

## 【表紙】

|                                          |                                      |
|------------------------------------------|--------------------------------------|
| 【提出書類】                                   | 訂正有価証券届出書                            |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿                              |
| 【提出日】                                    | 2021年9月7日提出                          |
| 【発行者名】                                   | 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社                        |
| 【代表者の役職氏名】                               | 取締役社長 横川 直                           |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都千代田区有楽町一丁目 1 2 番 1 号              |
| 【事務連絡者氏名】                                | 伊藤 晃                                 |
| 【電話番号】                                   | 03-6250-4740                         |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信            |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | 10兆円を上限とします。                         |
| 【縦覧に供する場所】                               | 株式会社東京証券取引所<br>（東京都中央区日本橋兜町 2 番 1 号） |

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年3月5日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

<訂正前> および<訂正後> に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、<更新後> に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

## 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

## １【ファンドの性格】

## （３）【ファンドの仕組み】

&lt; 訂正前 &gt;

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）

お申込金 ↓ ↑ 解約代金等

|      |                      |
|------|----------------------|
| 販売会社 | 募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。 |
|------|----------------------|

お申込金 ↓ ↑ 解約代金等

|                                                                              |  |
|------------------------------------------------------------------------------|--|
| <b>受託会社（受託者）</b><br><b>三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社</b><br>（再信託受託会社：日本マスタートラスト<br>信託銀行株式会社） |  |
| 信託財産の保管・管理等を行います。                                                            |  |

|                                          |
|------------------------------------------|
| <b>委託会社（委託者）</b><br><b>三菱ＵＦＪ国際投信株式会社</b> |
| 信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。                 |

投資 ↓ ↑ 損益

マザーファンド

投資 ↓ ↑ 損益

有価証券等

委託会社と関係法人との契約の概要

|                                      | 概要                                                                                                                      |
|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「信託契約」              | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。<br>なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約<br>「上場投資信託の取扱い等に関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い等に係る事務の内容等が定められています。                                                                                  |

委託会社の概況（2020年12月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月  
2004年10月

東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更

- 2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、  
商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
- 2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三  
菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更

## ・大株主の状況

| 株 主 名             | 住 所               | 所有株式数    | 所有比率   |
|-------------------|-------------------|----------|--------|
| 三菱ＵＦＪ信託銀行株式<br>会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目４番５号 | 211,581株 | 100.0% |

## &lt;訂正後&gt;

## 委託会社およびファンドの関係法人の役割

|          |
|----------|
| 投資家（受益者） |
|----------|

お申込金 ↓ ↑ 解約代金等

|      |                      |
|------|----------------------|
| 販売会社 | 募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。 |
|------|----------------------|

お申込金 ↓ ↑ 解約代金等

|                                                                              |
|------------------------------------------------------------------------------|
| <b>受託会社（受託者）</b><br><b>三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社</b><br>（再信託受託会社：日本マスタートラスト<br>信託銀行株式会社） |
| 信託財産の保管・管理等を行います。                                                            |

|                                          |
|------------------------------------------|
| <b>委託会社（委託者）</b><br><b>三菱ＵＦＪ国際投信株式会社</b> |
| 信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。                 |

投資 ↓ ↑ 損益

|         |
|---------|
| マザーファンド |
|---------|

投資 ↓ ↑ 損益

|       |
|-------|
| 有価証券等 |
|-------|

## 委託会社と関係法人との契約の概要

|                                      | 概要                                                                                                                      |
|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「信託契約」              | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。<br>なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約<br>「上場投資信託の取扱い等に関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い等に係る事務の内容等が定められています。                                                                                  |

## 委託会社の概況（2021年6月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に變更

2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、  
商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に變更

2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三  
菱ＵＦＪ国際投信株式会社に變更

・大株主の状況

| 株 主 名             | 住 所               | 所有株式数    | 所有比率   |
|-------------------|-------------------|----------|--------|
| 三菱ＵＦＪ信託銀行株式<br>会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目４番５号 | 211,581株 | 100.0% |

### ３【投資リスク】

<更新後>

#### （１）投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が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。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

#### 価格変動 リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

#### 為替変動 リスク

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。

#### 信用リスク

組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。

#### 流動性 リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

#### カントリー・ リスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

#### 留意事項

- ・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。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。

- ・ファンドは、換金時期に制限がありますのでご注意ください。
- ・ファンドは、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。
- ・ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格はファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

### トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

### コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

### リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

### 内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

## <流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

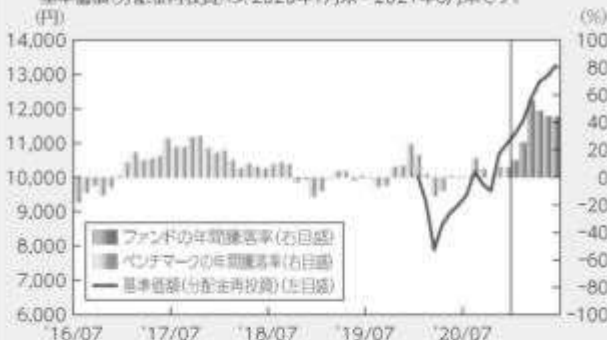
下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2021年1月～2021年6月です。

ベンチマークの年間騰落率は、2016年7月～2020年12月です。

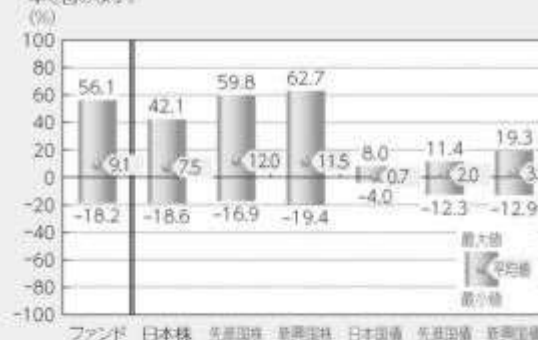
基準価額(分配金再投資)は、2020年1月末～2021年6月末です。



### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2016年7月末～2021年6月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2020年12月以前)の年間騰落率を含みます。



●基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額は異なる場合があります。

●年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

●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おり、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。

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名                           | 注記等                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 日本株   | 東証株価指数(TOPIX)<br>(配当込み)       | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。                                                                                                                           |
| 先進国株  | MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み)     | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                               |
| 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) | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                    |
| 日本国債  | NOMURA-BPI(国債)                | NOMURA-BPI(国債)とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して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<br>(除く日本)      | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。 |
| 新興国債  | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド   | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。                                                                                                                                       |

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

## &lt; 訂正前 &gt;

課税上は、上場証券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

## １．受益権の売却時

売却価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得として課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による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）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

## ２．収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

## ３．受益権の解約時および償還時

上記１．と同様の取扱いとなります。

売却時、解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

上場証券投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する（ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。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

## １．受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

## ２．収益分配金の受取り時

15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

## ３．受益権の解約時および償還時

源泉徴収はありません。上記１．と同様の取扱いとなります。

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

上記は2020年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上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。

## &lt; 訂正後 &gt;

課税上は、上場証券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

## １．受益権の売却時

売却価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得として課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による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）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

## 2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

## 3. 受益権の解約時および償還時

上記1.と同様の取扱いとなります。

売却時、解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限りです。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

上場証券投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する（ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。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

### 1. 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

### 2. 収益分配金の受取り時

15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

### 3. 受益権の解約時および償還時

源泉徴収はありません。上記1.と同様の取扱いとなります。

分配時において、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月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上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】

### 【MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

#### （1）【投資状況】

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 8,314,104,765 | 99.50   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 41,786,697    | 0.50    |
| 純資産総額                    |      | 8,355,891,462 | 100.00  |

（注）投資比率とは、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】

## a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 6月30日現在

| 国／<br>地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|-----------|--------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド  | 1,614,772,478 | 4.0895          | 6,603,612,049   | 4.1729          | 6,738,284,073   | 80.64           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックスマザーファンド | 319,716,317   | 3.3396          | 1,067,724,613   | 3.3756          | 1,079,234,399   | 12.92           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 日本株式インデックスマザーファンド  | 384,890,942   | 1.2989          | 499,934,845     | 1.2902          | 496,586,293     | 5.94            |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 6月30日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.50   |
| 合計        | 99.50   |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

## 【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】

下記計算期間末日および令和3年6月末日、同日前 1 年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                        | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1口当たりの純資産価額) |        | 東京証券取引所<br>取引価格 |
|------------------------|---------------|---------------|-----------------------|--------|-----------------|
|                        | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                 | (分配付)  |                 |
| 第1計算期間末日 (令和 2年 6月 8日) | 2,863,735,287 | 2,875,318,287 | 9,642                 | 9,681  | 9,630           |
| 第2計算期間末日 (令和 2年12月 8日) | 3,332,170,757 | 3,352,010,757 | 10,749                | 10,813 | 10,790          |
| 第3計算期間末日 (令和 3年 6月 8日) | 7,443,027,007 | 7,486,527,007 | 12,833                | 12,908 | 12,900          |

|            |               |   |        |   |        |
|------------|---------------|---|--------|---|--------|
| 令和 2年 6月末日 | 2,490,685,696 | — | 9,157  | — | 9,230  |
| 7月末日       | 2,163,457,913 | — | 9,447  | — | 9,570  |
| 8月末日       | 2,319,915,707 | — | 10,131 | — | 10,220 |
| 9月末日       | 3,025,664,505 | — | 9,760  | — | 9,760  |
| 10月末日      | 3,157,110,892 | — | 9,567  | — | 9,450  |
| 11月末日      | 3,297,584,762 | — | 10,637 | — | 10,630 |
| 12月末日      | 3,371,544,799 | — | 10,876 | — | 10,980 |
| 令和 3年 1月末日 | 4,018,979,315 | — | 11,164 | — | 11,080 |
| 2月末日       | 4,387,644,696 | — | 11,546 | — | 11,550 |
| 3月末日       | 5,730,554,164 | — | 12,193 | — | 12,250 |
| 4月末日       | 6,393,103,676 | — | 12,660 | — | 12,630 |
| 5月末日       | 7,441,150,685 | — | 12,830 | — | 12,880 |
| 6月末日       | 8,355,891,462 | — | 13,056 | — | 13,150 |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たりの分配金 |
|--------|-----------|
| 第1計算期間 | 39円00銭    |
| 第2計算期間 | 64円00銭    |
| 第3計算期間 | 75円00銭    |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 3.19   |
| 第2計算期間 | 12.14  |
| 第3計算期間 | 20.08  |

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

## （４）【設定及び解約の実績】

|        | 設定口数    | 解約口数    | 発行済口数   |
|--------|---------|---------|---------|
| 第1計算期間 | 297,000 | —       | 297,000 |
| 第2計算期間 | 123,000 | 110,000 | 310,000 |
| 第3計算期間 | 270,000 | —       | 580,000 |

## （参考）

外国株式インデックスマザーファンド

## 投資状況

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域     | 時価合計              | 投資比率（％） |
|--------------------------|----------|-------------------|---------|
| 株式                       | アメリカ     | 725,478,500,688   | 67.38   |
|                          | イギリス     | 45,164,207,002    | 4.19    |
|                          | カナダ      | 36,519,463,001    | 3.39    |
|                          | フランス     | 34,373,999,761    | 3.19    |
|                          | スイス      | 32,027,403,753    | 2.97    |
|                          | ドイツ      | 30,445,990,713    | 2.83    |
|                          | オーストラリア  | 21,845,348,887    | 2.03    |
|                          | オランダ     | 18,221,343,010    | 1.69    |
|                          | スウェーデン   | 12,279,413,028    | 1.14    |
|                          | 香港       | 9,509,101,257     | 0.88    |
|                          | デンマーク    | 8,432,236,142     | 0.78    |
|                          | スペイン     | 8,137,815,733     | 0.76    |
|                          | イタリア     | 6,098,253,265     | 0.57    |
|                          | フィンランド   | 3,456,257,645     | 0.32    |
|                          | シンガポール   | 2,889,238,238     | 0.27    |
|                          | ベルギー     | 2,837,742,453     | 0.26    |
|                          | アイルランド   | 2,297,970,670     | 0.21    |
|                          | ノルウェー    | 2,070,659,523     | 0.19    |
|                          | イスラエル    | 1,090,887,274     | 0.10    |
|                          | ルクセンブルグ  | 1,058,730,975     | 0.10    |
|                          | ニュージーランド | 751,020,318       | 0.07    |
|                          | オーストリア   | 652,336,017       | 0.06    |
|                          | ポルトガル    | 476,299,383       | 0.04    |
|                          | 小計       | 1,006,114,218,736 | 93.44   |
| 投資証券                     | アメリカ     | 19,440,068,406    | 1.81    |
|                          | オーストラリア  | 1,433,637,249     | 0.13    |
|                          | イギリス     | 572,895,353       | 0.05    |
|                          | シンガポール   | 421,821,064       | 0.04    |
|                          | 香港       | 393,784,344       | 0.04    |
|                          | フランス     | 319,579,484       | 0.03    |
|                          | オランダ     | 217,885,668       | 0.02    |
|                          | カナダ      | 137,890,712       | 0.01    |
|                          | 小計       | 22,937,562,280    | 2.13    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 47,654,019,477    | 4.43    |
| 純資産総額                    |          | 1,076,705,800,493 | 100.00  |

（注）投資比率とは、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

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国 / 地域  | 時価合計           | 投資比率（％） |
|----------|----|---------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ    | 33,855,504,540 | 3.14    |
|          | 買建 | カナダ     | 1,803,254,880  | 0.17    |
|          | 買建 | ドイツ     | 6,124,733,208  | 0.57    |
|          | 買建 | オーストラリア | 1,545,325,480  | 0.14    |
|          | 買建 | イギリス    | 3,257,805,096  | 0.30    |
|          | 買建 | スイス     | 1,385,511,456  | 0.13    |

（注）投資比率とは、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

a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 6月30日現在

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名                         | 業種                     | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|----|-----------------------------|------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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     | 2,894,025 | 13,915.53       | 40,271,904,167  | 15,075.37       | 43,628,501,716  | 4.05            |
| アメリカ   | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | 1,235,229 | 27,223.44       | 33,627,194,610  | 30,011.41       | 37,070,966,433  | 3.44            |
| アメリカ   | 株式 | AMAZON.COM INC              | 小売                     | 73,784    | 356,291.45      | 26,288,608,679  | 381,295.32      | 28,133,493,979  | 2.61            |
| アメリカ   | 株式 | ALPHABET INC-CL A           | メディア・娯楽                | 71,121    | 251,094.19      | 17,858,070,092  | 270,417.86      | 19,232,388,692  | 1.79            |
| アメリカ   | 株式 | FACEBOOK INC-CLASS A        | メディア・娯楽                | 414,465   | 33,947.81       | 14,070,182,097  | 38,911.99       | 16,127,660,505  | 1.50            |
| アメリカ   | 株式 | TESLA INC                   | 自動車・自動車部品              | 132,382   | 68,154.44       | 9,022,422,114   | 75,278.44       | 9,965,510,550   | 0.93            |
| アメリカ   | 株式 | NVIDIA CORP                 | 半導体・半導体製造装置            | 106,713   | 63,559.11       | 6,782,583,876   | 88,582.32       | 9,452,885,178   | 0.88            |
| アメリカ   | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO         | 銀行                     | 525,799   | 17,549.46       | 9,227,489,894   | 17,044.80       | 8,962,139,426   | 0.83            |
| アメリカ   | 株式 | ALPHABET INC-CL C           | メディア・娯楽                | 31,946    | 255,708.78      | 8,168,872,720   | 278,702.51      | 8,903,430,531   | 0.83            |
| 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 | 453,133   | 18,664.04       | 8,457,295,117   | 18,138.43       | 8,219,124,554   | 0.76            |
| アメリカ   | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES     | ソフトウェア・サービス            | 292,239   | 24,934.93       | 7,286,961,246   | 26,091.35       | 7,624,910,325   | 0.71            |
| アメリカ   | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融                   | 236,089   | 31,595.84       | 7,459,431,388   | 30,543.30       | 7,210,937,579   | 0.67            |

|      |    |                              |                        |           |           |               |           |               |      |
|------|----|------------------------------|------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC       | ヘルスケア機器・サービス           | 163,474   | 45,495.76 | 7,437,373,946 | 44,021.89 | 7,196,435,754 | 0.67 |
| スイス  | 株式 | NESTLE SA-REG                | 食品・飲料・タバコ              | 495,924   | 13,007.21 | 6,450,587,913 | 13,961.81 | 6,923,999,142 | 0.64 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC               | 小売                     | 185,496   | 36,484.56 | 6,767,741,585 | 35,190.97 | 6,527,785,878 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 家庭用品・パーソナル用品           | 424,547   | 15,140.98 | 6,428,060,730 | 14,861.95 | 6,309,597,136 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A           | ソフトウェア・サービス            | 152,808   | 40,620.08 | 6,207,074,051 | 40,693.44 | 6,218,283,180 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | PAYPAL HOLDINGS INC          | ソフトウェア・サービス            | 191,916   | 27,506.60 | 5,278,958,074 | 32,373.40 | 6,212,973,588 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP         | 銀行                     | 1,338,647 | 4,599.76  | 6,157,461,904 | 4,521.61  | 6,052,847,961 | 0.56 |
| アメリカ | 株式 | WALT DISNEY CO/THE           | メディア・娯楽                | 312,853   | 20,068.00 | 6,278,335,777 | 19,233.17 | 6,017,157,875 | 0.56 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV              | 半導体・半導体製造装置            | 72,279    | 67,815.37 | 4,901,627,285 | 77,619.04 | 5,610,226,737 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | ADOBE INC                    | ソフトウェア・サービス            | 82,558    | 53,665.18 | 4,430,490,190 | 65,325.13 | 5,393,112,495 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP             | エネルギー                  | 730,708   | 6,701.18  | 4,896,609,094 | 6,924.51  | 5,059,801,868 | 0.47 |
| スイス  | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 120,428   | 35,927.43 | 4,326,669,008 | 41,873.43 | 5,042,734,632 | 0.47 |
| アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CLASS A         | メディア・娯楽                | 787,685   | 6,355.08  | 5,005,805,308 | 6,252.19  | 4,924,758,801 | 0.46 |
| アメリカ | 株式 | NETFLIX INC                  | メディア・娯楽                | 76,352    | 54,721.68 | 4,178,110,379 | 58,994.42 | 4,504,342,719 | 0.42 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 電気通信サービス               | 712,983   | 6,470.03  | 4,613,028,204 | 6,174.78  | 4,402,518,302 | 0.41 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP                   | 半導体・半導体製造装置            | 700,409   | 6,089.45  | 4,265,112,413 | 6,275.41  | 4,395,357,145 | 0.41 |
| アメリカ | 株式 | SALESFORCE.COM INC           | ソフトウェア・サービス            | 158,270   | 23,900.62 | 3,782,751,978 | 27,181.66 | 4,302,042,879 | 0.40 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 726,823   | 5,842.04  | 4,246,135,199 | 5,850.78  | 4,252,487,141 | 0.39 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 6月30日現在

| 種類 | 業種        | 投資比率（％） |
|----|-----------|---------|
| 株式 | エネルギー     | 3.15    |
|    | 素材        | 4.17    |
|    | 資本財       | 6.18    |
|    | 商業・専門サービス | 1.17    |
|    | 運輸        | 1.98    |
|    | 自動車・自動車部品 | 1.92    |

|      |                        |   |       |
|------|------------------------|---|-------|
|      | 耐久消費財・アパレル             |   | 1.98  |
|      | 消費者サービス                |   | 1.75  |
|      | メディア・娯楽                |   | 7.09  |
|      | 小売                     |   | 5.39  |
|      | 食品・生活必需品小売り            |   | 1.27  |
|      | 食品・飲料・タバコ              |   | 3.75  |
|      | 家庭用品・パーソナル用品           |   | 1.68  |
|      | ヘルスケア機器・サービス           |   | 4.92  |
|      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |   | 7.24  |
|      | 銀行                     |   | 5.84  |
|      | 各種金融                   |   | 4.54  |
|      | 保険                     |   | 2.88  |
|      | 不動産                    |   | 0.41  |
|      | ソフトウェア・サービス            |   | 11.74 |
|      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |   | 5.52  |
|      | 電気通信サービス               |   | 1.64  |
|      | 公益事業                   |   | 2.74  |
|      | 半導体・半導体製造装置            |   | 4.50  |
|      | 小計                     |   | 93.44 |
| 投資証券 |                        | — | 2.13  |
| 合計   |                        |   | 95.57 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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

