4.89	489,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	12.37	473,771.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	12.98	1,139,644.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	15.44	944,928.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.19	852,717.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	48.80	1,436,672.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	7.94	307,278.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	21.36	1,140,624.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	119.00	952,000.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5,000	27.65	138,250.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	27.70	1,027,670.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	20.79	207,900.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.62	746,820.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	6.06	363,600.00	

JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	66,900	17.40	1,164,060.00
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	9.80	377,986.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	21.03	639,312.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	15,300	36.31	555,543.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.30	506,230.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	18.26	884,697.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	20.21	146,562.92
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	33.88	607,807.20
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.83	1,097,678.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	5,100	50.98	259,998.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	112.13	627,928.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	92.50	555,000.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	13.06	53,546.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	22.92	224,616.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.78	625,116.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	114.80	2,009,000.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	70.00	645,400.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	11.02	1,226,526.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	170.00	1,768,000.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	96.00	547,200.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	13.85	326,860.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	9.28	315,520.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	55.76	635,664.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	27.31	464,270.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	11,100	79.29	880,119.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	46.78	392,952.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	96,600	7.01	677,166.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	110,200	4.11	452,922.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	4.89	1,031,301.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	409.37	5,485,558.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	99.01	749,802.73
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	139,400	8.29	1,155,626.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	36.55	211,990.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	180.84	1,139,292.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	49.18	668,848.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	79.21	907,429.76
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	30.92	1,502,712.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	3.86	629,952.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	30.12	1,262,028.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	10,650	60.80	647,520.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	154,700	6.83	1,056,601.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	85.90	859,000.00

SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	8.03	181,478.00
TBEA CO LTD-A	99,019	11.34	1,122,875.46
WEICHAH POWER CO LTD-A	43,200	17.48	755,136.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.92	239,723.12
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	28,280	41.30	1,167,964.00
YUTONG BUS CO LTD-A	44,300	13.19	584,317.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	30.81	973,596.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	60.77	501,960.20
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	21.46	1,012,697.40
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	10.03	803,403.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.17	577,902.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	83.21	915,310.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.37	216,783.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	5.76	614,592.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.18	207,200.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	6.84	836,532.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	31,000	11.86	367,660.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	71.88	1,459,164.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	48.85	259,833.15
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.69	208,236.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	62.23	516,509.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	13.76	300,518.40
BYD CO LTD -A	4,700	202.00	949,400.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	23,820	22.53	536,664.60
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	56.15	1,038,775.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	24.99	857,157.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	17.25	505,425.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	20.02	852,852.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	179.19	501,732.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	43.89	1,218,386.40
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	81.20	495,482.40
MIDEA GROUP CO LTD-A	11,600	75.59	876,844.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	13.81	458,492.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	147.94	1,139,138.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	28.53	741,780.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	3,000	25.37	76,110.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	7.54	769,080.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	68.89	551,120.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	8.24	653,432.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	17.37	581,547.60
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	12.61	675,896.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	12.55	213,350.00

FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	9.71	1,353,574.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	69.59	1,134,317.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	9.43	155,595.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	82,360	8.93	735,474.80
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	22.03	502,284.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	26.00	637,000.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	7.02	431,730.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	312.80	3,816,160.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	19.88	337,960.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	6.54	299,532.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	12,900	67.75	873,975.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	54.80	471,280.00
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	60,340	21.40	1,291,276.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	60.29	611,340.60
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	5.44	220,320.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	57.41	614,287.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	235.97	377,552.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	64.33	141,526.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	8.02	477,190.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	51.20	527,360.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	49.16	491,600.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	172.49	1,362,671.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	38.81	178,526.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	18,408	135.80	2,499,806.40
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	3,000	227.53	682,590.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	26.40	723,360.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	76.00	1,292,000.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	34.05	40,860.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	39.82	1,365,905.64
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	55.72	963,956.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	228.10	2,075,710.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	12.51	346,527.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	46.12	530,380.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	80.15	561,050.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	2,199.50	16,716,200.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	262.20	2,569,560.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	65.00	2,181,270.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	14.68	393,424.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	14,000	28.89	404,460.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	466.00	3,122,200.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	34.50	1,090,200.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	14.77	563,623.20

WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	296.50	6,285,800.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	92.55	934,755.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	16.27	86,231.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	34.49	1,024,353.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	17,914	85.86	1,538,096.04
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	78.11	507,715.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	34.12	1,149,844.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	143.53	407,338.14
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	45.62	443,426.40
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	5,250	101.16	531,090.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	90.38	1,116,193.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	33.98	611,640.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	16.83	175,032.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	30.90	457,320.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	11.12	276,220.80
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	106.80	769,921.20
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	478.99	2,538,647.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	382.70	765,400.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	15.38	581,825.40
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	376.90	75,380.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	32.18	753,012.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	123.11	677,105.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	410.99	904,178.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	26.14	266,628.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	182.00	1,801,800.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	37.09	823,138.37
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	30.87	493,920.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	184.70	1,477,600.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	38.52	726,102.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	31,752	84.15	2,671,930.80
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	16,380	44.78	733,496.40
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.42	475,622.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	164.38	1,117,784.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	34.76	243,320.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	42,600	29.47	1,255,422.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	20.50	230,256.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	12.67	247,065.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	63.60	1,081,200.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	145.87	2,401,603.68
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	18.47	482,067.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	112.34	797,614.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	391.13	1,525,407.00

ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	20.96	189,059.20
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	29,040	32.00	929,280.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	70.05	679,485.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.35	1,184,560.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.94	286,520.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.89	483,621.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	7.76	583,086.40
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	10.13	511,565.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	41.56	997,440.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.45	384,475.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.79	848,071.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.83	493,687.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	56.47	5,923,703.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	4.67	1,277,712.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	4.01	1,237,486.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.35	758,190.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.19	1,355,628.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	21.96	2,090,592.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	24.65	2,943,210.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.35	757,025.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	10.21	1,412,043.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	122,500	3.97	486,325.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	16.30	1,294,220.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	10.86	478,926.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	7.49	149,051.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	10.23	477,741.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	19.95	571,767.00
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	25.73	1,111,536.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	32.32	778,912.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	41,880	30.40	1,273,152.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	17.85	64,260.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	7.09	426,818.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	9.63	797,364.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	15.64	947,784.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	94,200	12.93	1,218,006.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.87	1,196,633.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	111.45	601,830.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	6.22	269,948.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	16.31	513,765.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	9.85	865,815.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	9.15	390,705.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	9.71	307,807.00

SDIC CAPITAL CO LTD-A	45,800	14.03	642,574.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.70	973,840.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	5.14	585,960.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	4.89	462,594.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	13.19	576,403.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	34.27	623,714.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	70.30	4,696,040.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	5.24	95,368.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	11.31	618,657.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	25.91	1,391,367.00
GEMDALE CORP-A	45,500	10.70	486,850.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	5.88	691,488.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	6.30	443,268.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	13.15	1,075,670.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	45.75	585,600.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	19.20	163,200.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	140,000	3.21	449,400.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	11.90	320,110.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	13,500	38.71	522,585.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	15.34	441,792.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	60.37	404,479.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	78,400	17.62	1,381,408.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	8.02	446,714.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	89.00	809,900.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	59.15	638,820.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	258.00	774,000.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	49.06	299,756.60
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	136.60	751,300.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	33.95	447,121.50
ADDSINO CO LTD -A	5,800	18.92	109,736.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	79.62	1,066,908.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	6.06	694,476.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	37.56	1,051,680.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	14.64	509,472.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	18.41	382,928.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	12.54	565,554.00
GOERTEK INC -A	26,900	37.68	1,013,592.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	8.08	404,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	128.05	896,350.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	29.55	582,489.60
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	27.35	459,480.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	40.90	1,899,805.00



MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	453.00	489,240.00		
NINESTAR CORP-A	18,543	26.95	499,733.85		
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	8.78	274,814.00		
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	22.69	551,367.00		
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	92.35	439,586.00		
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	17.92	421,120.00		
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	28.39	380,426.00		
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	18.43	525,255.00		
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	13.80	648,600.00		
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	22.23	407,698.20		
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	15.92	44,576.00		
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	89.69	376,698.00		
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	29,512	26.79	790,626.48		
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	23,360	57.37	1,340,163.20		
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	79.38	893,025.00		
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	21.31	645,693.00		
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	39.53	343,911.00		
ZTE CORP-A	12,600	32.94	415,044.00		
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	5.09	884,642.00		
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	20.32	2,722,880.00		
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	9.67	653,692.00		
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	6.39	958,500.00		
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.16	260,700.00		
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	140.69	882,407.68		
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	43.38	325,350.00		
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	35.41	1,055,218.00		
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	24,000	97.12	2,330,880.00		
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	217.04	672,824.00		
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	30.03	1,219,218.00		
SG MICRO CORP-A	1,400	284.00	397,600.00		
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	127.45	331,370.00		
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	29.40	867,300.00		
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	13.20	432,300.00		
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	21.38	480,323.08		
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	143.80	704,620.00		
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	281.78	1,521,612.00		
香港・オフショア人民元 小計	13,359,447		268,396,308.50 (4,607,237,352)		
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	22.00	518,298.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	218,286	35.40	7,727,324.40	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	80.70	791,182.80	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	19.10	609,824.80	

NATIONAL PETROCHEMICAL CO	13,666	46.25	632,052.50	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,868	120.00	2,264,160.00	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	28.50	920,065.50	
SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	57.90	2,604,573.60	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	91,645	125.00	11,455,625.00	
SAUDI CEMENT	7,489	65.30	489,031.70	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	36.70	772,865.30	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	17.50	1,156,995.00	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	74.20	1,970,455.20	
JARIR MARKETING CO	7,199	211.00	1,518,989.00	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	129.40	482,015.00	
ALMARAI CO	30,130	62.60	1,886,138.00	
SAVOLA	25,336	43.35	1,098,315.60	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,778	167.00	463,926.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	4,029	187.00	753,423.00	
AL RAJHI BANK	124,491	105.00	13,071,555.00	
ALINMA BANK	109,956	20.24	2,225,509.44	
ARAB NATIONAL BANK	57,638	22.44	1,293,396.72	
BANK AL-JAZIRA	35,813	18.12	648,931.56	
BANK ALBILAD	45,859	37.00	1,696,783.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	48,656	37.35	1,817,301.60	
RIYAD BANK	138,943	26.00	3,612,518.00	
SAUDI BRITISH BANK	71,793	31.45	2,257,889.85	
THE SAUDI NATIONAL BANK	223,924	53.80	12,047,111.20	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	124.20	753,024.60	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	84.00	555,492.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	10.58	498,233.36	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	11.86	547,777.82	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	33.75	1,161,472.50	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	14.58	392,070.78	
SAUDI TELECOM CO	60,999	135.00	8,234,865.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	24.56	2,264,947.76	
サウジアラビアリアル 小計	1,856,991		91,194,140.59 (2,670,164,436)	
合 計	254,837,707		94,353,352,702 (94,353,352,702)	

## (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	5,897,232.00	

		メキシコペソ 小計	58,400	5,897,232.00 (32,756,764)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	3,085,084.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	31,500	2,047,185.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	2,071,008.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	796,620.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,658,928.00	
		ブラジルレアル 小計	183,900	9,658,825.00 (209,129,015)	
		投資信託受益証券合計	242,300	241,885,779 (241,885,779)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	7,244,316.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	7,244,316.00 (40,239,277)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	4,396,200.30	
		南アフリカランド 小計	295,047	4,396,200.30 (35,081,678)	
		投資証券合計	603,447	75,320,955 (75,320,955)	
		合計		317,206,734 (317,206,734)	