令和 3年 6月30日現在

| 資産の種類    | 地域      | 取引所名              | 資産の名称        | 建別 | 数量    | 通貨        | 簿価金額          | 簿価金額（円）        | 評価金額        | 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          | SP EMINI2109 | 買建 | 1,430 | アメリカドル    | 303,462,463.9 | 33,556,879,258 | 306,163,000 | 33,855,504,540 | 3.14    |
|          | カナダ     | モントリオール取引所        | SP/TSE602109 | 買建 | 84    | カナダドル     | 20,147,659    | 1,796,163,800  | 20,227,200  | 1,803,254,880  | 0.17    |
|          | ドイツ     | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO ST 2109 | 買建 | 1,136 | ユーロ       | 46,844,925.4  | 6,163,855,284  | 46,547,600  | 6,124,733,208  | 0.57    |
|          | オーストラリア | シドニー先物取引所         | SPI 200 2109 | 買建 | 103   | オーストラリアドル | 18,761,683.25 | 1,559,471,112  | 18,591,500  | 1,545,325,480  | 0.14    |
|          | イギリス    | インターコンチネンタル取引所    | FTSE100 2109 | 買建 | 303   | イギリスポンド   | 21,452,613.6  | 3,285,682,299  | 21,270,600  | 3,257,805,096  | 0.30    |

|  |     |                  |              |    |    |        |              |               |            |               |      |
|--|-----|------------------|--------------|----|----|--------|--------------|---------------|------------|---------------|------|
|  | スイス | ユーレックス・チューリッヒ取引所 | SWISS 1X2109 | 買建 | 96 | スイスフラン | 11,430,267.6 | 1,372,203,625 | 11,541,120 | 1,385,511,456 | 0.13 |
|--|-----|------------------|--------------|----|----|--------|--------------|---------------|------------|---------------|------|

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

## 新興国株式インデックスマザーファンド

### 投資状況

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国 / 地域   | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|----------|-----------------|---------|
| 株式                       | 香港       | 63,026,635,649  | 25.44   |
|                          | 台湾       | 33,193,240,139  | 13.40   |
|                          | 韓国       | 31,458,230,996  | 12.70   |
|                          | アメリカ     | 24,487,964,252  | 9.89    |
|                          | インド      | 24,001,353,205  | 9.69    |
|                          | ブラジル     | 12,694,829,373  | 5.12    |
|                          | 中国       | 11,448,165,657  | 4.62    |
|                          | 南アフリカ    | 8,318,975,617   | 3.36    |
|                          | サウジアラビア  | 6,889,566,794   | 2.78    |
|                          | メキシコ     | 4,118,612,885   | 1.66    |
|                          | タイ       | 3,853,189,910   | 1.56    |
|                          | マレーシア    | 2,996,127,760   | 1.21    |
|                          | インドネシア   | 2,671,911,565   | 1.08    |
|                          | ポーランド    | 1,719,421,147   | 0.69    |
|                          | アラブ首長国連邦 | 1,597,404,162   | 0.64    |
|                          | カタール     | 1,513,470,132   | 0.61    |
|                          | フィリピン    | 1,497,219,275   | 0.60    |
|                          | クウェート    | 1,235,995,523   | 0.50    |
|                          | チリ       | 1,071,487,392   | 0.43    |
|                          | トルコ      | 577,054,373     | 0.23    |
|                          | ハンガリー    | 544,766,944     | 0.22    |
|                          | コロンビア    | 346,281,946     | 0.14    |
|                          | ギリシャ     | 319,017,599     | 0.13    |
|                          | チェコ      | 250,233,793     | 0.10    |
|                          | イギリス     | 213,586,406     | 0.09    |
|                          | 小計       | 240,044,742,494 | 96.91   |
| 新株予約権証券                  | タイ       | 806,313         | 0.00    |
| 投資証券                     | メキシコ     | 103,232,685     | 0.04    |
|                          | 南アフリカ    | 90,802,265      | 0.04    |
|                          | 小計       | 194,034,950     | 0.08    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 7,468,186,750   | 3.01    |

|       |                 |        |
|-------|-----------------|--------|
| 純資産総額 | 247,707,770,507 | 100.00 |
|-------|-----------------|--------|

（注）投資比率とは、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

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|----------|----|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 7,531,761,929 | 3.04    |

（注）投資比率とは、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

#### a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 6月30日現在

| 国／地域  | 種類 | 銘柄名                          | 業種                     | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|-------|----|------------------------------|------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 台湾    | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置            | 6,207,000  | 2,270.60        | 14,093,619,906  | 2,357.21        | 14,631,211,781  | 5.91            |
| 香港    | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD         | メディア・娯楽                | 1,451,600  | 8,348.84        | 12,119,181,281  | 8,408.72        | 12,206,097,952  | 4.93            |
| 香港    | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD    | 小売                     | 3,820,800  | 3,055.39        | 11,674,068,063  | 3,124.25        | 11,937,157,325  | 4.82            |
| 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     | 1,204,512  | 7,946.64        | 9,571,834,451   | 7,921.80        | 9,541,903,162   | 3.85            |
| 香港    | 株式 | MEITUAN-CLASS B              | 小売                     | 909,800    | 3,621.60        | 3,294,933,339   | 4,610.91        | 4,195,007,738   | 1.69            |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS            | 小売                     | 109,891    | 24,355.62       | 2,676,464,438   | 23,379.66       | 2,569,214,657   | 1.04            |
| ブラジル  | 株式 | VALE SA                      | 素材                     | 994,930    | 2,630.90        | 2,617,568,119   | 2,509.37        | 2,496,655,489   | 1.01            |
| インド   | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | エネルギー                  | 718,706    | 2,931.75        | 2,107,066,971   | 3,131.69        | 2,250,771,580   | 0.91            |
| 香港    | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 銀行                     | 24,166,550 | 88.42           | 2,136,928,547   | 87.00           | 2,102,644,516   | 0.85            |
| インド   | 株式 | INFOSYS LTD                  | ソフトウェア・サービス            | 858,969    | 2,012.62        | 1,728,780,713   | 2,344.57        | 2,013,917,243   | 0.81            |
| アメリカ  | 株式 | JD.COM INC-ADR               | 小売                     | 217,717    | 8,086.99        | 1,760,676,283   | 8,818.75        | 1,919,992,882   | 0.78            |
| アメリカ  | 株式 | NIO INC - ADR                | 自動車・自動車部品              | 325,926    | 3,955.96        | 1,289,352,999   | 5,566.59        | 1,814,298,759   | 0.73            |
| 香港    | 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 | 851,000    | 1,510.21        | 1,285,194,935   | 2,051.98        | 1,746,238,384   | 0.70            |
| 香港    | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険                     | 1,559,500  | 1,161.25        | 1,810,978,729   | 1,090.78        | 1,701,077,648   | 0.69            |
| 韓国    | 株式 | SK HYNIX INC                 | 半導体・半導体製造装置            | 137,167    | 12,070.04       | 1,655,611,663   | 12,225.00       | 1,676,866,575   | 0.68            |
| アメリカ  | 株式 | PINDUODUO INC-ADR            | 小売                     | 110,619    | 13,926.06       | 1,540,487,051   | 14,767.95       | 1,633,616,857   | 0.66            |

|         |    |                              |                    |           |           |               |           |               |      |
|---------|----|------------------------------|--------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| インド     | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 銀行                 | 432,196   | 3,711.09  | 1,603,918,728 | 3,751.80  | 1,621,512,953 | 0.65 |
| アメリカ    | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR         | メディア・娯楽            | 67,907    | 21,055.86 | 1,429,840,374 | 22,964.14 | 1,559,426,439 | 0.63 |
| 韓国      | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 206,092   | 7,246.94  | 1,493,537,366 | 7,237.19  | 1,491,529,022 | 0.60 |
| 台湾      | 株式 | MEDIATEK INC                 | 半導体・半導体製造装置        | 379,236   | 3,628.26  | 1,375,967,771 | 3,704.18  | 1,404,762,009 | 0.57 |
| 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 | 3,136,272 | 425.69    | 1,335,096,905 | 441.72    | 1,385,384,019 | 0.56 |
| 香港      | 株式 | XIAOMI CORP-CLASS B          | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 3,304,600 | 355.46    | 1,174,681,654 | 390.88    | 1,291,728,485 | 0.52 |
| アメリカ    | 株式 | NETEASE INC-ADR              | メディア・娯楽            | 101,426   | 11,850.96 | 1,201,996,129 | 12,687.94 | 1,286,887,936 | 0.52 |
| 韓国      | 株式 | NAVER CORP                   | メディア・娯楽            | 31,001    | 34,362.69 | 1,065,277,987 | 40,244.70 | 1,247,625,945 | 0.50 |
| インド     | 株式 | ICICI BANK LTD               | 銀行                 | 1,289,425 | 920.05    | 1,186,344,200 | 960.15    | 1,238,041,414 | 0.50 |
| アメリカ    | 株式 | GAZPROM PJSC-SPON ADR        | エネルギー              | 1,454,053 | 724.60    | 1,053,611,288 | 833.77    | 1,212,350,423 | 0.49 |
| 韓国      | 株式 | KAKAO CORP                   | メディア・娯楽            | 78,330    | 11,434.03 | 895,627,777   | 15,452.40 | 1,210,386,492 | 0.49 |
| アメリカ    | 株式 | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 銀行                 | 643,488   | 1,827.54  | 1,176,004,237 | 1,854.42  | 1,193,301,264 | 0.48 |
| インド     | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | ソフトウェア・サービス        | 232,699   | 4,697.56  | 1,093,119,069 | 5,011.27  | 1,166,118,681 | 0.47 |
| サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK                | 銀行                 | 309,298   | 2,962.16  | 916,191,813   | 3,261.21  | 1,008,687,586 | 0.41 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 6月30日現在

| 種類 | 業種                     | 投資比率（％） |
|----|------------------------|---------|
| 株式 | エネルギー                  | 4.88    |
|    | 素材                     | 8.14    |
|    | 資本財                    | 2.53    |
|    | 商業・専門サービス              | 0.33    |
|    | 運輸                     | 1.78    |
|    | 自動車・自動車部品              | 3.67    |
|    | 耐久消費財・アパレル             | 1.70    |
|    | 消費者サービス                | 1.09    |
|    | メディア・娯楽                | 8.60    |
|    | 小売                     | 10.63   |
|    | 食品・生活必需品小売り            | 1.09    |
|    | 食品・飲料・タバコ              | 3.37    |
|    | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.03    |
|    | ヘルスケア機器・サービス           | 1.24    |
|    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 3.64    |

|         |                    |       |
|---------|--------------------|-------|
|         | 銀行                 | 12.53 |
|         | 各種金融               | 2.29  |
|         | 保険                 | 2.50  |
|         | 不動産                | 1.91  |
|         | ソフトウェア・サービス        | 2.45  |
|         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 8.55  |
|         | 電気通信サービス           | 2.37  |
|         | 公益事業               | 1.90  |
|         | 半導体・半導体製造装置        | 8.68  |
| 小計      |                    | 96.91 |
| 新株予約権証券 | —                  | 0.00  |
| 投資証券    | —                  | 0.08  |
| 合計      |                    | 96.99 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 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

令和 3年 6月30日現在

| 資産の種類    | 地域   | 取引所名        | 資産の名称        | 建別 | 数量  | 通貨     | 簿価金額         | 簿価金額（円）       | 評価金額       | 評価金額（円）       | 投資比率（％） |
|----------|------|-------------|--------------|----|-----|--------|--------------|---------------|------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ニューヨーク証券取引所 | MINI MS 2109 | 買建 | 991 | アメリカドル | 67,544,036.1 | 7,469,019,512 | 68,111,430 | 7,531,761,929 | 3.04    |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

#### 日本株式インデックスマザーファンド

#### 投資状況

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|----------------|---------|
| 株式                       | 日本   | 12,867,536,940 | 97.85   |
| 投資証券                     | 日本   | 200,428,700    | 1.52    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 82,096,977     | 0.63    |
| 純資産総額                    |      | 13,150,062,617 | 100.00  |

（注）投資比率とは、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

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域 | 時価合計        | 投資比率（％） |
|----------|----|------|-------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本   | 136,010,000 | 1.03    |

（注）投資比率とは、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

#### a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 6月30日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|------|----|-------------------|--------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 63,600  | 8,479.51        | 539,296,992     | 9,710.00        | 617,556,000     | 4.70            |
| 日本   | 株式 | ソニーグループ           | 電気機器   | 37,800  | 11,469.72       | 433,555,711     | 10,815.00       | 408,807,000     | 3.11            |
| 日本   | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 5,800   | 52,656.64       | 305,408,552     | 56,070.00       | 325,206,000     | 2.47            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 37,600  | 9,834.24        | 369,767,694     | 7,775.00        | 292,340,000     | 2.22            |
| 日本   | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 40,700  | 5,128.75        | 208,740,214     | 5,470.00        | 222,629,000     | 1.69            |
| 日本   | 株式 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 366,400 | 581.41          | 213,032,008     | 600.10          | 219,876,640     | 1.67            |
| 日本   | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 3,400   | 62,096.49       | 211,128,095     | 64,620.00       | 219,708,000     | 1.67            |
| 日本   | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器   | 4,500   | 48,875.56       | 219,940,032     | 48,080.00       | 216,360,000     | 1.65            |
| 日本   | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 10,600  | 19,000.80       | 201,408,525     | 18,580.00       | 196,948,000     | 1.50            |
| 日本   | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 29,000  | 5,314.73        | 154,127,348     | 6,361.00        | 184,469,000     | 1.40            |
| 日本   | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 47,200  | 3,676.40        | 173,526,103     | 3,719.00        | 175,536,800     | 1.33            |
| 日本   | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 48,900  | 3,324.57        | 162,571,702     | 3,550.00        | 173,595,000     | 1.32            |
| 日本   | 株式 | 日本電産              | 電気機器   | 13,400  | 12,867.88       | 172,429,707     | 12,875.00       | 172,525,000     | 1.31            |
| 日本   | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 48,300  | 3,366.64        | 162,608,820     | 3,465.00        | 167,359,500     | 1.27            |
| 日本   | 株式 | HOYA              | 精密機器   | 11,200  | 13,236.57       | 148,249,693     | 14,730.00       | 164,976,000     | 1.25            |
| 日本   | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 7,500   | 21,922.85       | 164,421,447     | 20,690.00       | 155,175,000     | 1.18            |
| 日本   | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 5,700   | 25,848.20       | 147,334,767     | 26,795.00       | 152,731,500     | 1.16            |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 39,100  | 3,807.16        | 148,860,329     | 3,830.00        | 149,753,000     | 1.14            |
| 日本   | 株式 | 村田製作所             | 電気機器   | 17,200  | 8,811.39        | 151,555,914     | 8,482.00        | 145,890,400     | 1.11            |
| 日本   | 株式 | ファーストリテイリング       | 小売業    | 1,700   | 87,757.60       | 149,187,928     | 83,630.00       | 142,171,000     | 1.08            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンク            | 情報・通信業 | 86,100  | 1,425.70        | 122,753,517     | 1,453.50        | 125,146,350     | 0.95            |
| 日本   | 株式 | 富士通               | 電気機器   | 5,900   | 16,610.83       | 98,003,943      | 20,800.00       | 122,720,000     | 0.93            |
| 日本   | 株式 | 第一三共              | 医薬品    | 51,000  | 2,918.92        | 148,865,088     | 2,394.50        | 122,119,500     | 0.93            |
| 日本   | 株式 | セブン＆アイ・ホールディングス   | 小売業    | 22,600  | 4,595.27        | 103,853,148     | 5,297.00        | 119,712,200     | 0.91            |
| 日本   | 株式 | 三井物産              | 卸売業    | 46,300  | 2,316.19        | 107,239,834     | 2,500.50        | 115,773,150     | 0.88            |

|    |    |                |        |        |           |             |           |             |      |
|----|----|----------------|--------|--------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業    | 72,300 | 1,563.96  | 113,074,703 | 1,587.50  | 114,776,250 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事           | 卸売業    | 37,800 | 3,011.90  | 113,850,105 | 3,028.00  | 114,458,400 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事          | 卸売業    | 35,600 | 3,414.81  | 121,567,513 | 3,200.00  | 113,920,000 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話         | 情報・通信業 | 38,600 | 2,800.47  | 108,098,244 | 2,894.50  | 111,727,700 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | S M C          | 機械     | 1,700  | 64,911.63 | 110,349,784 | 65,650.00 | 111,605,000 | 0.85 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 6月30日現在

| 種類 | 業種         | 投資比率（％） |
|----|------------|---------|
| 株式 | 鉱業         | 0.19    |
|    | 建設業        | 1.48    |
|    | 食料品        | 3.02    |
|    | 繊維製品       | 0.23    |
|    | パルプ・紙      | 0.12    |
|    | 化学         | 6.86    |
|    | 医薬品        | 6.11    |
|    | 石油・石炭製品    | 0.45    |
|    | ゴム製品       | 0.66    |
|    | ガラス・土石製品   | 0.50    |
|    | 鉄鋼         | 0.61    |
|    | 非鉄金属       | 0.53    |
|    | 金属製品       | 0.44    |
|    | 機械         | 4.83    |
|    | 電気機器       | 21.22   |
|    | 輸送用機器      | 9.25    |
|    | 精密機器       | 2.86    |
|    | その他製品      | 2.52    |
|    | 電気・ガス業     | 1.02    |
|    | 陸運業        | 2.98    |
|    | 海運業        | 0.21    |
|    | 空運業        | 0.17    |
|    | 情報・通信業     | 8.43    |
|    | 卸売業        | 4.04    |
|    | 小売業        | 3.95    |
|    | 銀行業        | 4.52    |
|    | 証券、商品先物取引業 | 0.74    |
|    | 保険業        | 2.11    |
|    | その他金融業     | 0.99    |
|    | 不動産業       | 1.55    |
|    | サービス業      | 5.28    |
|    | 小計         | 97.85   |

|      |   |       |
|------|---|-------|
| 投資証券 | — | 1.52  |
| 合計   |   | 99.38 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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

令和 3年 6月30日現在

| 資産の種類    | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額（円）     | 評価金額（円）     | 投資比率（％） |
|----------|-------|---------------|----|----|----|-------------|-------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | ＴＯＰＩＸ ２１年０９月限 | 買建 | 7  | 円  | 136,993,850 | 136,010,000 | 1.03    |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

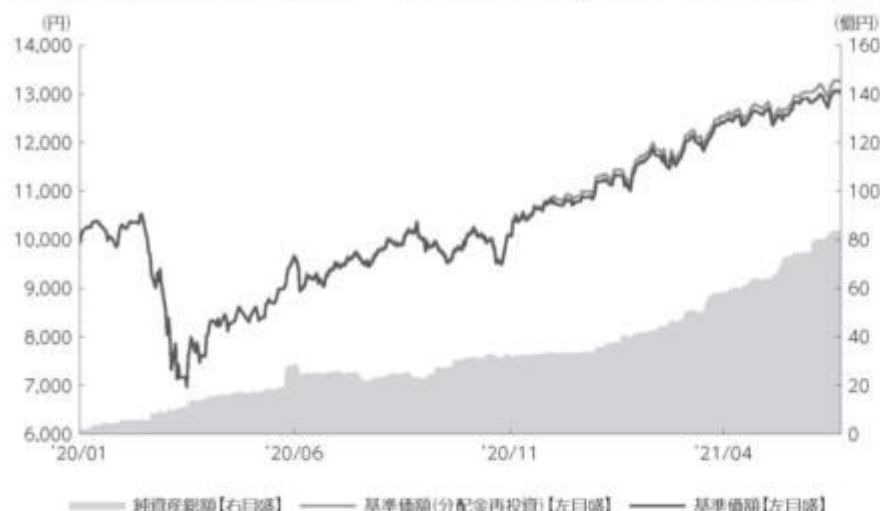
参考情報



## 運用実績

2021年6月30日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2020年1月8日(設定日)～2021年6月30日



- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000(当初元本1口当たり)を起点として表示
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

### ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 13,056円 |
| 純資産総額 | 83.5億円  |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

|           |      |
|-----------|------|
| 2021年 6月  | 75円  |
| 2020年 12月 | 64円  |
| 2020年 6月  | 39円  |
| 設定来累計     | 178円 |

●分配金は1口当たり、税引前

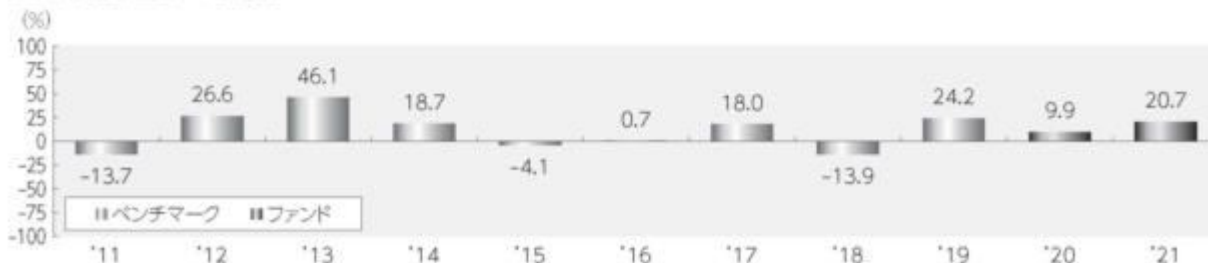
### ■主要な資産の状況

| 組入上位通貨      | 比率    | 組入上位銘柄                         | 業種                 | 国・地域 | 比率   |
|-------------|-------|--------------------------------|--------------------|------|------|
| 1 アメリカドル    | 60.0% | 1 APPLE INC                    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | アメリカ | 3.3% |
| 2 ユーロ       | 8.5%  | 2 MICROSOFT CORP               | ソフトウェア・サービス        | アメリカ | 2.8% |
| 3 円         | 6.4%  | 3 AMAZON.COM INC               | 小売                 | アメリカ | 2.1% |
| 4 香港ドル      | 4.1%  | 4 ALPHABET INC-CL A            | メディア・娯楽            | アメリカ | 1.4% |
| 5 イギリスポンド   | 3.7%  | 5 FACEBOOK INC-CLASS A         | メディア・娯楽            | アメリカ | 1.2% |
| 6 カナダドル     | 2.9%  | 6 TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置        | 台湾   | 0.8% |
| 7 スイスフラン    | 2.5%  | 7 TESLA INC                    | 自動車・自動車部品          | アメリカ | 0.7% |
| 8 オーストラリアドル | 1.8%  | 8 NVIDIA CORP                  | 半導体・半導体製造装置        | アメリカ | 0.7% |
| 9 ニュー台湾ドル   | 1.7%  | 9 JPMORGAN CHASE & CO          | 銀行                 | アメリカ | 0.7% |
| 10 韓国ウォン    | 1.6%  | 10 ALPHABET INC-CL C           | メディア・娯楽            | アメリカ | 0.7% |

| その他資産の状況      | 比率   |
|---------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建) | 4.0% |

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

### ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2020年は設定日から年末までの、2021年は年初から6月30日までの収益率を表示
- 2019年以前は対象指数(ベンチマーク)の年間収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。  
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

## 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）ならびに同規則第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、当期（令和２年12月９日から令和３年６月８日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## １【財務諸表】

## 【MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

## （１）【貸借対照表】

| (単位：円)          |                          |                          |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
|                 | 第2期<br>[ 令和 2年12月 8日現在 ] | 第3期<br>[ 令和 3年 6月 8日現在 ] |
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 18,684,482               | 40,507,560               |
| 親投資信託受益証券       | 3,317,160,927            | 7,406,910,408            |
| 未収入金            | 18,297,566               | 42,440,675               |
| 流動資産合計          | 3,354,142,975            | 7,489,858,643            |
| 資産合計            | 3,354,142,975            | 7,489,858,643            |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払収益分配金         | 19,840,000               | 43,500,000               |
| 未払受託者報酬         | 304,599                  | 549,537                  |
| 未払委託者報酬         | 883,281                  | 1,593,596                |
| 未払利息            | 12                       | 29                       |
| その他未払費用         | 944,326                  | 1,188,474                |
| 流動負債合計          | 21,972,218               | 46,831,636               |
| 負債合計            | 21,972,218               | 46,831,636               |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 3,100,000,000            | 5,800,000,000            |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 232,170,757              | 1,643,027,007            |
| （分配準備積立金）       | 53,843                   | 383,999                  |
| 元本等合計           | 3,332,170,757            | 7,443,027,007            |
| 純資産合計           | 3,332,170,757            | 7,443,027,007            |
| 負債純資産合計         | 3,354,142,975            | 7,489,858,643            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

| (単位：円)    |                                       |                                       |
|-----------|---------------------------------------|---------------------------------------|
|           | 第2期<br>自 令和 2年 6月 9日<br>至 令和 2年12月 8日 | 第3期<br>自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8日 |
| 営業収益      |                                       |                                       |
| 受取利息      | 98                                    | 9                                     |
| 有価証券売買等損益 | 357,293,413                           | 927,710,971                           |

|                                           | 第2期<br>自 令和 2年 6月 9日<br>至 令和 2年12月 8日 | 第3期<br>自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益合計                                    | 357,293,511                           | 927,710,980                           |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 支払利息                                      | 3,344                                 | 1,589                                 |
| 受託者報酬                                     | 304,599                               | 549,537                               |
| 委託者報酬                                     | 883,281                               | 1,593,596                             |
| その他費用                                     | 1,208,817                             | 1,550,008                             |
| 営業費用合計                                    | 2,400,041                             | 3,694,730                             |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 354,893,470                           | 924,016,250                           |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 354,893,470                           | 924,016,250                           |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 354,893,470                           | 924,016,250                           |
| 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（ ） | -                                     | -                                     |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 106,264,713                           | 232,170,757                           |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 24,806,000                            | 530,340,000                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 24,806,000                            | -                                     |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | -                                     | 530,340,000                           |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 21,424,000                            | -                                     |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 21,424,000                            | -                                     |
| 分配金                                       | 19,840,000                            | 43,500,000                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 232,170,757                           | 1,643,027,007                         |

### （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                    |                                                 |
|--------------------|-------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 |
|--------------------|-------------------------------------------------|

（重要な会計上の見積りに関する注記）

第3期〔令和 3年 6月 8日現在〕

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

|           | 第2期<br>〔令和 2年12月 8日現在〕 | 第3期<br>〔令和 3年 6月 8日現在〕 |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 2,970,000,000円         | 3,100,000,000円         |
| 期中追加設定元本額 | 1,230,000,000円         | 2,700,000,000円         |
| 期中一部解約元本額 | 1,100,000,000円         | —円                     |
| 2. 受益権の総数 | 310,000口               | 580,000口               |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 第2期<br>自 令和 2年 6月 9日<br>至 令和 2年12月 8日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 第3期<br>自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8日 |             |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|-------------|--|----------|---|--------|--------------|---|-------------|----------|---|----------|----------|---------|-------------|----|---|------------|---------------|-------|-------------|---------|---|-------------|----------------|-------|---------|--------------|---|----------|-----------|-------|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|----------|---|--------|--------------|---|-------------|----------|---|---------|----------|---------|-------------|----|---|------------|---------------|-------|-------------|---------|---|-------------|----------------|-------|----------|--------------|---|----------|-----------|-------|-----|
| 1.その他費用<br>上場費用および商標使用料等を含んでおります。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 1.その他費用<br>上場費用および商標使用料等を含んでおります。     |             |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 2.分配金の計算過程                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 2.分配金の計算過程                            |             |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>3,246円</td></tr><tr><td>親ファンドの配当等収益額</td><td>B</td><td>22,118,720円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>C</td><td>175,066円</td></tr><tr><td>配当等収益合計額</td><td>D=A+B+C</td><td>22,290,540円</td></tr><tr><td>経費</td><td>E</td><td>2,396,697円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>F=D-E</td><td>19,893,843円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>G</td><td>19,840,000円</td></tr><tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>H=F-G</td><td>53,843円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>I</td><td>310,000口</td></tr><tr><td>1口当たり分配金額</td><td>J=G/I</td><td>64円</td></tr></table> | 項目                                    |             |  | 当期配当等収益額 | A | 3,246円 | 親ファンドの配当等収益額 | B | 22,118,720円 | 分配準備積立金額 | C | 175,066円 | 配当等収益合計額 | D=A+B+C | 22,290,540円 | 経費 | E | 2,396,697円 | 当ファンドの分配対象収益額 | F=D-E | 19,893,843円 | 収益分配金金額 | G | 19,840,000円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | H=F-G | 53,843円 | 当ファンドの期末残存口数 | I | 310,000口 | 1口当たり分配金額 | J=G/I | 64円 | <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>1,580円</td></tr><tr><td>親ファンドの配当等収益額</td><td>B</td><td>47,524,877円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>C</td><td>53,843円</td></tr><tr><td>配当等収益合計額</td><td>D=A+B+C</td><td>47,577,140円</td></tr><tr><td>経費</td><td>E</td><td>3,693,141円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>F=D-E</td><td>43,883,999円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>G</td><td>43,500,000円</td></tr><tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>H=F-G</td><td>383,999円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>I</td><td>580,000口</td></tr><tr><td>1口当たり分配金額</td><td>J=G/I</td><td>75円</td></tr></table> | 項目 |  |  | 当期配当等収益額 | A | 1,580円 | 親ファンドの配当等収益額 | B | 47,524,877円 | 分配準備積立金額 | C | 53,843円 | 配当等収益合計額 | D=A+B+C | 47,577,140円 | 経費 | E | 3,693,141円 | 当ファンドの分配対象収益額 | F=D-E | 43,883,999円 | 収益分配金金額 | G | 43,500,000円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | H=F-G | 383,999円 | 当ファンドの期末残存口数 | I | 580,000口 | 1口当たり分配金額 | J=G/I | 75円 |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                       |             |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 当期配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | A                                     | 3,246円      |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 親ファンドの配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | B                                     | 22,118,720円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | C                                     | 175,066円    |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 配当等収益合計額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | D=A+B+C                               | 22,290,540円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 経費                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | E                                     | 2,396,697円  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | F=D-E                                 | 19,893,843円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 収益分配金金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G                                     | 19,840,000円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 次期繰越金(分配準備積立金)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | H=F-G                                 | 53,843円     |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | I                                     | 310,000口    |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 1口当たり分配金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | J=G/I                                 | 64円         |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                       |             |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 当期配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | A                                     | 1,580円      |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 親ファンドの配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | B                                     | 47,524,877円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | C                                     | 53,843円     |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 配当等収益合計額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | D=A+B+C                               | 47,577,140円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 経費                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | E                                     | 3,693,141円  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | F=D-E                                 | 43,883,999円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 収益分配金金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G                                     | 43,500,000円 |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 次期繰越金(分配準備積立金)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | H=F-G                                 | 383,999円    |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | I                                     | 580,000口    |  |          |   |        |              |   |             |          |   |          |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |         |              |   |          |           |       |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |  |  |          |   |        |              |   |             |          |   |         |          |         |             |    |   |            |               |       |             |         |   |             |                |       |          |              |   |          |           |       |     |
| 1口当たり分配金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | J=G/I                                 | 75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

| 区分                       | 第2期<br>自 令和 2年 6月 9日<br>至 令和 2年12月 8日                                                                   | 第3期<br>自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8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」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左                                    |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。                               | 同左                                    |

| 区分               | 第2期<br>自 令和 2年 6月 9日<br>至 令和 2年12月 8日                                                                                                                                                                    | 第3期<br>自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8日 |
|------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 第2期<br>[ 令和 2年12月 8日現在 ]                                                                                                                                                                                                  | 第3期<br>[ 令和 3年 6月 8日現在 ]                                                                     |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                    | 同左                                                                                           |
| 2.時価の算定方法                 | <p>( 1 ) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（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</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>( 3 ) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>( 1 ) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>( 2 ) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>( 3 ) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</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 | 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。                                                                                                     | 同左                                                                                           |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類        | 第2期<br>[ 令和 2年12月 8日現在 ]   | 第3期<br>[ 令和 3年 6月 8日現在 ]   |
|-----------|----------------------------|----------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>( 円 ) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>( 円 ) |
| 親投資信託受益証券 | 342,724,462                | 921,607,037                |
| 合計        | 342,724,462                | 921,607,037                |

（デリバティブ取引に関する注記）  
取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

|           | 第2期<br>[ 令和 2年12月 8日現在 ] | 第3期<br>[ 令和 3年 6月 8日現在 ] |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 10,749円                  | 12,833円                  |

（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

（単位：円）

| 種 類       | 銘 柄                | 口数            | 評価額           | 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 | 284,800,726   | 951,433,785   |    |
|           | 日本株式インデックスマザーファンド  | 347,226,392   | 451,255,419   |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド  | 1,468,491,502 | 6,004,221,204 |    |
| 合計        |                    | 2,100,518,620 | 7,406,910,408 |    |

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）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。  
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

### 外国株式インデックスマザーファンド

#### 貸借対照表

| （単位：円）            |                   |
|-------------------|-------------------|
| [ 令和 3年 6月 8日現在 ] |                   |
| <b>資産の部</b>       |                   |
| 流動資産              |                   |
| 預金                | 40,130,900,041    |
| コール・ローン           | 1,296,376,285     |
| 株式                | 985,914,241,691   |
| 投資証券              | 22,883,452,432    |
| 派生商品評価勘定          | 223,684,629       |
| 未収入金              | 33,143,120        |
| 未収配当金             | 1,269,178,817     |
| 差入委託証拠金           | 6,378,068,134     |
| 流動資産合計            | 1,058,129,045,149 |
| 資産合計              | 1,058,129,045,149 |
| <b>負債の部</b>       |                   |
| 流動負債              |                   |
| 派生商品評価勘定          | 1,398,135         |
| 未払金               | 23,682,515,185    |
| 未払解約金             | 544,904,466       |
| 未払利息              | 942               |
| 流動負債合計            | 24,228,818,728    |
| 負債合計              | 24,228,818,728    |
| <b>純資産の部</b>      |                   |
| 元本等               |                   |
| 元本                | 252,867,758,937   |
| 剰余金               |                   |
| 剰余金又は欠損金（ ）       | 781,032,467,484   |
| 元本等合計             | 1,033,900,226,421 |
| 純資産合計             | 1,033,900,226,421 |
| 負債純資産合計           | 1,058,129,045,149 |

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |                                                                                                                      |
|----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。<br>投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。<br>為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。                                           |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。                                                           |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[ 令和 3年 6月 8日現在 ]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

|                                  | [ 令和 3年 6月 8日現在 ] |
|----------------------------------|-------------------|
| 1. 期首                            | 令和 2年12月 9日       |
| 期首元本額                            | 208,273,509,229円  |
| 期中追加設定元本額                        | 84,030,173,777円   |
| 期中一部解約元本額                        | 39,435,924,069円   |
| 元本の内訳                            |                   |
| MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信         | 3,485,603,206円    |
| MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信       | 1,468,491,502円    |
| ファンド・マネジャー（海外株式）                 | 20,433,842円       |
| eMAXIS 先進国株式インデックス               | 11,479,697,898円   |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 1,125,217,215円    |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 330,417,947円      |
| コアバランス                           | 316,134円          |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 57,743,483円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 93,267,364円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 70,980,972円       |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス          | 51,891,460,164円   |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）                | 1,230,071,379円    |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 2,981,752,998円    |
| つみたて先進国株式                        | 8,741,908,886円    |
| つみたて8資産均等バランス                    | 1,371,388,319円    |
| つみたて4資産均等バランス                    | 391,086,836円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 1,534,348円        |

|                                  | [令和 3年 6月 8日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 1,758,815円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 2,195,392円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 46,659,834円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 43,664,190円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 25,685,828円     |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）          | 13,469,715,610円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）        | 303,542,001円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）     | 38,393,379,933円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 31,255,519円     |
| 先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）           | 20,303,797,266円 |
| つみたて全世界株式                        | 15,977,133円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 3,371,892円      |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式               | 2,168,184,838円  |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド           | 21,108,095,898円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス               | 2,871,390,403円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）        | 1,232,299,232円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）        | 2,405,457,584円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）       | 525,862,400円    |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）   | 674,520,146円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）        | 383,778,019円    |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）              | 229,646,919円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）        | 65,259,677円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）        | 74,930,504円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）       | 285,510,458円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）          | 218,490,422円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）         | 448,156,571円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）    | 19,369,360円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）    | 6,299,859,023円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）  | 87,529,489円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）  | 1,110,501,475円  |
| MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）   | 15,291,829,343円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）  | 768,051円        |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）    | 921,320,705円    |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）  | 7,502,574,121円  |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）    | 14,403,742円     |

|                                            | [令和 3年 6月 8日現在]  |
|--------------------------------------------|------------------|
| アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）              | 78,207,118円      |
| MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）    | 2,807,671,252円   |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）   | 1,061,586,335円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）      | 414,178,963円     |
| 世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）                 | 51,169,430円      |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）          | 2,705,786,153円   |
| MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）    | 97,020,585円      |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）           | 2,247,140,426円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）        | 306,515,672円     |
| MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定） | 12,268,957,864円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）  | 94,665,094円      |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）                 | 120,318円         |
| 三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド                       | 1,997,679,313円   |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ                 | 1,019,459円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ               | 3,807,776円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ                 | 2,507,271円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ                 | 4,060,263円       |
| 三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ                     | 35,072,810円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）                 | 5,165,490円       |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）                 | 29,474,211円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）                 | 6,579,828円       |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）                 | 30,664,343円      |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド                   | 5,637,384,819円   |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）        | 127,615,249円     |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）      | 505,312,384円     |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）        | 528,174,503円     |
| 三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）        | 498,107,722円     |
| 合計                                         | 252,867,758,937円 |
| ２． 受益権の総数                                  | 252,867,758,937口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

| 区分                      | 自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8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」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算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> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [ 令和 3年 6月 8日現在 ]                                                                                                                                                                                                                  |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                             |
| 2.時価の算定方法                 | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（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</p> <p>デリバティブ取引は、（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) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</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 | 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。                                                                                                              |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [ 令和 3年 6月 8日現在 ]  |                |
|------|--------------------|----------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |                |
| 株式   |                    | 22,278,179,241 |
| 投資証券 |                    | 1,331,746,528  |
| 合計   |                    | 23,609,925,769 |