(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 72銘柄	100.0%			9.8%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.7%			1.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.4%	0.0%
ブラジルレアル	株式 49銘柄	95.8%			5.1%
	投資信託受 益証券 5銘柄		4.2%		0.2%
チリペソ	株式 13銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 4銘柄	100.0%			0.1%

イギリスポンド	株式	1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式	11銘柄	100.0%			0.2%
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	213銘柄	100.0%			26.0%
マレーシアリングギット	株式	36銘柄	100.0%			1.3%
タイバーツ	株式	43銘柄	100.0%			1.7%
フィリピンペソ	株式	17銘柄	100.0%			0.7%
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	102銘柄	100.0%			13.1%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			13.6%
インドルピー	株式	100銘柄	100.0%			10.1%
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.6%
南アフリカランド	株式	36銘柄	99.0%			3.7%
	投資証券	1銘柄			1.0%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			0.7%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%			0.5%
香港・オフショア人民元	株式	304銘柄	100.0%			4.9%
サウジアラビアリアル	株式	36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。

## 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 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	520,838,124

	2021年 6月10日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	726,352,485
国債証券	69,817,708,998
未収利息	1,261,541,721
前払費用	97,116,669
流動資産合計	72,423,557,997
資産合計	72,423,557,997
負債の部	
流動負債	
前受収益	123,573
未払解約金	46,506,841
未払利息	801
流動負債合計	46,631,215
負債合計	46,631,215
純資産の部	
元本等	
元本	40,073,966,944
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,302,959,838
元本等合計	72,376,926,782
純資産合計	72,376,926,782
負債純資産合計	72,423,557,997

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 6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>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		40,073,966,944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)	1.8061円 (18,061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 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

2021年 6月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	35,123,332,856円
期中追加設定元本額	7,403,979,640円
期中一部解約元本額	2,453,345,552円
期末元本額	40,073,966,944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	4,448,012,185円
世界経済インデックスファンド	7,866,733,237円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,901,372,206円
DC世界経済インデックスファンド	9,253,519,813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）	1,808,791,583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）	344,071,049円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	79,690,328円

区分	2021年 6月10日現在
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)	367,223,496円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,064,726,188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)	183,514,633円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	86,011,535円
SMT インデックスバランス・オープン	159,115,332円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	3,134,321,145円
SMT 世界経済インデックス・オープン	223,250,433円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	238,364,103円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	382,019,257円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,732,945円
グローバル経済コア	637,908,827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)	3,729,673円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	6,245,172円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,888,265円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,574,740円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,074,099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)	77,684,260円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	239,533,495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
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 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,243,884,429
合計	2,243,884,429

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	39,603,256.00		
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	113,967,207.50		
		MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000.00	115,231,203.00		
		MBONO 6.5% 06/09/22	108,200,000.00	110,183,306.00		
		MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000.00	95,404,854.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	115,437,365.50		
		MBONO 7.75% 05/29/31	60,400,000.00	66,107,196.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	77,000,000.00	81,371,290.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	35,088,684.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000.00	131,845,665.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	64,400,000.00	72,826,096.00		
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	78,947,370.00		
		MBONO 8% 11/07/47	69,100,000.00	74,865,704.00		
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	104,240,349.00		
	メキシコペソ 小計			1,149,050,000.00	1,235,119,546.00 (6,860,595,030)	
	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000.00	69,421,445.16		
		BLTN 0% 07/01/22	22,350,000.00	20,953,042.30		
		BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	44,223,907.84		
		BLTN 0% 07/01/24	13,500,000.00	10,696,891.05		
		BNTNF 10% 01/01/23	46,650,000.00	48,618,184.48		
		BNTNF 10% 01/01/25	33,600,000.00	35,765,249.52		
		BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000.00	33,532,623.62		
		BNTNF 10% 01/01/29	17,400,000.00	18,579,327.63		
		BNTNF 10% 01/01/31	7,450,000.00	7,918,369.94		
BRAZIL 10.25% 01/10/28		1,400,000.00	1,470,875.00			
BRAZIL 8.5% 01/05/24		1,900,000.00	1,968,875.00			
ブラジルリアル 小計			310,650,000.00	293,148,791.54 (6,347,140,374)		
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	245,000,000.00	220,301,315.04			
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,535,715,356.72			