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

[ 令和 3年 6月 8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<br>買建 | 26,659,286,985 | —     | 26,881,988,114 | 222,701,129 |
| 合計   |                | 26,659,286,985 | —     | 26,881,988,114 | 222,701,129 |

## （注）時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値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、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 先物取引の残高は、契約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。

## 通貨関連

[ 令和 3年 6月 8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<br>買建 |               |       |               |         |
|           | アメリカドル       | 1,966,699,284 | —     | 1,966,225,954 | 473,330 |
|           | カナダドル        | 156,698,874   | —     | 156,626,540   | 72,334  |
|           | オーストラリアドル    | 67,003,317    | —     | 67,015,700    | 12,383  |
|           | イギリスポンド      | 107,476,677   | —     | 107,475,498   | 1,179   |
|           | スイスフラン       | 97,749,124    | —     | 97,750,003    | 879     |

|  |                |               |   |               |         |
|--|----------------|---------------|---|---------------|---------|
|  | 香港ドル           | 15,210,580    | — | 15,209,825    | 755     |
|  | シンガポールドル       | 16,218,804    | — | 16,212,865    | 5,939   |
|  | ニュージーランド<br>ドル | 19,448,286    | — | 19,534,983    | 86,697  |
|  | スウェーデンク<br>ローネ | 38,959,771    | — | 38,968,250    | 8,479   |
|  | ノルウェークロー<br>ネ  | 16,285,446    | — | 16,285,200    | 246     |
|  | デンマーククロー<br>ネ  | 29,657,874    | — | 29,657,377    | 497     |
|  | ユーロ            | 330,297,488   | — | 330,312,225   | 14,737  |
|  | 売建<br>香港ドル     | 14,450,693    | — | 14,434,223    | 16,470  |
|  | 合計             | 2,876,156,218 | — | 2,875,708,643 | 414,635 |

## （注）時価の算定方法

- １ 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。
- （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- ２ 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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。

## （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。

## （１口当たり情報）

|              | [ 令和 3年 6月 8日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 4.0887円           |
| (1万口当たり純資産額) | (40,887円)         |

## 附属明細表

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

（単位：円）

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 |    | 備考 |
|----|----|-----|-----|----|----|
|    |    |     | 単価  | 金額 |    |

|        |                              |         |        |               |  |
|--------|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| アメリカドル | BAKER HUGHES CO              | 121,139 | 25.94  | 3,142,345.66  |  |
|        | CHENIERE ENERGY INC          | 42,838  | 88.82  | 3,804,871.16  |  |
|        | CHEVRON CORP                 | 332,477 | 107.75 | 35,824,396.75 |  |
|        | CONOCOPHILLIPS               | 234,716 | 59.81  | 14,038,363.96 |  |
|        | DEVON ENERGY CORP            | 110,004 | 30.92  | 3,401,323.68  |  |
|        | EOG RESOURCES INC            | 101,564 | 87.03  | 8,839,114.92  |  |
|        | EXXON MOBIL CORP             | 730,708 | 61.05  | 44,609,723.40 |  |
|        | HALLIBURTON CO               | 151,300 | 24.30  | 3,676,590.00  |  |
|        | HESS CORP                    | 47,459  | 89.05  | 4,226,223.95  |  |
|        | KINDER MORGAN INC            | 353,632 | 18.77  | 6,637,672.64  |  |
|        | MARATHON PETROLEUM CORP      | 110,287 | 63.34  | 6,985,578.58  |  |
|        | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 158,818 | 29.16  | 4,631,132.88  |  |
|        | ONEOK INC                    | 77,757  | 55.17  | 4,289,853.69  |  |
|        | PHILLIPS 66                  | 73,621  | 92.41  | 6,803,316.61  |  |
|        | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 35,973  | 170.71 | 6,140,950.83  |  |
|        | SCHLUMBERGER LTD             | 242,450 | 35.83  | 8,686,983.50  |  |
|        | VALERO ENERGY CORP           | 68,957  | 82.69  | 5,702,054.33  |  |
|        | WILLIAMS COS INC             | 207,422 | 28.23  | 5,855,523.06  |  |
|        | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 38,325  | 301.81 | 11,566,868.25 |  |
|        | ALBEMARLE CORP               | 19,899  | 170.78 | 3,398,351.22  |  |
|        | AMCOR PLC                    | 280,909 | 12.10  | 3,398,998.90  |  |
|        | AVERY DENNISON CORP          | 14,367  | 216.42 | 3,109,306.14  |  |
|        | BALL CORP                    | 56,299  | 81.36  | 4,580,486.64  |  |
|        | CELANESE CORP                | 18,851  | 165.30 | 3,116,070.30  |  |
|        | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 36,156  | 55.55  | 2,008,465.80  |  |
|        | CORTEVA INC                  | 126,885 | 45.93  | 5,827,828.05  |  |
|        | CROWN HOLDINGS INC           | 22,427  | 99.59  | 2,233,504.93  |  |
|        | DOW INC                      | 128,212 | 69.24  | 8,877,398.88  |  |
|        | DUPONT DE NEMOURS INC        | 93,202  | 84.97  | 7,919,373.94  |  |
|        | EASTMAN CHEMICAL CO          | 24,484  | 127.84 | 3,130,034.56  |  |
|        | ECOLAB INC                   | 43,585  | 212.96 | 9,281,861.60  |  |
|        | FMC CORP                     | 22,793  | 118.49 | 2,700,742.57  |  |
|        | FREEPORT-MCMORAN INC         | 253,343 | 41.26  | 10,452,932.18 |  |
|        | INTERNATIONAL PAPER CO       | 65,458  | 63.73  | 4,171,638.34  |  |
|        | INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 43,750  | 143.18 | 6,264,125.00  |  |
|        | LINDE PLC                    | 90,063  | 291.58 | 26,260,569.54 |  |
|        | LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 45,461  | 112.66 | 5,121,636.26  |  |
|        | MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 10,535  | 353.77 | 3,726,966.95  |  |
|        | MOSAIC CO/THE                | 63,518  | 35.92  | 2,281,566.56  |  |
|        | NEWMONT CORP                 | 137,304 | 71.51  | 9,818,609.04  |  |
|        | NUCOR CORP                   | 53,123  | 107.37 | 5,703,816.51  |  |
|        | PACKAGING CORP OF AMERICA    | 16,577  | 144.32 | 2,392,392.64  |  |
|        | PPG INDUSTRIES INC           | 41,348  | 179.98 | 7,441,813.04  |  |

|                                |           |        |               |
|--------------------------------|-----------|--------|---------------|
| RPM INTERNATIONAL INC          | 23,277    | 93.04  | 2,165,692.08  |
| SEALED AIR CORP                | 29,145    | 57.51  | 1,676,128.95  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE        | 43,935    | 280.81 | 12,337,387.35 |
| STEEL DYNAMICS INC             | 37,342    | 64.19  | 2,396,982.98  |
| VULCAN MATERIALS CO            | 22,930    | 177.96 | 4,080,622.80  |
| WESTROCK CO                    | 45,602    | 57.90  | 2,640,355.80  |
| 3M CO                          | 99,801    | 203.73 | 20,332,457.73 |
| ALLEGION PLC                   | 14,627    | 138.00 | 2,018,526.00  |
| AMETEK INC                     | 39,386    | 136.68 | 5,383,278.48  |
| BOEING CO/THE                  | 95,371    | 252.66 | 24,096,436.86 |
| CARRIER GLOBAL CORP            | 140,429   | 46.06  | 6,468,159.74  |
| CATERPILLAR INC                | 93,999    | 239.76 | 22,537,200.24 |
| CUMMINS INC                    | 25,874    | 259.22 | 6,707,058.28  |
| DEERE & CO                     | 51,314    | 355.43 | 18,238,535.02 |
| DOVER CORP                     | 25,214    | 151.63 | 3,823,198.82  |
| EATON CORP PLC                 | 67,688    | 146.85 | 9,939,982.80  |
| EMERSON ELECTRIC CO            | 104,345   | 97.87  | 10,212,245.15 |
| FASTENAL CO                    | 97,317    | 52.78  | 5,136,391.26  |
| FORTIVE CORP                   | 55,141    | 72.74  | 4,010,956.34  |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI   | 24,031    | 102.15 | 2,454,766.65  |
| GENERAC HOLDINGS INC           | 11,000    | 329.96 | 3,629,560.00  |
| GENERAL DYNAMICS CORP          | 42,119    | 191.77 | 8,077,160.63  |
| GENERAL ELECTRIC CO            | 1,511,232 | 13.91  | 21,021,237.12 |
| HEICO CORP                     | 7,231     | 147.14 | 1,063,969.34  |
| HEICO CORP-CLASS A             | 13,696    | 135.95 | 1,861,971.20  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC    | 119,715   | 228.19 | 27,317,765.85 |
| HOWMET AEROSPACE INC           | 70,186    | 35.30  | 2,477,565.80  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE   | 6,440     | 221.28 | 1,425,043.20  |
| IDEX CORP                      | 13,155    | 222.75 | 2,930,276.25  |
| ILLINOIS TOOL WORKS            | 54,727    | 233.49 | 12,778,207.23 |
| INGERSOLL-RAND INC             | 66,911    | 48.21  | 3,225,779.31  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD     | 38,600    | 63.93  | 2,467,698.00  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 124,844   | 66.20  | 8,264,672.80  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC      | 36,271    | 218.55 | 7,927,027.05  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC       | 5,609     | 341.17 | 1,913,622.53  |
| LOCKHEED MARTIN CORP           | 43,373    | 391.51 | 16,980,963.23 |
| MASCO CORP                     | 42,725    | 59.24  | 2,531,029.00  |
| NORDSON CORP                   | 8,685     | 222.56 | 1,932,933.60  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP          | 26,880    | 371.84 | 9,995,059.20  |
| OTIS WORLDWIDE CORP            | 69,716    | 79.61  | 5,550,090.76  |
| OWENS CORNING                  | 17,756    | 104.99 | 1,864,202.44  |
| PACCAR INC                     | 58,874    | 93.37  | 5,497,065.38  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| PARKER HANNIFIN CORP         | 22,502  | 307.38 | 6,916,664.76  |
| PENTAIR PLC                  | 26,974  | 69.15  | 1,865,252.10  |
| PLUG POWER INC               | 85,067  | 32.85  | 2,794,450.95  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP   | 261,535 | 88.97  | 23,268,768.95 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 19,951  | 274.73 | 5,481,138.23  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 18,087  | 446.78 | 8,080,909.86  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 25,838  | 60.39  | 1,560,356.82  |
| SMITH (A.O.) CORP            | 22,709  | 68.20  | 1,548,753.80  |
| SNAP-ON INC                  | 9,539   | 251.09 | 2,395,147.51  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 27,328  | 209.15 | 5,715,651.20  |
| SUNRUN INC                   | 29,130  | 43.51  | 1,267,446.30  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC    | 7,797   | 416.97 | 3,251,115.09  |
| TEXTRON INC                  | 40,164  | 69.97  | 2,810,275.08  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 41,790  | 182.07 | 7,608,705.30  |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 8,826   | 662.55 | 5,847,666.30  |
| UNITED RENTALS INC           | 12,676  | 316.02 | 4,005,869.52  |
| WABTEC CORP                  | 29,134  | 82.39  | 2,400,350.26  |
| WW GRAINGER INC              | 7,442   | 459.81 | 3,421,906.02  |
| XYLEM INC                    | 31,918  | 119.00 | 3,798,242.00  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 24,869  | 86.16  | 2,142,713.04  |
| CINTAS CORP                  | 15,840  | 346.80 | 5,493,312.00  |
| CLARIVATE PLC                | 56,127  | 33.53  | 1,881,938.31  |
| COPART INC                   | 36,311  | 124.34 | 4,514,909.74  |
| COSTAR GROUP INC             | 6,652   | 827.94 | 5,507,456.88  |
| EQUIFAX INC                  | 20,543  | 228.72 | 4,698,594.96  |
| IHS MARKIT LTD               | 66,223  | 105.88 | 7,011,691.24  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 23,088  | 141.68 | 3,271,107.84  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 24,508  | 104.43 | 2,559,370.44  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 38,015  | 108.56 | 4,126,908.40  |
| ROBERT HALF INTL INC         | 20,832  | 89.83  | 1,871,338.56  |
| ROLLINS INC                  | 36,239  | 32.80  | 1,188,639.20  |
| TRANSUNION                   | 33,722  | 104.68 | 3,530,018.96  |
| VERISK ANALYTICS INC         | 26,711  | 167.80 | 4,482,105.80  |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 46,191  | 120.75 | 5,577,563.25  |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 73,549  | 139.57 | 10,265,233.93 |
| AMERCO                       | 1,855   | 563.63 | 1,045,533.65  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 21,778  | 98.55  | 2,146,221.90  |
| CSX CORP                     | 131,284 | 98.07  | 12,875,021.88 |
| DELTA AIR LINES INC          | 25,351  | 46.08  | 1,168,174.08  |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 30,290  | 124.75 | 3,778,677.50  |
| FEDEX CORP                   | 43,380  | 303.34 | 13,158,889.20 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 14,765  | 163.57 | 2,415,111.05  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 16,054  | 295.60   | 4,745,562.40  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 27,226  | 46.78    | 1,273,632.28  |
| LYFT INC-A                   | 43,172  | 58.56    | 2,528,152.32  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 43,348  | 274.82   | 11,912,897.36 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 16,858  | 254.29   | 4,286,820.82  |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 23,466  | 58.28    | 1,367,598.48  |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 207,844 | 50.76    | 10,550,161.44 |
| UNION PACIFIC CORP           | 115,298 | 222.95   | 25,705,689.10 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 124,038 | 212.92   | 26,410,170.96 |
| XPO LOGISTICS INC            | 14,417  | 142.72   | 2,057,594.24  |
| APTIV PLC                    | 46,968  | 157.25   | 7,385,718.00  |
| AUTOLIV INC                  | 15,532  | 106.80   | 1,658,817.60  |
| BORGWARNER INC               | 39,617  | 53.11    | 2,104,058.87  |
| FORD MOTOR CO                | 672,236 | 15.88    | 10,675,107.68 |
| GENERAL MOTORS CO            | 223,183 | 63.23    | 14,111,861.09 |
| LEAR CORP                    | 9,633   | 196.99   | 1,897,604.67  |
| TESLA INC                    | 132,382 | 605.13   | 80,108,319.66 |
| DR HORTON INC                | 59,174  | 92.33    | 5,463,535.42  |
| GARMIN LTD                   | 25,508  | 143.27   | 3,654,531.16  |
| HASBRO INC                   | 23,143  | 94.75    | 2,192,799.25  |
| LENNAR CORP-A                | 48,024  | 95.76    | 4,598,778.24  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 21,555  | 331.61   | 7,147,853.55  |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 10,585  | 201.25   | 2,130,231.25  |
| NEWELL BRANDS INC            | 65,665  | 28.21    | 1,852,409.65  |
| NIKE INC -CL B               | 218,860 | 133.95   | 29,316,297.00 |
| NVR INC                      | 611     | 4,808.51 | 2,937,999.61  |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A    | 42,234  | 109.79   | 4,636,870.86  |
| PULTEGROUP INC               | 46,265  | 56.71    | 2,623,688.15  |
| VF CORP                      | 57,318  | 79.27    | 4,543,597.86  |
| WHIRLPOOL CORP               | 11,006  | 235.79   | 2,595,104.74  |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 10,409  | 148.97   | 1,550,628.73  |
| ARAMARK                      | 41,183  | 36.12    | 1,487,529.96  |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 7,051   | 2,298.52 | 16,206,864.52 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    | 35,013  | 110.60   | 3,872,437.80  |
| CARNIVAL CORP                | 144,447 | 30.89    | 4,461,967.83  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 4,918   | 1,323.26 | 6,507,792.68  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 22,691  | 137.29   | 3,115,247.39  |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 6,795   | 437.92   | 2,975,666.40  |
| DRAFTKINGS INC - CL A        | 27,687  | 53.51    | 1,481,531.37  |
| EXPEDIA GROUP INC            | 23,493  | 170.35   | 4,002,032.55  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 48,468  | 124.90   | 6,053,653.20  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 60,653  | 56.52    | 3,428,107.56  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 47,802  | 142.48   | 6,810,828.96  |

|                              |         |          |                |
|------------------------------|---------|----------|----------------|
| MCDONALD'S CORP              | 128,410 | 231.69   | 29,751,312.90  |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 33,367  | 16.91    | 564,235.97     |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 66,374  | 43.41    | 2,881,295.34   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 40,068  | 94.48    | 3,785,624.64   |
| STARBUCKS CORP               | 202,638 | 111.33   | 22,559,688.54  |
| VAIL RESORTS INC             | 7,224   | 334.27   | 2,414,766.48   |
| WYNN RESORTS LTD             | 18,597  | 129.10   | 2,400,872.70   |
| YUM! BRANDS INC              | 51,396  | 118.32   | 6,081,174.72   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 133,792 | 97.12    | 12,993,879.04  |
| ALPHABET INC-CL A            | 71,121  | 2,402.30 | 170,853,978.30 |
| ALPHABET INC-CL C            | 31,946  | 2,466.09 | 78,781,711.14  |
| ALTICE USA INC- A            | 42,738  | 34.15    | 1,459,502.70   |
| CABLE ONE INC                | 926     | 1,777.36 | 1,645,835.36   |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 23,343  | 680.56   | 15,886,312.08  |
| COMCAST CORP-CLASS A         | 787,685 | 56.92    | 44,835,030.20  |
| DISCOVERY INC - A            | 25,556  | 31.24    | 798,369.44     |
| DISCOVERY INC-C              | 58,763  | 29.34    | 1,724,106.42   |
| DISH NETWORK CORP-A          | 40,567  | 45.03    | 1,826,732.01   |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 50,209  | 145.72   | 7,316,455.48   |
| FACEBOOK INC-CLASS A         | 414,465 | 336.58   | 139,500,629.70 |
| FOX CORP - CLASS A           | 53,639  | 37.15    | 1,992,688.85   |
| FOX CORP - CLASS B           | 27,207  | 35.60    | 968,569.20     |
| IAC/INTERACTIVECORP          | 12,953  | 158.20   | 2,049,164.60   |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 64,665  | 33.44    | 2,162,397.60   |
| LIBERTY BROADBAND-A          | 4,561   | 157.43   | 718,038.23     |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 26,742  | 160.85   | 4,301,450.70   |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 14,828  | 44.24    | 655,990.72     |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 32,763  | 44.36    | 1,453,366.68   |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 33,820  | 44.32    | 1,498,902.40   |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 27,011  | 89.70    | 2,422,886.70   |
| MATCH GROUP INC              | 44,508  | 143.48   | 6,386,007.84   |
| NETFLIX INC                  | 76,352  | 494.66   | 37,768,280.32  |
| NEWS CORP - CLASS A          | 72,117  | 25.85    | 1,864,224.45   |
| OMNICOM GROUP                | 37,720  | 82.78    | 3,122,461.60   |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 90,050  | 65.43    | 5,891,971.50   |
| ROKU INC                     | 19,004  | 341.06   | 6,481,504.24   |
| SEA LTD-ADR                  | 2,334   | 257.32   | 600,584.88     |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 173,853 | 6.60     | 1,147,429.80   |
| SNAP INC - A                 | 162,266 | 61.37    | 9,958,264.42   |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 19,590  | 184.26   | 3,609,653.40   |
| TWITTER INC                  | 137,032 | 59.63    | 8,171,218.16   |
| VIACOMCBS INC - CLASS B      | 98,400  | 41.74    | 4,107,216.00   |

|                              |         |          |                |  |
|------------------------------|---------|----------|----------------|--|
| WALT DISNEY CO/THE           | 312,853 | 176.99   | 55,371,852.47  |  |
| ZILLOW GROUP INC - A         | 9,232   | 114.40   | 1,056,140.80   |  |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 27,662  | 112.57   | 3,113,911.34   |  |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 10,935  | 193.01   | 2,110,564.35   |  |
| AMAZON.COM INC               | 73,784  | 3,198.01 | 235,961,969.84 |  |
| AUTOZONE INC                 | 3,873   | 1,384.65 | 5,362,749.45   |  |
| BEST BUY CO INC              | 40,222  | 117.10   | 4,709,996.20   |  |
| BURLINGTON STORES INC        | 11,742  | 303.67   | 3,565,693.14   |  |
| CARMAX INC                   | 28,962  | 114.56   | 3,317,886.72   |  |
| CARVANA CO                   | 11,839  | 279.85   | 3,313,144.15   |  |
| CHEWY INC - CLASS A          | 12,701  | 78.56    | 997,790.56     |  |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 42,255  | 206.00   | 8,704,530.00   |  |
| DOLLAR TREE INC              | 40,681  | 100.35   | 4,082,338.35   |  |
| EBAY INC                     | 118,370 | 65.45    | 7,747,316.50   |  |
| ETSY INC                     | 21,447  | 168.32   | 3,609,959.04   |  |
| GENUINE PARTS CO             | 25,129  | 127.87   | 3,213,245.23   |  |
| HOME DEPOT INC               | 185,496 | 309.96   | 57,496,340.16  |  |
| L BRANDS INC                 | 39,591  | 66.14    | 2,618,548.74   |  |
| LKQ CORP                     | 51,448  | 49.53    | 2,548,219.44   |  |
| LOWE'S COS INC               | 125,899 | 190.25   | 23,952,284.75  |  |
| MERCADOLIBRE INC             | 7,808   | 1,325.19 | 10,347,083.52  |  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 12,162  | 525.44   | 6,390,401.28   |  |
| POOL CORP                    | 7,221   | 435.55   | 3,145,106.55   |  |
| ROSS STORES INC              | 61,571  | 119.22   | 7,340,494.62   |  |
| TARGET CORP                  | 86,326  | 230.89   | 19,931,810.14  |  |
| TJX COMPANIES INC            | 206,643 | 65.32    | 13,497,920.76  |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 20,292  | 181.20   | 3,676,910.40   |  |
| ULTA BEAUTY INC              | 9,179   | 332.80   | 3,054,771.20   |  |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 12,890  | 327.95   | 4,227,275.50   |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 76,273  | 380.40   | 29,014,249.20  |  |
| KROGER CO                    | 128,112 | 38.97    | 4,992,524.64   |  |
| SYSCO CORP                   | 89,079  | 79.83    | 7,111,176.57   |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 129,031 | 54.56    | 7,039,931.36   |  |
| WALMART INC                  | 268,222 | 140.90   | 37,792,479.80  |  |
| ALTRIA GROUP INC             | 320,627 | 50.49    | 16,188,457.23  |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 94,557  | 68.66    | 6,492,283.62   |  |
| BOSTON BEER COMPANY INC-A    | 1,500   | 1,089.89 | 1,634,835.00   |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 53,669  | 79.96    | 4,291,373.24   |  |
| BUNGE LTD                    | 24,555  | 89.60    | 2,200,128.00   |  |
| CAMPBELL SOUP CO             | 35,550  | 49.46    | 1,758,303.00   |  |
| COCA-COLA CO/THE             | 705,199 | 56.04    | 39,519,351.96  |  |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 37,424  | 61.85    | 2,314,674.40   |  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| CONAGRA BRANDS INC           | 83,052  | 38.79  | 3,221,587.08  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 29,345  | 239.08 | 7,015,802.60  |
| GENERAL MILLS INC            | 107,517 | 63.72  | 6,850,983.24  |
| HERSHEY CO/THE               | 25,030  | 173.99 | 4,354,969.70  |
| HORMEL FOODS CORP            | 52,918  | 49.18  | 2,602,507.24  |
| JM SMUCKER CO/THE            | 18,418  | 138.13 | 2,544,078.34  |
| KELLOGG CO                   | 44,204  | 66.41  | 2,935,587.64  |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 124,118 | 36.84  | 4,572,507.12  |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 116,102 | 43.88  | 5,094,555.76  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 26,561  | 83.80  | 2,225,811.80  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 41,989  | 89.49  | 3,757,595.61  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 32,241  | 60.66  | 1,955,739.06  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 242,543 | 63.67  | 15,442,712.81 |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 66,521  | 94.30  | 6,272,930.30  |
| PEPSICO INC                  | 237,469 | 147.75 | 35,086,044.75 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 268,391 | 98.56  | 26,452,616.96 |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 51,337  | 78.33  | 4,021,227.21  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 42,268  | 86.02  | 3,635,893.36  |
| CLOROX COMPANY               | 21,890  | 178.64 | 3,910,429.60  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 138,731 | 83.90  | 11,639,530.90 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 39,551  | 302.96 | 11,982,370.96 |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 58,773  | 131.08 | 7,703,964.84  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 424,547 | 136.42 | 57,916,701.74 |
| ABBOTT LABORATORIES          | 305,482 | 110.00 | 33,603,020.00 |
| ABIOMED INC                  | 7,450   | 291.15 | 2,169,067.50  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 12,914  | 580.27 | 7,493,606.78  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 26,246  | 118.26 | 3,103,851.96  |
| ANTHEM INC                   | 42,178  | 389.10 | 16,411,459.80 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 87,908  | 81.26  | 7,143,404.08  |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 50,252  | 239.56 | 12,038,369.12 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 243,910 | 42.14  | 10,278,367.40 |
| CARDINAL HEALTH INC          | 50,074  | 58.90  | 2,949,358.60  |
| CENTENE CORP                 | 101,894 | 71.28  | 7,263,004.32  |
| CERNER CORP                  | 53,270  | 79.53  | 4,236,563.10  |
| CIGNA CORP                   | 60,578  | 247.60 | 14,999,112.80 |
| COOPER COS INC/THE           | 8,172   | 374.40 | 3,059,596.80  |
| CVS HEALTH CORP              | 225,904 | 86.33  | 19,502,292.32 |
| DANAHER CORP                 | 110,507 | 240.24 | 26,548,201.68 |
| DAVITA INC                   | 12,840  | 118.68 | 1,523,851.20  |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 38,227  | 65.52  | 2,504,633.04  |
| DEXCOM INC                   | 16,874  | 386.98 | 6,529,900.52  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 108,523 | 96.34  | 10,455,105.82 |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| HCA HEALTHCARE INC           | 47,396  | 211.87 | 10,041,790.52 |
| HENRY SCHEIN INC             | 22,951  | 77.30  | 1,774,112.30  |
| HOLOGIC INC                  | 42,191  | 60.89  | 2,569,009.99  |
| HUMANA INC                   | 22,158  | 416.00 | 9,217,728.00  |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 14,740  | 560.35 | 8,259,559.00  |
| INSULET CORP                 | 11,224  | 276.11 | 3,099,058.64  |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 20,275  | 831.12 | 16,850,958.00 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 16,770  | 264.06 | 4,428,286.20  |
| MASIMO CORP                  | 8,570   | 209.11 | 1,792,072.70  |
| MCKESSON CORP                | 26,972  | 195.03 | 5,260,349.16  |
| MEDTRONIC PLC                | 232,048 | 123.96 | 28,764,670.08 |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 10,275  | 245.20 | 2,519,430.00  |
| NOVOCURE LTD                 | 15,696  | 209.48 | 3,287,998.08  |
| OAK STREET HEALTH INC        | 16,100  | 57.95  | 932,995.00    |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 23,155  | 128.93 | 2,985,374.15  |
| RESMED INC                   | 25,507  | 206.70 | 5,272,296.90  |
| STERIS PLC                   | 17,234  | 193.83 | 3,340,466.22  |
| STRYKER CORP                 | 58,273  | 249.54 | 14,541,444.42 |
| TELADOC HEALTH INC           | 22,758  | 151.95 | 3,458,078.10  |
| TELEFLEX INC                 | 8,089   | 392.77 | 3,177,116.53  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 163,474 | 400.25 | 65,430,468.50 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 12,462  | 158.98 | 1,981,208.76  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 23,694  | 291.45 | 6,905,616.30  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 12,604  | 333.32 | 4,201,165.28  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 35,168  | 157.90 | 5,553,027.20  |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A     | 12,339  | 185.28 | 2,286,169.92  |
| ABBVIE INC                   | 304,350 | 113.01 | 34,394,593.50 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 51,703  | 137.65 | 7,116,917.95  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 38,678  | 176.28 | 6,818,157.84  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 21,047  | 150.46 | 3,166,731.62  |
| AMGEN INC                    | 99,495  | 237.19 | 23,599,219.05 |
| AVANTOR INC                  | 86,599  | 31.38  | 2,717,476.62  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 3,710   | 579.58 | 2,150,241.80  |
| BIO-TECHNE CORP              | 6,399   | 419.73 | 2,685,852.27  |
| BIOGEN INC                   | 25,682  | 395.85 | 10,166,219.70 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 32,256  | 78.66  | 2,537,256.96  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 386,120 | 64.77  | 25,008,992.40 |
| CATALENT INC                 | 29,018  | 103.92 | 3,015,550.56  |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   | 8,976   | 340.24 | 3,053,994.24  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 75,002  | 33.56  | 2,517,067.12  |
| ELI LILLY & CO               | 140,504 | 222.52 | 31,264,950.08 |
| EXACT SCIENCES CORP          | 28,409  | 112.06 | 3,183,512.54  |

|                              |           |          |               |
|------------------------------|-----------|----------|---------------|
| GILEAD SCIENCES INC          | 216,670   | 67.42    | 14,607,891.40 |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 36,017    | 89.47    | 3,222,440.99  |
| ILLUMINA INC                 | 25,481    | 430.34   | 10,965,493.54 |
| INCYTE CORP                  | 30,744    | 85.11    | 2,616,621.84  |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 33,325    | 233.20   | 7,771,390.00  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 10,576    | 176.47   | 1,866,346.72  |
| JOHNSON & JOHNSON            | 453,133   | 164.84   | 74,694,443.72 |
| MERCK & CO. INC.             | 436,012   | 72.80    | 31,741,673.60 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 3,980     | 1,248.77 | 4,970,104.60  |
| MODERNA INC                  | 54,618    | 219.57   | 11,992,474.26 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 17,091    | 95.26    | 1,628,088.66  |
| NOVAVAX INC                  | 11,800    | 195.04   | 2,301,472.00  |
| ORGANON & CO                 | 42,614    | 31.42    | 1,338,931.88  |
| PERKINELMER INC              | 19,601    | 137.52   | 2,695,529.52  |
| PFIZER INC                   | 961,600   | 38.99    | 37,492,784.00 |
| PPD INC                      | 21,251    | 46.46    | 987,321.46    |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 18,377    | 514.99   | 9,463,971.23  |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 28,088    | 46.46    | 1,304,968.48  |
| SEAGEN INC                   | 24,135    | 154.01   | 3,717,031.35  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 197,925   | 10.75    | 2,127,693.75  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 67,877    | 444.45   | 30,167,932.65 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 44,322    | 209.16   | 9,270,389.52  |
| VIATRIS INC                  | 219,303   | 15.39    | 3,375,073.17  |
| WATERS CORP                  | 10,770    | 318.71   | 3,432,506.70  |
| ZOETIS INC                   | 81,817    | 175.10   | 14,326,156.70 |
| BANK OF AMERICA CORP         | 1,338,647 | 43.12    | 57,722,458.64 |
| CITIGROUP INC                | 358,152   | 79.31    | 28,405,035.12 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 73,368    | 49.90    | 3,661,063.20  |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 125,717   | 41.99    | 5,278,856.83  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 30,844    | 194.48   | 5,998,541.12  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 167,667   | 15.58    | 2,612,251.86  |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 525,799   | 165.66   | 87,103,862.34 |
| KEYCORP                      | 165,986   | 22.74    | 3,774,521.64  |
| M & T BANK CORP              | 22,818    | 159.72   | 3,644,490.96  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 72,926    | 193.11   | 14,082,739.86 |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 163,675   | 22.51    | 3,684,324.25  |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 8,739     | 602.38   | 5,264,198.82  |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 231,896   | 60.06    | 13,927,673.76 |
| US BANCORP                   | 245,865   | 60.54    | 14,884,667.10 |
| WELLS FARGO & CO             | 711,773   | 47.11    | 33,531,626.03 |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 97,485    | 18.68    | 1,821,019.80  |
| ALLY FINANCIAL INC           | 66,574    | 55.03    | 3,663,567.22  |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 117,838   | 165.92   | 19,551,680.96 |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 19,986  | 264.86 | 5,293,491.96  |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 232,296 | 9.44   | 2,192,874.24  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 28,586  | 57.74  | 1,650,555.64  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 145,276 | 51.82  | 7,528,202.32  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 236,089 | 289.46 | 68,338,321.94 |
| BLACKROCK INC                | 26,300  | 884.96 | 23,274,448.00 |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE     | 118,062 | 94.40  | 11,145,052.80 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 79,097  | 163.55 | 12,936,314.35 |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 30,798  | 43.49  | 1,339,405.02  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 17,518  | 112.00 | 1,962,016.00  |
| CME GROUP INC                | 61,938  | 218.10 | 13,508,677.80 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 53,442  | 123.59 | 6,604,896.78  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 64,715  | 31.45  | 2,035,286.75  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 6,752   | 323.15 | 2,181,908.80  |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 54,457  | 35.45  | 1,930,500.65  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        | 8,000   | 150.39 | 1,203,120.00  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 59,494  | 388.16 | 23,093,191.04 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 97,405  | 110.40 | 10,753,512.00 |
| INVESCO LTD                  | 72,369  | 28.99  | 2,097,977.31  |
| KKR & CO INC                 | 88,984  | 54.13  | 4,816,703.92  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 6,793   | 448.59 | 3,047,271.87  |
| MOODY'S CORP                 | 29,000  | 335.07 | 9,717,030.00  |
| MORGAN STANLEY               | 242,989 | 93.21  | 22,649,004.69 |
| MSCI INC                     | 14,343  | 464.37 | 6,660,458.91  |
| NASDAQ INC                   | 19,614  | 168.90 | 3,312,804.60  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 34,539  | 118.93 | 4,107,723.27  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 21,161  | 130.67 | 2,765,107.87  |
| S&P GLOBAL INC               | 41,448  | 381.23 | 15,801,221.04 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 248,893 | 74.73  | 18,599,773.89 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 19,838  | 64.19  | 1,273,401.22  |
| STATE STREET CORP            | 60,092  | 86.41  | 5,192,549.72  |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 103,041 | 50.45  | 5,198,418.45  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 39,503  | 195.44 | 7,720,466.32  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 17,305  | 80.98  | 1,401,358.90  |
| VOYA FINANCIAL INC           | 19,576  | 65.01  | 1,272,635.76  |
| AFLAC INC                    | 111,942 | 57.39  | 6,424,351.38  |
| ALLEGHANY CORP               | 2,345   | 699.56 | 1,640,468.20  |
| ALLSTATE CORP                | 52,981  | 134.49 | 7,125,414.69  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 12,222  | 119.77 | 1,463,828.94  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 150,100 | 53.07  | 7,965,807.00  |
| AON PLC-CLASS A              | 38,679  | 247.52 | 9,573,826.08  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 72,227  | 39.71  | 2,868,134.17  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 32,991  | 143.54   | 4,735,528.14  |
| ASSURANT INC                 | 10,655  | 162.55   | 1,731,970.25  |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 21,360  | 63.09    | 1,347,602.40  |
| BROWN & BROWN INC            | 43,444  | 51.71    | 2,246,489.24  |
| CHUBB LTD                    | 77,611  | 169.45   | 13,151,183.95 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 27,292  | 122.76   | 3,350,365.92  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 4,123   | 193.82   | 799,119.86    |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 6,504   | 257.79   | 1,676,666.16  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 50,119  | 46.98    | 2,354,590.62  |
| GLOBE LIFE INC               | 15,456  | 106.47   | 1,645,600.32  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 62,914  | 65.17    | 4,100,105.38  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 31,540  | 71.04    | 2,240,601.60  |
| LOEWS CORP                   | 40,057  | 57.31    | 2,295,666.67  |
| MARKEL CORP                  | 2,386   | 1,210.15 | 2,887,417.90  |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 87,502  | 137.97   | 12,072,650.94 |
| METLIFE INC                  | 127,764 | 66.21    | 8,459,254.44  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 48,762  | 65.52    | 3,194,886.24  |
| PROGRESSIVE CORP             | 102,019 | 96.39    | 9,833,611.41  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 69,333  | 108.07   | 7,492,817.31  |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 12,472  | 127.13   | 1,585,565.36  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD   | 8,293   | 150.01   | 1,244,032.93  |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 42,562  | 157.76   | 6,714,581.12  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 21,244  | 256.99   | 5,459,495.56  |
| WR BERKLEY CORP              | 23,267  | 75.69    | 1,761,079.23  |
| CBRE GROUP INC - A           | 57,353  | 87.74    | 5,032,152.22  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 200,400 | 4.95     | 991,980.00    |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 109,252 | 282.19   | 30,829,821.88 |
| ADOBE INC                    | 82,558  | 509.47   | 42,060,824.26 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 29,081  | 115.95   | 3,371,941.95  |
| ANSYS INC                    | 14,715  | 328.57   | 4,834,907.55  |
| AUTODESK INC                 | 38,271  | 278.89   | 10,673,399.19 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 73,773  | 196.72   | 14,512,624.56 |
| AVALARA INC                  | 14,242  | 130.71   | 1,861,571.82  |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  | 28,800  | 62.36    | 1,795,968.00  |
| BLACK KNIGHT INC             | 25,802  | 72.40    | 1,868,064.80  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 20,693  | 158.28   | 3,275,288.04  |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 48,854  | 124.93   | 6,103,330.22  |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | 21,903  | 86.11    | 1,886,067.33  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 18,153  | 118.24   | 2,146,410.72  |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 20,174  | 117.06   | 2,361,568.44  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 37,932  | 85.84    | 3,256,082.88  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 92,160  | 71.30    | 6,571,008.00  |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| COUPA SOFTWARE INC           | 12,172    | 236.73 | 2,881,477.56   |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 30,918    | 215.41 | 6,660,046.38   |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 6,282     | 130.46 | 819,549.72     |
| DATADOG INC - CLASS A        | 31,451    | 90.62  | 2,850,089.62   |
| DOCUSIGN INC                 | 32,810    | 240.97 | 7,906,225.70   |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 53,333    | 29.13  | 1,553,590.29   |
| DYNATRACE INC                | 34,198    | 51.62  | 1,765,300.76   |
| EPAM SYSTEMS INC             | 9,540     | 487.67 | 4,652,371.80   |
| FAIR ISAAC CORP              | 5,224     | 484.71 | 2,532,125.04   |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 107,014   | 143.53 | 15,359,719.42  |
| FISERV INC                   | 103,691   | 109.66 | 11,370,755.06  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 13,182    | 272.51 | 3,592,226.82   |
| FORTINET INC                 | 23,639    | 223.54 | 5,284,262.06   |
| GARTNER INC                  | 15,565    | 231.10 | 3,597,071.50   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 50,881    | 191.20 | 9,728,447.20   |
| GODADDY INC - CLASS A        | 30,001    | 80.99  | 2,429,780.99   |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       | 13,245    | 103.72 | 1,373,771.40   |
| HUBSPOT INC                  | 7,437     | 498.59 | 3,708,013.83   |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 153,996   | 148.02 | 22,794,487.92  |
| INTUIT INC                   | 47,219    | 457.21 | 21,588,998.99  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC  | 13,547    | 156.20 | 2,116,041.40   |
| MASTERCARD INC - A           | 152,808   | 364.08 | 55,634,336.64  |
| MICROSOFT CORP               | 1,235,229 | 253.81 | 313,513,472.49 |
| MONGODB INC                  | 9,429     | 314.50 | 2,965,420.50   |
| NORTONLIFELOCK INC           | 98,167    | 28.43  | 2,790,887.81   |
| OKTA INC                     | 20,546    | 216.44 | 4,446,976.24   |
| ORACLE CORP                  | 330,032   | 83.94  | 27,702,886.08  |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 88,800    | 24.46  | 2,172,048.00   |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 16,645    | 356.37 | 5,931,778.65   |
| PAYCHEX INC                  | 54,667    | 101.75 | 5,562,367.25   |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 8,956     | 320.24 | 2,868,069.44   |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 191,916   | 260.60 | 50,013,309.60  |
| PTC INC                      | 18,174    | 132.57 | 2,409,327.18   |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A      | 13,104    | 253.15 | 3,317,277.60   |
| SALESFORCE.COM INC           | 158,270   | 238.14 | 37,690,417.80  |
| SERVICENOW INC               | 33,875    | 459.46 | 15,564,207.50  |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A | 80,376    | 44.33  | 3,563,068.08   |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 4,064     | 250.57 | 1,018,316.48   |
| SPLUNK INC                   | 28,159    | 115.69 | 3,257,714.71   |
| SQUARE INC - A               | 67,274    | 216.95 | 14,595,094.30  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 39,732    | 72.34  | 2,874,212.88   |
| SYNOPSYS INC                 | 26,479    | 252.59 | 6,688,330.61   |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 7,171     | 599.85 | 4,301,524.35   |
| TWILIO INC - A               | 27,065    | 314.52 | 8,512,483.80   |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 7,337     | 407.55 | 2,990,194.35   |
| UNITY SOFTWARE INC           | 9,500     | 98.10  | 931,950.00     |
| VERISIGN INC                 | 16,557    | 218.93 | 3,624,824.01   |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 292,239   | 231.32 | 67,600,725.48  |
| VMWARE INC-CLASS A           | 14,881    | 161.15 | 2,398,073.15   |
| WESTERN UNION CO             | 67,086    | 24.63  | 1,652,328.18   |
| WIX.COM LTD                  | 9,965     | 264.05 | 2,631,258.25   |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 31,185    | 225.65 | 7,036,895.25   |
| ZENDESK INC                  | 20,855    | 135.22 | 2,820,013.10   |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 35,338    | 342.66 | 12,108,919.08  |
| ZSCALER INC                  | 13,588    | 192.73 | 2,618,815.24   |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 103,946   | 68.19  | 7,088,077.74   |
| APPLE INC                    | 2,894,025 | 125.90 | 364,357,747.50 |
| ARISTA NETWORKS INC          | 9,871     | 352.51 | 3,479,626.21   |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 12,286    | 120.90 | 1,485,377.40   |
| CDW CORP/DE                  | 23,998    | 165.76 | 3,977,908.48   |
| CISCO SYSTEMS INC            | 726,823   | 53.92  | 39,190,296.16  |
| COGNEX CORP                  | 31,493    | 78.31  | 2,466,216.83   |
| CORNING INC                  | 130,098   | 42.60  | 5,542,174.80   |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 45,097    | 102.84 | 4,637,775.48   |
| F5 NETWORKS INC              | 11,176    | 187.31 | 2,093,376.56   |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 221,629   | 15.90  | 3,523,901.10   |
| HP INC                       | 217,953   | 30.55  | 6,658,464.15   |
| IPG PHOTONICS CORP           | 7,070     | 205.78 | 1,454,864.60   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 55,446    | 27.97  | 1,550,824.62   |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN     | 32,977    | 148.15 | 4,885,542.55   |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 28,960    | 207.69 | 6,014,702.40   |
| NETAPP INC                   | 40,158    | 81.03  | 3,254,002.74   |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  | 35,461    | 98.65  | 3,498,227.65   |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 56,992    | 139.01 | 7,922,457.92   |
| TRIMBLE INC                  | 42,515    | 78.22  | 3,325,523.30   |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 51,582    | 76.13  | 3,926,937.66   |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 8,958     | 506.18 | 4,534,360.44   |
| AT&T INC                     | 1,229,356 | 29.08  | 35,749,672.48  |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 69,895    | 27.11  | 1,894,853.45   |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 23,763    | 27.04  | 642,551.52     |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       | 170,566   | 14.78  | 2,520,965.48   |
| T-MOBILE US INC              | 106,982   | 143.51 | 15,352,986.82  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 712,983   | 57.20  | 40,782,627.60  |
| AES CORP                     | 109,785   | 25.32  | 2,779,756.20   |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| ALLIANT ENERGY CORP          | 41,577  | 58.10  | 2,415,623.70  |
| AMEREN CORPORATION           | 45,191  | 86.13  | 3,892,300.83  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 86,001  | 85.67  | 7,367,705.67  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 31,055  | 157.47 | 4,890,230.85  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 23,264  | 100.97 | 2,348,966.08  |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 99,463  | 25.58  | 2,544,263.54  |
| CMS ENERGY CORP              | 49,247  | 62.80  | 3,092,711.60  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 57,499  | 77.31  | 4,445,247.69  |
| DOMINION ENERGY INC          | 139,361 | 76.41  | 10,648,574.01 |
| DTE ENERGY COMPANY           | 33,346  | 137.85 | 4,596,746.10  |
| DUKE ENERGY CORP             | 132,766 | 101.86 | 13,523,544.76 |
| EDISON INTERNATIONAL         | 63,880  | 56.21  | 3,590,694.80  |
| ENTERGY CORP                 | 34,153  | 106.59 | 3,640,368.27  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 42,863  | 47.55  | 2,038,135.65  |
| EVERGY INC                   | 39,259  | 62.68  | 2,460,754.12  |
| EVERSOURCE ENERGY            | 59,019  | 82.11  | 4,846,050.09  |
| EXELON CORP                  | 168,414 | 45.86  | 7,723,466.04  |
| FIRSTENERGY CORP             | 96,252  | 38.57  | 3,712,439.64  |
| NEXTERA ENERGY INC           | 338,118 | 72.47  | 24,503,411.46 |
| NISOURCE INC                 | 70,595  | 25.51  | 1,800,878.45  |
| NRG ENERGY INC               | 39,560  | 34.51  | 1,365,215.60  |
| P G & E CORP                 | 260,107 | 10.30  | 2,679,102.10  |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 18,573  | 86.99  | 1,615,665.27  |
| PPL CORP                     | 130,874 | 29.08  | 3,805,815.92  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 86,741  | 60.87  | 5,279,924.67  |
| SEMPRA ENERGY                | 55,368  | 136.10 | 7,535,584.80  |
| SOUTHERN CO/THE              | 182,886 | 64.67  | 11,827,237.62 |
| UGI CORP                     | 35,036  | 47.41  | 1,661,056.76  |
| VISTRA CORP                  | 71,702  | 17.61  | 1,262,672.22  |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 53,905  | 93.56  | 5,043,351.80  |
| XCEL ENERGY INC              | 93,168  | 70.12  | 6,532,940.16  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 208,847 | 81.35  | 16,989,703.45 |
| ANALOG DEVICES INC           | 64,341  | 164.48 | 10,582,807.68 |
| APPLIED MATERIALS INC        | 157,545 | 138.97 | 21,894,028.65 |
| BROADCOM INC                 | 70,359  | 463.78 | 32,631,097.02 |
| ENPHASE ENERGY INC           | 21,713  | 137.47 | 2,984,886.11  |
| INTEL CORP                   | 700,409 | 57.09  | 39,986,349.81 |
| KLA CORP                     | 26,536  | 318.55 | 8,453,042.80  |
| LAM RESEARCH CORP            | 24,518  | 649.58 | 15,926,402.44 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 137,578 | 48.27  | 6,640,890.06  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 46,401  | 101.50 | 4,709,701.50  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 47,106  | 153.57 | 7,234,068.42  |