	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,812,437,027.05	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,480,000,000.00	1,531,969,491.08	
	BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	879,699,665.88	
	BTPCL 5% 03/01/35	1,890,000,000.00	1,930,945,685.76	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,480,000,000.00	1,677,429,972.40	
	チリペソ 小計	10,160,000,000.00	10,588,498,513.93 (1,612,723,620)	
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000.00	86,584,311,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	19,300,000,000.00	19,470,612,000.00	
	コロンビアペソ 小計	91,600,000,000.00	106,054,923,000.00 (3,239,341,568)	
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,548,285.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	4,600,000.00	4,412,320.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,200,000.00	3,574,912.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,970,000.00	7,729,730.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	6,887,475.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,450,000.00	7,328,619.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	7,464,091.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,450,000.00	7,432,915.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	7,143,182.00	
	ペルーヌエボソル 小計	50,520,000.00	55,521,530.00 (1,583,768,299)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	25,438,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	12,955,375.00	
	ウルグアイペソ 小計	37,500,000.00	38,393,375.00 (96,659,160)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,427,956.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	28,119,750.00	
	ドミニカペソ 小計	45,400,000.00	49,547,706.00 (95,265,374)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,318,000.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	6,249,192.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,950,000.00	7,610,456.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	6,850,000.00	6,329,400.00	
	TURKGB 11.7% 11/13/30	12,400,000.00	8,982,188.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	5,545,338.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	7,350,000.00	7,011,238.50	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,138,591.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,684,612.00	
	TURKGB 12.6% 10/01/25	8,100,000.00	6,740,658.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	7,100,000.00	6,888,775.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,216,742.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	3,750,000.00	3,366,112.50	

	TURKGB 8% 03/12/25	8,300,000.00	6,066,636.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	10,750,000.00	8,524,212.50	
トルコリラ 小計		115,350,000.00	94,672,152.50 (1,209,427,280)	
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	27,092,454.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	49,878,708.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	46,318,970.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,900,000.00	43,992,200.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	42,900,000.00	40,934,751.00	
	CZGB 1% 06/26/26	59,200,000.00	57,659,616.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	39,500,000.00	41,021,145.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	51,000,000.00	53,909,550.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	50,300,000.00	54,414,037.00	
	CZGB 2% 10/13/33	52,200,000.00	53,402,166.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	36,523,760.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	37,809,454.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	42,833,609.00	
	チェココルナ 小計		575,300,000.00	585,790,420.00 (3,078,680,131)
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	458,500,000.00	449,325,415.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	324,502,725.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	275,000,000.00	278,437,500.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	456,698,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	382,000,000.00	360,348,240.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	561,782,200.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	487,579,150.00	
	HGB 2% 05/23/29	173,000,000.00	168,848,000.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	587,000,000.00	623,669,890.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	418,314,225.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	581,129,400.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	621,380,960.00	
	HGB 3% 10/27/38	248,000,000.00	237,881,600.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	753,053,400.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	523,167,960.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	262,000,000.00	340,689,080.00	
HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	297,696,000.00		
ハンガリーフォリント 小計		7,162,000,000.00	7,484,503,995.00 (2,883,622,214)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	5,100,000.00	4,813,584.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	12,850,000.00	12,777,783.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	14,100,000.00	13,409,241.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,234,240.00	