|       |                              |            |        |                                       |  |
|-------|------------------------------|------------|--------|---------------------------------------|--|
|       | MICRON TECHNOLOGY INC        | 192,747    | 84.04  | 16,198,457.88                         |  |
|       | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 7,357      | 342.64 | 2,520,802.48                          |  |
|       | NVIDIA CORP                  | 106,713    | 704.76 | 75,207,053.88                         |  |
|       | NXP SEMICONDUCTORS NV        | 47,741     | 201.15 | 9,603,102.15                          |  |
|       | ON SEMICONDUCTOR CORP        | 67,581     | 37.97  | 2,566,050.57                          |  |
|       | QORVO INC                    | 20,150     | 183.86 | 3,704,779.00                          |  |
|       | QUALCOMM INC                 | 195,822    | 133.32 | 26,106,989.04                         |  |
|       | SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 28,527     | 169.72 | 4,841,602.44                          |  |
|       | SOLAREGE TECHNOLOGIES INC    | 9,379      | 233.27 | 2,187,839.33                          |  |
|       | TERADYNE INC                 | 29,118     | 130.80 | 3,808,634.40                          |  |
|       | TEXAS INSTRUMENTS INC        | 158,557    | 188.55 | 29,895,922.35                         |  |
|       | XILINX INC                   | 41,793     | 127.73 | 5,338,219.89                          |  |
|       | アメリカドル 小計                    | 54,745,886 |        | 6,425,033,012.89<br>(703,219,863,260) |  |
| カナダドル | CAMECO CORP                  | 66,500     | 26.06  | 1,732,990.00                          |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 205,700    | 45.32  | 9,322,324.00                          |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC           | 237,900    | 11.44  | 2,721,576.00                          |  |
|       | ENBRIDGE INC                 | 350,400    | 47.74  | 16,728,096.00                         |  |
|       | IMPERIAL OIL LTD             | 47,800     | 41.29  | 1,973,662.00                          |  |
|       | INTER PIPELINE LTD           | 72,900     | 20.10  | 1,465,290.00                          |  |
|       | KEYERA CORP                  | 42,500     | 33.55  | 1,425,875.00                          |  |
|       | PARKLAND CORP                | 25,700     | 41.05  | 1,054,985.00                          |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP        | 96,332     | 38.41  | 3,700,112.12                          |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC            | 258,100    | 30.69  | 7,921,089.00                          |  |
|       | TC ENERGY CORP               | 162,900    | 64.04  | 10,432,116.00                         |  |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD       | 43,700     | 85.20  | 3,723,240.00                          |  |
|       | B2GOLD CORP                  | 168,600    | 6.03   | 1,016,658.00                          |  |
|       | BARRICK GOLD CORP            | 309,400    | 28.28  | 8,749,832.00                          |  |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 28,600     | 67.87  | 1,941,082.00                          |  |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 95,900     | 28.92  | 2,773,428.00                          |  |
|       | FRANCO-NEVADA CORP           | 33,700     | 183.07 | 6,169,459.00                          |  |
|       | IVANHOE MINES LTD-CL A       | 98,700     | 8.65   | 853,755.00                            |  |
|       | KINROSS GOLD CORP            | 226,500    | 9.66   | 2,187,990.00                          |  |
|       | KIRKLAND LAKE GOLD LTD       | 43,300     | 51.79  | 2,242,507.00                          |  |
|       | LUNDIN MINING CORP           | 110,500    | 12.53  | 1,384,565.00                          |  |
|       | NUTRIEN LTD                  | 97,259     | 77.91  | 7,577,448.69                          |  |
|       | PAN AMERICAN SILVER CORP     | 35,800     | 38.73  | 1,386,534.00                          |  |
|       | TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 83,000     | 28.88  | 2,397,040.00                          |  |
|       | WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 13,200     | 87.15  | 1,150,380.00                          |  |
|       | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 78,100     | 58.22  | 4,546,982.00                          |  |
|       | YAMANA GOLD INC              | 164,600    | 6.29   | 1,035,334.00                          |  |
|       | BALLARD POWER SYSTEMS INC    | 36,200     | 21.83  | 790,246.00                            |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| CAE INC                      | 50,900  | 36.76  | 1,871,084.00  |  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD      | 14,300  | 108.10 | 1,545,830.00  |  |
| WSP GLOBAL INC               | 20,200  | 134.59 | 2,718,718.00  |  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 29,100  | 38.49  | 1,120,059.00  |  |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS     | 21,400  | 70.17  | 1,501,638.00  |  |
| THOMSON REUTERS CORP         | 30,732  | 117.44 | 3,609,166.08  |  |
| AIR CANADA                   | 34,500  | 26.95  | 929,775.00    |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 122,600 | 134.08 | 16,438,208.00 |  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 115,800 | 96.93  | 11,224,494.00 |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 48,800  | 120.65 | 5,887,720.00  |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 33,700  | 43.14  | 1,453,818.00  |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 47,810  | 82.97  | 3,966,795.70  |  |
| QUEBECOR INC -CL B           | 25,900  | 32.85  | 850,815.00    |  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 77,500  | 36.22  | 2,807,050.00  |  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 10,500  | 201.45 | 2,115,225.00  |  |
| DOLLARAMA INC                | 52,400  | 53.64  | 2,810,736.00  |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  | 147,100 | 44.85  | 6,597,435.00  |  |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 30,200  | 41.63  | 1,257,226.00  |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 27,700  | 75.51  | 2,091,627.00  |  |
| METRO INC/CN                 | 40,100  | 58.83  | 2,359,083.00  |  |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 12,511  | 119.15 | 1,490,685.65  |  |
| SAPUTO INC                   | 46,600  | 36.81  | 1,715,346.00  |  |
| BAUSCH HEALTH COS INC        | 51,300  | 38.19  | 1,959,147.00  |  |
| CANOPY GROWTH CORP           | 36,500  | 30.95  | 1,129,675.00  |  |
| BANK OF MONTREAL             | 111,500 | 128.55 | 14,333,325.00 |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 208,900 | 81.15  | 16,952,235.00 |  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 77,500  | 145.08 | 11,243,700.00 |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 58,700  | 92.96  | 5,456,752.00  |  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 245,400 | 126.03 | 30,927,762.00 |  |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 312,500 | 87.92  | 27,475,000.00 |  |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 223,250 | 60.57  | 13,522,252.50 |  |
| IGM FINANCIAL INC            | 11,600  | 44.97  | 521,652.00    |  |
| ONEX CORPORATION             | 11,900  | 87.37  | 1,039,703.00  |  |
| TMX GROUP LTD                | 9,400   | 132.39 | 1,244,466.00  |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 4,700   | 564.95 | 2,655,265.00  |  |
| GREAT-WEST LIFE CO INC       | 44,500  | 36.91  | 1,642,495.00  |  |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 20,500  | 69.72  | 1,429,260.00  |  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 24,400  | 168.88 | 4,120,672.00  |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 327,200 | 25.14  | 8,225,808.00  |  |
| POWER CORP OF CANADA         | 95,800  | 39.70  | 3,803,260.00  |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 99,200  | 64.97  | 6,445,024.00  |  |
| FIRSTSERVICE CORP            | 6,100   | 200.84 | 1,225,124.00  |  |

|               |                              |           |          |                                    |  |
|---------------|------------------------------|-----------|----------|------------------------------------|--|
|               | BLACKBERRY LTD               | 86,600    | 19.01    | 1,646,266.00                       |  |
|               | CGI INC                      | 38,000    | 108.73   | 4,131,740.00                       |  |
|               | CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 3,400     | 1,758.76 | 5,979,784.00                       |  |
|               | LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE  | 16,400    | 87.21    | 1,430,244.00                       |  |
|               | NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG   | 8,500     | 82.78    | 703,630.00                         |  |
|               | OPEN TEXT CORP               | 44,900    | 58.95    | 2,646,855.00                       |  |
|               | SHOPIFY INC - CLASS A        | 19,300    | 1,482.94 | 28,620,742.00                      |  |
|               | BCE INC                      | 9,600     | 61.33    | 588,768.00                         |  |
|               | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 58,900    | 63.74    | 3,754,286.00                       |  |
|               | TELUS CORP                   | 50,100    | 28.07    | 1,406,307.00                       |  |
|               | ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 95,200    | 18.97    | 1,805,944.00                       |  |
|               | ALTAGAS LTD                  | 41,300    | 24.51    | 1,012,263.00                       |  |
|               | ATCO LTD -CLASS I            | 9,600     | 44.63    | 428,448.00                         |  |
|               | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 20,850    | 49.01    | 1,021,858.50                       |  |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 23,200    | 35.61    | 826,152.00                         |  |
|               | EMERA INC                    | 45,300    | 56.93    | 2,578,929.00                       |  |
|               | FORTIS INC                   | 82,200    | 55.52    | 4,563,744.00                       |  |
|               | HYDRO ONE LTD                | 55,500    | 30.98    | 1,719,390.00                       |  |
|               | NORTHLAND POWER INC          | 41,100    | 40.73    | 1,674,003.00                       |  |
|               | カナダドル 小計                     | 7,004,944 |          | 406,659,061.24<br>(36,839,244,357) |  |
| オーストラリア<br>ドル | AMPOL LTD                    | 42,710    | 29.81    | 1,273,185.10                       |  |
|               | OIL SEARCH LTD               | 324,022   | 4.13     | 1,338,210.86                       |  |
|               | SANTOS LTD                   | 299,069   | 7.70     | 2,302,831.30                       |  |
|               | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 13,920    | 30.38    | 422,889.60                         |  |
|               | WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 159,193   | 24.01    | 3,822,223.93                       |  |
|               | BHP GROUP LTD                | 508,262   | 48.85    | 24,828,598.70                      |  |
|               | BLUESCOPE STEEL LTD          | 80,098    | 22.46    | 1,799,001.08                       |  |
|               | EVOLUTION MINING LTD         | 271,023   | 5.04     | 1,365,955.92                       |  |
|               | FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 287,841   | 22.65    | 6,519,598.65                       |  |
|               | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 77,792    | 43.10    | 3,352,835.20                       |  |
|               | NEWCREST MINING LTD          | 133,680   | 27.60    | 3,689,568.00                       |  |
|               | NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 201,130   | 10.93    | 2,198,350.90                       |  |
|               | ORICA LTD                    | 81,415    | 14.13    | 1,150,393.95                       |  |
|               | RIO TINTO LTD                | 64,629    | 125.33   | 8,099,952.57                       |  |
|               | SOUTH32 LTD                  | 873,722   | 3.00     | 2,621,166.00                       |  |
|               | REECE LTD                    | 46,100    | 22.83    | 1,052,463.00                       |  |
|               | BRAMBLES LTD                 | 262,576   | 11.02    | 2,893,587.52                       |  |
|               | AURIZON HOLDINGS LTD         | 316,214   | 3.79     | 1,198,451.06                       |  |
|               | QANTAS AIRWAYS LTD           | 157,727   | 4.78     | 753,935.06                         |  |
|               | SYDNEY AIRPORT               | 212,579   | 6.10     | 1,296,731.90                       |  |
|               | TRANSURBAN GROUP             | 483,961   | 14.36    | 6,949,679.96                       |  |

|         |                              |            |        |                                    |  |
|---------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
|         | ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 101,570    | 40.55  | 4,118,663.50                       |  |
|         | CROWN RESORTS LTD            | 68,133     | 12.50  | 851,662.50                         |  |
|         | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 9,800      | 115.88 | 1,135,624.00                       |  |
|         | TABCORP HOLDINGS LTD         | 359,038    | 5.07   | 1,820,322.66                       |  |
|         | REA GROUP LTD                | 8,604      | 165.22 | 1,421,552.88                       |  |
|         | SEEK LTD                     | 52,612     | 30.37  | 1,597,826.44                       |  |
|         | WESFARMERS LTD               | 196,026    | 54.76  | 10,734,383.76                      |  |
|         | COLES GROUP LTD              | 240,603    | 17.06  | 4,104,687.18                       |  |
|         | WOOLWORTHS GROUP LTD         | 220,542    | 43.54  | 9,602,398.68                       |  |
|         | TREASURY WINE ESTATES LTD    | 124,673    | 11.95  | 1,489,842.35                       |  |
|         | COCHLEAR LTD                 | 12,024     | 230.20 | 2,767,924.80                       |  |
|         | RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 33,124     | 62.07  | 2,056,006.68                       |  |
|         | SONIC HEALTHCARE LTD         | 81,561     | 35.27  | 2,876,656.47                       |  |
|         | CSL LTD                      | 78,476     | 292.57 | 22,959,723.32                      |  |
|         | AUST AND NZ BANKING GROUP    | 493,452    | 28.82  | 14,221,286.64                      |  |
|         | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 305,981    | 101.93 | 31,188,643.33                      |  |
|         | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 569,564    | 26.64  | 15,173,184.96                      |  |
|         | WESTPAC BANKING CORP         | 632,018    | 26.63  | 16,830,639.34                      |  |
|         | ASX LTD                      | 32,675     | 75.44  | 2,465,002.00                       |  |
|         | MACQUARIE GROUP LTD          | 60,164     | 153.49 | 9,234,572.36                       |  |
|         | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 20,923     | 49.47  | 1,035,060.81                       |  |
|         | INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 442,320    | 5.24   | 2,317,756.80                       |  |
|         | MEDIBANK PRIVATE LTD         | 444,691    | 3.14   | 1,396,329.74                       |  |
|         | QBE INSURANCE GROUP LTD      | 271,556    | 11.30  | 3,068,582.80                       |  |
|         | SUNCORP GROUP LTD            | 215,008    | 11.24  | 2,416,689.92                       |  |
|         | LENDLEASE GROUP              | 118,940    | 12.57  | 1,495,075.80                       |  |
|         | AFTERPAY LTD                 | 38,342     | 96.38  | 3,695,401.96                       |  |
|         | COMPUTERSHARE LTD            | 104,199    | 16.11  | 1,678,645.89                       |  |
|         | WISETECH GLOBAL LTD          | 21,412     | 29.43  | 630,155.16                         |  |
|         | XERO LTD                     | 21,846     | 130.15 | 2,843,256.90                       |  |
|         | TELSTRA CORP LTD             | 676,003    | 3.57   | 2,413,330.71                       |  |
|         | AGL ENERGY LTD               | 100,342    | 9.08   | 911,105.36                         |  |
|         | APA GROUP                    | 193,858    | 9.26   | 1,795,125.08                       |  |
|         | AUSNET SERVICES              | 360,836    | 1.78   | 642,288.08                         |  |
|         | ORIGIN ENERGY LTD            | 278,609    | 4.77   | 1,328,964.93                       |  |
|         | オーストラリアドル 小計                 | 11,887,188 |        | 263,247,984.05<br>(22,331,326,486) |  |
| イギリスポンド | BP PLC                       | 3,398,237  | 3.19   | 10,847,172.50                      |  |
|         | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 689,540    | 13.92  | 9,602,534.04                       |  |
|         | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 621,427    | 13.28  | 8,257,521.97                       |  |
|         | THUNGELA RESOURCES LTD       | 21,539     | 1.11   | 23,912.59                          |  |
|         | ANGLO AMERICAN PLC           | 215,394    | 31.53  | 6,791,372.82                       |  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| ANTOFAGASTA PLC              | 62,142    | 15.22  | 946,111.95    |
| BHP GROUP PLC                | 355,431   | 21.45  | 7,623,994.95  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 22,191    | 69.22  | 1,536,061.02  |
| EVRAZ PLC                    | 82,637    | 6.45   | 533,669.74    |
| GLENCORE PLC                 | 1,678,486 | 3.23   | 5,433,259.18  |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 31,751    | 31.94  | 1,014,126.94  |
| MONDI PLC                    | 85,514    | 19.10  | 1,633,317.40  |
| RIO TINTO PLC                | 188,830   | 61.41  | 11,596,050.30 |
| ASHTED GROUP PLC             | 76,578    | 52.28  | 4,003,497.84  |
| BAE SYSTEMS PLC              | 555,988   | 5.35   | 2,976,759.75  |
| BUNZL PLC                    | 53,020    | 22.72  | 1,204,614.40  |
| DCC PLC                      | 15,173    | 61.00  | 925,553.00    |
| FERGUSON PLC                 | 38,189    | 98.62  | 3,766,199.18  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       | 764,715   | 1.66   | 1,276,691.69  |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 1,503,231 | 1.10   | 1,655,357.97  |
| SMITHS GROUP PLC             | 72,652    | 15.64  | 1,136,277.28  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 13,070    | 128.65 | 1,681,455.50  |
| EXPERIAN PLC                 | 154,934   | 26.58  | 4,118,145.72  |
| INTERTEK GROUP PLC           | 26,657    | 52.94  | 1,411,221.58  |
| RELX PLC                     | 324,428   | 18.41  | 5,972,719.48  |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | 307,195   | 4.74   | 1,457,025.88  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 182,332   | 7.68   | 1,401,039.08  |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 20,863    | 47.15  | 983,690.45    |
| BURBERRY GROUP PLC           | 66,384    | 22.06  | 1,464,431.04  |
| PERSIMMON PLC                | 53,131    | 32.36  | 1,719,319.16  |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 666,929   | 1.73   | 1,156,121.42  |
| COMPASS GROUP PLC            | 299,149   | 16.16  | 4,835,743.58  |
| ENTAIN PLC                   | 96,181    | 17.32  | 1,665,854.92  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 30,929    | 49.74  | 1,538,408.46  |
| WHITBREAD PLC                | 33,847    | 32.30  | 1,093,258.10  |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 159,456   | 5.65   | 901,883.13    |
| INFORMA PLC                  | 267,387   | 5.53   | 1,478,650.11  |
| PEARSON PLC                  | 124,328   | 8.49   | 1,056,539.34  |
| WPP PLC                      | 200,466   | 10.14  | 2,032,725.24  |
| JD SPORTS FASHION PLC        | 76,698    | 9.44   | 724,489.30    |
| KINGFISHER PLC               | 376,379   | 3.44   | 1,297,754.79  |
| NEXT PLC                     | 22,084    | 83.04  | 1,833,855.36  |
| OCADO GROUP PLC              | 79,448    | 18.76  | 1,490,444.48  |
| SAINSBURY (J) PLC            | 269,286   | 2.63   | 709,299.32    |
| TESCO PLC                    | 1,323,898 | 2.25   | 2,986,713.88  |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 462,941   | 1.77   | 819,637.04    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 56,609    | 23.32  | 1,320,121.88  |

|        |                              |            |          |                                    |  |
|--------|------------------------------|------------|----------|------------------------------------|--|
|        | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 364,637    | 27.74    | 10,115,030.38                      |  |
|        | COCA-COLA HBC AG-DI          | 34,277     | 26.18    | 897,371.86                         |  |
|        | DIAGEO PLC                   | 392,957    | 34.15    | 13,421,446.33                      |  |
|        | IMPERIAL BRANDS PLC          | 165,395    | 16.13    | 2,667,821.35                       |  |
|        | RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 119,882    | 64.40    | 7,720,400.80                       |  |
|        | UNILEVER PLC                 | 442,448    | 42.66    | 18,874,831.68                      |  |
|        | SMITH & NEPHEW PLC           | 143,311    | 15.01    | 2,151,098.11                       |  |
|        | ASTRAZENECA PLC              | 220,917    | 80.05    | 17,684,405.85                      |  |
|        | GLAXOSMITHKLINE PLC          | 843,782    | 13.52    | 11,411,307.76                      |  |
|        | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 25,548     | 24.25    | 619,539.00                         |  |
|        | BARCLAYS PLC                 | 2,918,231  | 1.86     | 5,456,508.32                       |  |
|        | HSBC HOLDINGS PLC            | 3,429,622  | 4.45     | 15,278,966.01                      |  |
|        | LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 11,904,549 | 0.49     | 5,908,227.66                       |  |
|        | NATWEST GROUP PLC            | 859,176    | 2.09     | 1,803,410.42                       |  |
|        | STANDARD CHARTERED PLC       | 437,237    | 4.99     | 2,183,998.81                       |  |
|        | 3I GROUP PLC                 | 168,410    | 12.52    | 2,108,493.20                       |  |
|        | HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 64,475     | 16.66    | 1,074,475.87                       |  |
|        | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 53,654     | 75.38    | 4,044,438.52                       |  |
|        | M&G PLC                      | 437,392    | 2.48     | 1,087,356.51                       |  |
|        | SCHRODERS PLC                | 21,568     | 35.72    | 770,408.96                         |  |
|        | ST JAMES'S PLACE PLC         | 96,679     | 14.44    | 1,396,044.76                       |  |
|        | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC   | 350,806    | 2.75     | 966,821.33                         |  |
|        | ADMIRAL GROUP PLC            | 30,353     | 31.16    | 945,799.48                         |  |
|        | AVIVA PLC                    | 682,470    | 4.10     | 2,802,904.29                       |  |
|        | DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 200,927    | 3.01     | 605,393.05                         |  |
|        | LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 1,029,010  | 2.82     | 2,910,040.28                       |  |
|        | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | 94,487     | 7.33     | 692,967.65                         |  |
|        | PRUDENTIAL PLC               | 438,336    | 14.75    | 6,465,456.00                       |  |
|        | AVEVA GROUP PLC              | 19,699     | 34.61    | 681,782.39                         |  |
|        | SAGE GROUP PLC/THE           | 185,557    | 6.50     | 1,207,233.84                       |  |
|        | HALMA PLC                    | 63,105     | 26.71    | 1,685,534.55                       |  |
|        | BT GROUP PLC                 | 1,507,570  | 1.83     | 2,766,390.95                       |  |
|        | VODAFONE GROUP PLC           | 4,527,367  | 1.29     | 5,846,641.74                       |  |
|        | NATIONAL GRID PLC            | 592,968    | 9.16     | 5,431,586.88                       |  |
|        | SEVERN TRENT PLC             | 37,963     | 24.80    | 941,482.40                         |  |
|        | SSE PLC                      | 181,042    | 15.57    | 2,818,823.94                       |  |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 123,146    | 10.15    | 1,249,931.90                       |  |
|        | イギリスポンド 小計                   | 49,436,627 |          | 294,628,977.58<br>(45,694,008,132) |  |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG              | 42,084     | 19.65    | 826,950.60                         |  |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 1,369      | 849.00   | 1,162,281.00                       |  |
|        | GIVAUDAN-REG                 | 1,609      | 4,074.00 | 6,555,066.00                       |  |

|      |                              |           |           |                                    |  |
|------|------------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|--|
|      | HOLCIM LTD                   | 91,544    | 54.70     | 5,007,456.80                       |  |
|      | SIKA AG-REG                  | 24,678    | 291.80    | 7,201,040.40                       |  |
|      | ABB LTD-REG                  | 298,441   | 31.47     | 9,391,938.27                       |  |
|      | GEBERIT AG-REG               | 6,418     | 656.60    | 4,214,058.80                       |  |
|      | SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 4,259     | 261.00    | 1,111,599.00                       |  |
|      | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 6,476     | 269.30    | 1,743,986.80                       |  |
|      | ADECCO GROUP AG-REG          | 27,447    | 62.18     | 1,706,654.46                       |  |
|      | SGS SA-REG                   | 996       | 2,773.00  | 2,761,908.00                       |  |
|      | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 9,320     | 316.70    | 2,951,644.00                       |  |
|      | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 88,720    | 115.30    | 10,229,416.00                      |  |
|      | SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 5,006     | 331.30    | 1,658,487.80                       |  |
|      | SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 7,069     | 63.85     | 451,355.65                         |  |
|      | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 579       | 2,046.00  | 1,184,634.00                       |  |
|      | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 169       | 8,690.00  | 1,468,610.00                       |  |
|      | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 20        | 92,400.00 | 1,848,000.00                       |  |
|      | NESTLE SA-REG                | 495,924   | 112.82    | 55,950,145.68                      |  |
|      | ALCON INC                    | 87,319    | 63.04     | 5,504,589.76                       |  |
|      | SONOVA HOLDING AG-REG        | 9,724     | 325.30    | 3,163,217.20                       |  |
|      | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 1,840     | 1,428.50  | 2,628,440.00                       |  |
|      | LONZA GROUP AG-REG           | 12,825    | 610.00    | 7,823,250.00                       |  |
|      | NOVARTIS AG-REG              | 381,873   | 80.79     | 30,851,519.67                      |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-BR          | 5,988     | 347.60    | 2,081,428.80                       |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 120,428   | 327.60    | 39,452,212.80                      |  |
|      | VIFOR PHARMA AG              | 9,105     | 134.75    | 1,226,898.75                       |  |
|      | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 4,570     | 83.50     | 381,595.00                         |  |
|      | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 421,172   | 9.92      | 4,178,026.24                       |  |
|      | JULIUS BAER GROUP LTD        | 38,835    | 61.20     | 2,376,702.00                       |  |
|      | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 3,982     | 1,363.50  | 5,429,457.00                       |  |
|      | UBS GROUP AG-REG             | 637,277   | 14.76     | 9,409,394.90                       |  |
|      | BALOISE HOLDING AG - REG     | 8,488     | 147.00    | 1,247,736.00                       |  |
|      | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 5,553     | 459.70    | 2,552,714.10                       |  |
|      | SWISS RE AG                  | 51,678    | 85.54     | 4,420,536.12                       |  |
|      | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 26,024    | 373.80    | 9,727,771.20                       |  |
|      | SWISS PRIME SITE-REG         | 11,915    | 92.75     | 1,105,116.25                       |  |
|      | TEMENOS AG - REG             | 10,848    | 140.10    | 1,519,804.80                       |  |
|      | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 31,054    | 119.25    | 3,703,189.50                       |  |
|      | SWISSCOM AG-REG              | 4,298     | 515.20    | 2,214,329.60                       |  |
|      | スイスフラン 小計                    | 2,996,924 |           | 258,423,162.95<br>(31,496,615,100) |  |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 472,368   | 60.40     | 28,531,027.20                      |  |
|      | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 237,000   | 135.70    | 32,160,900.00                      |  |
|      | XINYI GLASS HOLDINGS LTD     | 304,000   | 29.40     | 8,937,600.00                       |  |

|          |                              |            |        |                                   |  |
|----------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
|          | MTR CORP                     | 253,500    | 43.30  | 10,976,550.00                     |  |
|          | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 355,000    | 62.35  | 22,134,250.00                     |  |
|          | SANDS CHINA LTD              | 433,200    | 33.70  | 14,598,840.00                     |  |
|          | SJM HOLDINGS LTD             | 365,000    | 8.71   | 3,179,150.00                      |  |
|          | WYNN MACAU LTD               | 286,400    | 13.08  | 3,746,112.00                      |  |
|          | CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 313,600    | 15.12  | 4,741,632.00                      |  |
|          | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 285,500    | 26.30  | 7,508,650.00                      |  |
|          | WH GROUP LTD                 | 1,590,000  | 7.33   | 11,654,700.00                     |  |
|          | BANK OF EAST ASIA LTD        | 208,820    | 15.78  | 3,295,179.60                      |  |
|          | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 654,000    | 28.50  | 18,639,000.00                     |  |
|          | HANG SENG BANK LTD           | 126,500    | 160.70 | 20,328,550.00                     |  |
|          | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 208,200    | 471.40 | 98,145,480.00                     |  |
|          | AIA GROUP LTD                | 2,087,000  | 97.35  | 203,169,450.00                    |  |
|          | CK ASSET HOLDINGS LTD        | 417,868    | 51.25  | 21,415,735.00                     |  |
|          | ESR CAYMAN LTD               | 383,000    | 23.95  | 9,172,850.00                      |  |
|          | HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 340,000    | 19.64  | 6,677,600.00                      |  |
|          | HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 234,641    | 37.85  | 8,881,161.85                      |  |
|          | NEW WORLD DEVELOPMENT        | 279,250    | 41.45  | 11,574,912.50                     |  |
|          | SINO LAND CO                 | 491,400    | 12.20  | 5,995,080.00                      |  |
|          | SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 222,000    | 119.00 | 26,418,000.00                     |  |
|          | SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 85,000     | 58.50  | 4,972,500.00                      |  |
|          | SWIRE PROPERTIES LTD         | 174,000    | 23.00  | 4,002,000.00                      |  |
|          | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 302,000    | 44.30  | 13,378,600.00                     |  |
|          | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 634,000    | 10.36  | 6,568,240.00                      |  |
|          | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 101,000    | 48.30  | 4,878,300.00                      |  |
|          | CLP HOLDINGS LTD             | 283,500    | 78.15  | 22,155,525.00                     |  |
|          | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | 501,500    | 7.90   | 3,961,850.00                      |  |
|          | HONG KONG & CHINA GAS        | 1,830,808  | 12.08  | 22,116,160.64                     |  |
|          | HONG KONG & CHINA GAS-NEW    | 91,540     | 12.08  | 1,105,803.20                      |  |
|          | POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 234,500    | 48.00  | 11,256,000.00                     |  |
|          | 香港ドル 小計                      | 14,786,095 |        | 676,277,388.99<br>(9,542,273,958) |  |
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD              | 238,900    | 5.35   | 1,278,115.00                      |  |
|          | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 268,500    | 3.88   | 1,041,780.00                      |  |
|          | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 201,740    | 4.88   | 984,491.20                        |  |
|          | SINGAPORE AIRLINES-MCB RTS   | 421,636    | 0.00   | 421.63                            |  |
|          | GENTING SINGAPORE LTD        | 1,234,500  | 0.87   | 1,080,187.50                      |  |
|          | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 306,900    | 4.78   | 1,466,982.00                      |  |
|          | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 315,900    | 30.34  | 9,584,406.00                      |  |
|          | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 575,900    | 12.47  | 7,181,473.00                      |  |
|          | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 206,400    | 26.27  | 5,422,128.00                      |  |
|          | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 133,600    | 10.44  | 1,394,784.00                      |  |