	POLGB 2.25% 10/25/24	13,800,000.00	14,491,794.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,576,600.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	15,015,510.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	17,600,000.00	18,669,024.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	15,305,040.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000.00	15,360,424.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	15,050,000.00	16,309,384.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,448,330.00	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	11,755,432.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	11,617,854.50	
	ポーランドズロチ 小計	188,200,000.00	196,784,241.00	(5,868,991,595)
ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	195,500,000.00	180,065,275.00	
	RFLB 5.7% 05/17/28	219,000,000.00	203,959,080.00	
	RFLB 6.1% 07/18/35	192,000,000.00	172,894,080.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	149,280,120.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	156,682,280.00	
	RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	207,460,200.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	146,000,000.00	147,007,400.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	137,100,000.00	139,153,758.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	213,347,704.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	160,830,630.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	206,973,942.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	168,033,827.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	117,700,000.00	119,574,961.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	196,500,000.00	203,630,985.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	139,679,715.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	164,016,640.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	146,956,240.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	189,563,110.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	72,070,776.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	108,708,304.00	
RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	165,230,520.00		
RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	127,562,607.50		
	ロシアルーブル 小計	3,531,550,000.00	3,542,682,154.50	(5,349,450,053)
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	6,150,000.00	5,828,416.50	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,337,357.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,466,036.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	9,450,000.00	9,783,490.50	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,283,878.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,009,565.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	10,450,000.00	9,925,514.50	

	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,373,847.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,184,748.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000.00	28,643,292.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,666,540.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,590,718.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	3,400,000.00	3,596,656.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	27,499,420.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	8,500,000.00	8,968,095.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	5,900,000.00	5,681,346.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	8,027,956.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	5,850,000.00	6,325,078.50	
	マレーシアリングット 小計	188,500,000.00	195,191,955.00 (5,192,808,694)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	90,871,955.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	91,000,000.00	91,587,860.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	99,000,000.00	101,609,640.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	53,152,304.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	41,402,403.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	85,100,000.00	84,796,193.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	59,300,000.00	60,164,594.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	106,100,000.00	111,894,121.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	91,000,000.00	95,181,450.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	83,200,000.00	91,369,408.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	53,000,000.00	49,146,900.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	53,500,000.00	54,731,570.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000.00	201,486,037.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000.00	136,443,472.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,235,720.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	97,300,000.00	113,812,783.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	80,400,000.00	95,077,020.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	97,400,000.00	110,091,220.00	
THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	131,021,505.00		
	タイバーツ 小計	1,675,100,000.00	1,803,076,155.00 (6,346,828,065)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,134,400.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	24,087,200.00	
	フィリピンペソ 小計	35,000,000.00	39,221,600.00 (90,068,482)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,307,865,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,539,468,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	33,500,000,000.00	33,629,980,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	52,500,000,000.00	53,731,125,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	45,328,500,000.00	

	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,684,656,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	33,000,000,000.00	33,289,080,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	62,100,000,000.00	64,973,988,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	24,149,760,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,731,620,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,300,000,000.00	20,252,841,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	28,691,104,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,266,560,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,047,005,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	39,165,504,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,580,120,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	38,846,720,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,704,344,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,413,116,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,400,000,000.00	20,573,776,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	50,907,238,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	58,548,360,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,936,708,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	32,872,524,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	40,468,528,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,771,200,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	23,009,797,000.00	
	インドネシアルピア 小計	852,700,000,000.00	916,421,487,000.00 (7,056,445,449)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	121,100,000.00	139,530,209.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	43,600,000.00	31,477,456.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	23,293,710.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	44,900,000.00	46,882,784.00	
	SAGB 7% 02/28/31	40,200,000.00	35,065,656.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	55,200,000.00	51,167,640.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	59,838,387.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	58,576,980.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	93,600,000.00	80,528,760.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	56,856,550.00	
	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000.00	91,364,392.00	
	SAGB 9% 01/31/40	48,450,000.00	43,224,667.50	
		南アフリカランド 小計	774,950,000.00	717,807,191.50 (5,728,101,388)
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,292,000.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	17,859,600.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,227,110.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	4,700,000.00	4,702,538.00	

	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000.00	30,121,495.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	16,932,110.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000.00	34,092,820.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,053,760.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	8,000,000.00	8,022,320.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,102,000.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,680,956.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000.00	29,734,572.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,141,960.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,275,000.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,070,456.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,262,240.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,243,000.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,194,740.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,228,320.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	3,500,000.00	3,559,500.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	23,700,000.00	24,348,432.00	
	香港・オフショア人民元 小計	417,600,000.00	418,144,929.00 (7,177,792,222)	
	合計		69,817,708,998 (69,817,708,998)	

## 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%	9.8%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	9.1%
チリペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	2.3%
コロンビアペソ	国債証券 2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%	1.7%
チェココルナ	国債証券 13銘柄	100.0%	4.4%
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%	8.4%
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%	7.4%

タイパーツ	国債証券	19銘柄	100.0%	9.1%
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%	8.2%
香港・オフショア人民元	国債証券	21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

該当事項はありません。



## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 世界経済インデックス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2021年 6月30日現在)

資産総額	2,149,961,262円
負債総額	2,783,378円
純資産総額( - )	2,147,177,884円
発行済口数	1,653,099,167口
1口当たり純資産額( / )	1.2989円
(1万口当たり純資産額)	(12,989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 6月30日現在)

資産総額	473,038,849,034円
負債総額	2,809,794,636円
純資産総額( - )	470,229,054,398円
発行済口数	250,523,513,225口
1口当たり純資産額( / )	1.8770円
(1万口当たり純資産額)	(18,770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 6月30日現在)

資産総額	644,370,509,488円
負債総額	9,879,162,459円
純資産総額( - )	634,491,347,029円
発行済口数	450,292,012,763口
1口当たり純資産額( / )	1.4091円
(1万口当たり純資産額)	(14,091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 6月30日現在)

資産総額	530,365,810,735円
負債総額	362,809,919円
純資産総額（ - ）	530,003,000,816円
発行済口数	137,578,868,713口
1口当たり純資産額（ / ）	3.8524円
（1万口当たり純資産額）	（38,524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 6月30日現在)

資産総額	308,028,448,106円
負債総額	97,158,285円
純資産総額（ - ）	307,931,289,821円
発行済口数	100,426,747,474口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0662円
（1万口当たり純資産額）	（30,662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 6月30日現在)

資産総額	102,586,680,939円
負債総額	52,465,787円
純資産総額（ - ）	102,534,215,152円
発行済口数	26,398,288,665口
1口当たり純資産額（ / ）	3.8841円
（1万口当たり純資産額）	（38,841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 6月30日現在)

資産総額	72,649,954,396円
負債総額	4,925,026円
純資産総額（ - ）	72,645,029,370円
発行済口数	40,620,327,990口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7884円
（1万口当たり純資産額）	（17,884円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)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 6月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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 9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6月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	526	14,842,977
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	76	281,570
単位型公社債投資信託	48	305,807
合計	650	15,430,355

## 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)	
		百万円		百万円
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 9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。
株式会社中国銀行	15,149	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。



株式会社東京スター銀行	26,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社トマト銀行	17,810	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。
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。
株式会社千葉興業銀行	62,120	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
野村証券株式会社	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。
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。

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
2020年 9月10日	有価証券届出書
2020年 9月10日	有価証券報告書
2021年 3月10日	有価証券届出書
2021年 3月10日	半期報告書

**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。

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8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 世界経済インデックス・オープンの2020年6月11日から2021年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 世界経済インデックス・オープンの2021年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。