|            |                              |           |          |                                  |  |
|------------|------------------------------|-----------|----------|----------------------------------|--|
|            | CAPITALAND LTD               | 415,600   | 3.70     | 1,537,720.00                     |  |
|            | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 53,900    | 7.74     | 417,186.00                       |  |
|            | UOL GROUP LTD                | 104,000   | 7.41     | 770,640.00                       |  |
|            | VENTURE CORP LTD             | 46,100    | 19.06    | 878,666.00                       |  |
|            | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 1,440,960 | 2.37     | 3,415,075.20                     |  |
|            | シンガポールドル 小計                  | 5,964,536 |          | 36,454,055.53<br>(3,015,479,473) |  |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 200,225   | 7.61     | 1,523,712.25                     |  |
|            | A2 MILK CO LTD               | 115,334   | 6.07     | 700,077.38                       |  |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 105,107   | 29.00    | 3,048,103.00                     |  |
|            | RYMAN HEALTHCARE LTD         | 65,340    | 12.80    | 836,352.00                       |  |
|            | SPARK NEW ZEALAND LTD        | 297,267   | 4.66     | 1,385,264.22                     |  |
|            | MERCURY NZ LTD               | 123,073   | 6.83     | 840,588.59                       |  |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD          | 207,221   | 5.32     | 1,103,451.82                     |  |
|            | ニュージーランドドル 小計                | 1,113,567 |          | 9,437,549.26<br>(746,415,770)    |  |
| スウェーデンクローネ | LUNDIN ENERGY AB             | 31,637    | 300.00   | 9,491,100.00                     |  |
|            | BOLIDEN AB                   | 48,625    | 345.50   | 16,799,937.50                    |  |
|            | SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B   | 112,951   | 135.75   | 15,333,098.25                    |  |
|            | ALFA LAVAL AB                | 56,330    | 304.60   | 17,158,118.00                    |  |
|            | ASSA ABLOY AB-B              | 171,869   | 255.80   | 43,964,090.20                    |  |
|            | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 117,219   | 508.00   | 59,547,252.00                    |  |
|            | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 66,920    | 432.60   | 28,949,592.00                    |  |
|            | EPIROC AB-A                  | 113,811   | 182.65   | 20,787,579.15                    |  |
|            | EPIROC AB-A RED SHS          | 113,811   | 3.00     | 341,433.00                       |  |
|            | EPIROC AB-B                  | 65,627    | 161.25   | 10,582,353.75                    |  |
|            | EPIROC AB-B RED SHS          | 65,627    | 3.00     | 196,881.00                       |  |
|            | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 26,287    | 273.70   | 7,194,751.90                     |  |
|            | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 247,494   | 89.56    | 22,165,562.64                    |  |
|            | SANDVIK AB                   | 198,572   | 226.00   | 44,877,272.00                    |  |
|            | SKANSKA AB-B SHS             | 55,468    | 240.00   | 13,312,320.00                    |  |
|            | SKF AB-B SHARES              | 61,034    | 227.40   | 13,879,131.60                    |  |
|            | VOLVO AB-A SHS               | 41,257    | 234.00   | 9,654,138.00                     |  |
|            | VOLVO AB-B SHS               | 241,271   | 226.90   | 54,744,389.90                    |  |
|            | SECURITAS AB-B SHS           | 46,121    | 134.80   | 6,217,110.80                     |  |
|            | ELECTROLUX AB-SER B          | 38,512    | 240.50   | 9,262,136.00                     |  |
|            | HUSQVARNA AB-B SHS           | 71,384    | 122.95   | 8,776,662.80                     |  |
|            | EVOLUTION AB                 | 28,992    | 1,561.40 | 45,268,108.80                    |  |
|            | EMBRACER GROUP AB            | 45,000    | 240.70   | 10,831,500.00                    |  |
|            | HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 122,289   | 208.65   | 25,515,599.85                    |  |
|            | ICA GRUPPEN AB               | 17,227    | 406.90   | 7,009,666.30                     |  |
|            | SWEDISH MATCH AB             | 284,075   | 78.16    | 22,203,302.00                    |  |

|           |                              |           |           |                                    |  |
|-----------|------------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|--|
|           | ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 107,562   | 289.70    | 31,160,711.40                      |  |
|           | NORDEA BANK ABP              | 563,743   | 91.79     | 51,745,969.97                      |  |
|           | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 288,066   | 108.70    | 31,312,774.20                      |  |
|           | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 243,608   | 93.48     | 22,772,475.84                      |  |
|           | SWEDBANK AB - A SHARES       | 155,743   | 152.94    | 23,819,334.42                      |  |
|           | EQT AB                       | 38,884    | 310.90    | 12,089,035.60                      |  |
|           | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 17,548    | 342.40    | 6,008,435.20                       |  |
|           | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 25,773    | 327.20    | 8,432,925.60                       |  |
|           | INVESTOR AB-B SHS            | 305,644   | 194.20    | 59,356,064.80                      |  |
|           | KINNEVIK AB - B              | 38,085    | 306.60    | 11,676,861.00                      |  |
|           | KINNEVIK AB-B-RED            | 38,085    | 176.00    | 6,702,960.00                       |  |
|           | LUNDBERGS AB-B SHS           | 15,125    | 541.40    | 8,188,675.00                       |  |
|           | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS  | 19,554    | 559.20    | 10,934,596.80                      |  |
|           | SINCH AB                     | 9,200     | 1,532.00  | 14,094,400.00                      |  |
|           | ERICSSON LM-B SHS            | 510,881   | 108.30    | 55,328,412.30                      |  |
|           | HEXAGON AB-B SHS             | 339,122   | 121.85    | 41,322,015.70                      |  |
|           | TELE2 AB-B SHS               | 79,613    | 112.90    | 8,988,307.70                       |  |
|           | TELIA CO AB                  | 468,358   | 36.29     | 16,999,053.61                      |  |
|           | スウェーデンクローネ 小計                | 5,754,004 |           | 944,996,096.58<br>(12,521,198,279) |  |
| ノルウェークローネ | EQUINOR ASA                  | 168,502   | 192.20    | 32,386,084.40                      |  |
|           | NORSK HYDRO ASA              | 220,397   | 53.94     | 11,888,214.18                      |  |
|           | YARA INTERNATIONAL ASA       | 28,144    | 468.90    | 13,196,721.60                      |  |
|           | ADEVINTA ASA                 | 41,557    | 160.00    | 6,649,120.00                       |  |
|           | SCHIBSTED ASA-B SHS          | 21,375    | 352.00    | 7,524,000.00                       |  |
|           | SCHIBSTED ASA-CL A           | 11,227    | 413.70    | 4,644,609.90                       |  |
|           | MOWI ASA                     | 81,704    | 229.80    | 18,775,579.20                      |  |
|           | ORKLA ASA                    | 121,260   | 87.94     | 10,663,604.40                      |  |
|           | DNB ASA                      | 161,372   | 188.60    | 30,434,759.20                      |  |
|           | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 35,073    | 187.90    | 6,590,216.70                       |  |
|           | TELENOR ASA                  | 129,415   | 143.55    | 18,577,523.25                      |  |
|           | ノルウェークローネ 小計                 | 1,020,026 |           | 161,330,432.83<br>(2,136,014,930)  |  |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S       | 18,858    | 553.00    | 10,428,474.00                      |  |
|           | NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 34,335    | 452.20    | 15,526,287.00                      |  |
|           | ROCKWOOL INTL A/S-B SHS      | 1,690     | 3,091.00  | 5,223,790.00                       |  |
|           | VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 174,239   | 220.90    | 38,489,395.10                      |  |
|           | AP MOLLER-MAERSK A/S-A       | 577       | 17,570.00 | 10,137,890.00                      |  |
|           | AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 1,017     | 18,330.00 | 18,641,610.00                      |  |
|           | DSV PANALPINA A/S            | 36,052    | 1,488.00  | 53,645,376.00                      |  |
|           | PANDORA A/S                  | 18,050    | 825.00    | 14,891,250.00                      |  |
|           | CARLSBERG AS-B               | 17,767    | 1,107.50  | 19,676,952.50                      |  |

|           |                          |         |          |                                   |  |
|-----------|--------------------------|---------|----------|-----------------------------------|--|
|           | AMBU A/S-B               | 25,886  | 233.20   | 6,036,615.20                      |  |
|           | COLOPLAST-B              | 20,920  | 994.00   | 20,794,480.00                     |  |
|           | DEMANT A/S               | 21,128  | 348.60   | 7,365,220.80                      |  |
|           | GN STORE NORD A/S        | 20,791  | 507.20   | 10,545,195.20                     |  |
|           | GENMAB A/S               | 11,332  | 2,509.00 | 28,431,988.00                     |  |
|           | NOVO NORDISK A/S-B       | 296,382 | 497.55   | 147,464,864.10                    |  |
|           | DANSKE BANK A/S          | 112,289 | 114.55   | 12,862,704.95                     |  |
|           | TRYG A/S                 | 65,236  | 146.10   | 9,530,979.60                      |  |
|           | ORSTED A/S               | 33,388  | 862.00   | 28,780,456.00                     |  |
|           | デンマーククローネ 小計             | 909,937 |          | 458,473,528.45<br>(8,220,430,365) |  |
| イスラエルシェケル | ICL GROUP LTD            | 130,066 | 24.30    | 3,160,603.80                      |  |
|           | ELBIT SYSTEMS LTD        | 5,590   | 421.00   | 2,353,390.00                      |  |
|           | BANK HAPOLIM BM          | 175,741 | 27.65    | 4,859,238.65                      |  |
|           | BANK LEUMI LE-ISRAEL     | 255,937 | 25.63    | 6,559,665.31                      |  |
|           | ISRAEL DISCOUNT BANK-A   | 204,489 | 16.30    | 3,333,170.70                      |  |
|           | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 27,255  | 101.90   | 2,777,284.50                      |  |
|           | AZRIELI GROUP LTD        | 5,650   | 242.30   | 1,368,995.00                      |  |
|           | NICE LTD                 | 10,976  | 695.60   | 7,634,905.60                      |  |
|           | イスラエルシェケル 小計             | 815,704 |          | 32,047,253.56<br>(1,080,758,374)  |  |
| ユーロ       | ENI SPA                  | 429,920 | 10.45    | 4,494,383.68                      |  |
|           | GALP ENERGIA SGPS SA     | 84,034  | 9.86     | 829,247.51                        |  |
|           | NESTE OYJ                | 72,443  | 56.26    | 4,075,643.18                      |  |
|           | OMV AG                   | 24,140  | 51.76    | 1,249,486.40                      |  |
|           | REPSOL SA                | 263,925 | 11.34    | 2,995,020.90                      |  |
|           | TENARIS SA               | 78,513  | 9.64     | 756,865.32                        |  |
|           | TOTALENERGIES SE         | 418,771 | 39.49    | 16,537,266.79                     |  |
|           | VOPAK                    | 12,317  | 39.24    | 483,319.08                        |  |
|           | AIR LIQUIDE SA           | 81,515  | 141.00   | 11,493,615.00                     |  |
|           | AKZO NOBEL N.V.          | 33,390  | 106.05   | 3,541,009.50                      |  |
|           | ARCELORMITTAL            | 127,393 | 26.74    | 3,407,125.78                      |  |
|           | ARKEMA                   | 11,587  | 108.95   | 1,262,403.65                      |  |
|           | BASF SE                  | 158,279 | 68.51    | 10,843,694.29                     |  |
|           | COVESTRO AG              | 33,692  | 57.98    | 1,953,462.16                      |  |
|           | CRH PLC                  | 132,755 | 43.55    | 5,781,480.25                      |  |
|           | EVONIK INDUSTRIES AG     | 33,254  | 28.96    | 963,035.84                        |  |
|           | FUCHS PETROLUB SE-PREF   | 9,927   | 41.26    | 409,588.02                        |  |
|           | HEIDELBERGCEMENT AG      | 24,488  | 75.80    | 1,856,190.40                      |  |
|           | KONINKLIJKE DSM NV       | 29,474  | 151.80   | 4,474,153.20                      |  |
|           | LANXESS AG               | 13,421  | 63.96    | 858,407.16                        |  |
|           | SMURFIT KAPPA GROUP PLC  | 40,487  | 43.59    | 1,764,828.33                      |  |
|           | SOLVAY SA                | 13,316  | 114.65   | 1,526,679.40                      |  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| STORA ENSO OYJ-R SHS         | 92,258  | 14.86    | 1,371,415.17  |
| SYMRISE AG                   | 21,324  | 110.35   | 2,353,103.40  |
| UMICORE                      | 36,065  | 50.90    | 1,835,708.50  |
| UPM-KYMMENE OYJ              | 93,797  | 31.84    | 2,986,496.48  |
| VOESTALPINE AG               | 22,917  | 37.08    | 849,762.36    |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 37,815  | 25.24    | 954,450.60    |
| AIRBUS SE                    | 101,671 | 111.32   | 11,318,015.72 |
| ALSTOM                       | 47,441  | 45.75    | 2,170,425.75  |
| BOUYGUES SA                  | 38,278  | 33.86    | 1,296,093.08  |
| BRENTAG SE                   | 25,275  | 77.60    | 1,961,340.00  |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 175,993 | 14.82    | 2,609,096.22  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 88,998  | 57.47    | 5,114,715.06  |
| DASSAULT AVIATION SA         | 465     | 1,022.00 | 475,230.00    |
| EIFFAGE                      | 13,381  | 91.26    | 1,221,150.06  |
| FERROVIAL SA                 | 78,544  | 24.54    | 1,927,469.76  |
| GEA GROUP AG                 | 25,583  | 35.09    | 897,707.47    |
| KINGSPAN GROUP PLC           | 27,271  | 79.86    | 2,177,862.06  |
| KION GROUP AG                | 12,586  | 91.60    | 1,152,877.60  |
| KNORR-BREMSE AG              | 11,550  | 101.95   | 1,177,522.50  |
| KONE OYJ-B                   | 58,678  | 66.40    | 3,896,219.20  |
| LEGRAND SA                   | 45,912  | 87.96    | 4,038,419.52  |
| MTU AERO ENGINES AG          | 9,251   | 210.60   | 1,948,260.60  |
| PRYSMIAN SPA                 | 47,458  | 29.69    | 1,409,028.02  |
| RATIONAL AG                  | 905     | 735.20   | 665,356.00    |
| SAFRAN SA                    | 59,213  | 123.56   | 7,316,358.28  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 92,827  | 130.50   | 12,113,923.50 |
| SIEMENS AG-REG               | 131,952 | 136.04   | 17,950,750.08 |
| SIEMENS ENERGY AG            | 72,604  | 25.10    | 1,822,360.40  |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 44,513  | 25.16    | 1,119,947.08  |
| THALES SA                    | 17,267  | 85.68    | 1,479,436.56  |
| VINCI SA                     | 90,552  | 93.91    | 8,503,738.32  |
| WARTSILA OYJ ABP             | 86,598  | 11.99    | 1,038,310.02  |
| BUREAU VERITAS SA            | 54,231  | 25.87    | 1,402,955.97  |
| RANDSTAD NV                  | 22,044  | 64.12    | 1,413,461.28  |
| TELEPERFORMANCE              | 10,139  | 313.90   | 3,182,632.10  |
| WOLTERS KLUWER               | 45,128  | 79.08    | 3,568,722.24  |
| ADP                          | 5,184   | 115.00   | 596,160.00    |
| AENA SME SA                  | 12,711  | 141.60   | 1,799,877.60  |
| ATLANTIA SPA                 | 82,100  | 15.82    | 1,299,232.50  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 49,916  | 10.81    | 539,991.28    |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 171,885 | 57.17    | 9,826,665.45  |
| GETLINK SE                   | 68,170  | 13.07    | 890,981.90    |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| INPOST SA                    | 33,800  | 15.81    | 534,378.00    |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 57,133  | 95.89    | 5,478,483.37  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 8,437   | 82.00    | 691,834.00    |
| CONTINENTAL AG               | 19,370  | 131.24   | 2,542,118.80  |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 147,519 | 80.14    | 11,822,172.66 |
| FAURECIA                     | 19,981  | 46.55    | 930,115.55    |
| FERRARI NV                   | 21,710  | 180.30   | 3,914,313.00  |
| MICHELIN (CGDE)              | 28,725  | 132.30   | 3,800,317.50  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 26,975  | 101.20   | 2,729,870.00  |
| RENAULT SA                   | 36,095  | 34.51    | 1,245,638.45  |
| STELLANTIS NV                | 350,603 | 17.45    | 6,119,424.76  |
| VALEO SA                     | 37,841  | 28.22    | 1,067,873.02  |
| VOLKSWAGEN AG                | 5,961   | 313.60   | 1,869,369.60  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 31,783  | 238.80   | 7,589,780.40  |
| ADIDAS AG                    | 32,940  | 297.00   | 9,783,180.00  |
| ESSILORLUXOTTICA             | 49,205  | 145.58   | 7,163,263.90  |
| HERMES INTERNATIONAL         | 5,551   | 1,168.00 | 6,483,568.00  |
| KERING                       | 12,932  | 733.00   | 9,479,156.00  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 47,853  | 657.30   | 31,453,776.90 |
| MONCLER SPA                  | 34,693  | 59.24    | 2,055,213.32  |
| PUMA SE                      | 18,366  | 93.50    | 1,717,221.00  |
| SEB SA                       | 5,031   | 152.70   | 768,233.70    |
| ACCOR SA                     | 30,762  | 33.93    | 1,043,754.66  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 28,951  | 153.50   | 4,443,978.50  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   | 17,570  | 47.56    | 835,629.20    |
| SODEXO SA                    | 14,297  | 80.20    | 1,146,619.40  |
| BOLLORE                      | 137,374 | 4.42     | 608,292.07    |
| PUBLICIS GROUPE              | 38,571  | 56.58    | 2,182,347.18  |
| SCOUT24 AG                   | 14,548  | 65.10    | 947,074.80    |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 14,966  | 57.82    | 865,334.12    |
| VIVENDI                      | 120,200 | 29.43    | 3,537,486.00  |
| DELIVERY HERO SE             | 26,478  | 110.85   | 2,935,086.30  |
| HELLOFRESH SE                | 27,853  | 82.26    | 2,291,187.78  |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 184,744 | 32.38    | 5,982,010.72  |
| JUST EAT TAKEAWAY            | 20,480  | 74.14    | 1,518,387.20  |
| PROSUS NV                    | 83,024  | 85.46    | 7,095,231.04  |
| ZALANDO SE                   | 29,198  | 97.84    | 2,856,732.32  |
| CARREFOUR SA                 | 99,831  | 17.37    | 1,734,563.62  |
| COLRUYT SA                   | 9,744   | 51.08    | 497,723.52    |
| JERONIMO MARTINS             | 42,529  | 15.94    | 678,124.90    |
| KESKO OYJ-B SHS              | 49,347  | 29.44    | 1,452,775.68  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 175,561 | 24.35    | 4,275,788.15  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 130,378   | 64.05  | 8,350,710.90  |
| DANONE                       | 113,584   | 58.87  | 6,686,690.08  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     | 92,086    | 10.89  | 1,002,816.54  |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 21,184    | 83.55  | 1,769,923.20  |
| HEINEKEN NV                  | 45,659    | 98.30  | 4,488,279.70  |
| JDE PEET'S NV                | 11,100    | 31.90  | 354,090.00    |
| KERRY GROUP PLC-A            | 26,860    | 109.60 | 2,943,856.00  |
| PERNOD RICARD SA             | 36,320    | 180.70 | 6,563,024.00  |
| REMY COINTREAU               | 3,357     | 160.00 | 537,120.00    |
| BEIERSDORF AG                | 16,868    | 101.55 | 1,712,945.40  |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 18,684    | 82.25  | 1,536,759.00  |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 29,518    | 94.86  | 2,800,077.48  |
| L'OREAL                      | 43,466    | 378.75 | 16,462,747.50 |
| AMPLIFON SPA                 | 21,192    | 39.80  | 843,441.60    |
| BIOMERIEUX                   | 6,814     | 91.60  | 624,162.40    |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR   | 6,830     | 150.00 | 1,024,500.00  |
| DIASORIN SPA                 | 4,411     | 142.30 | 627,685.30    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 36,794    | 67.90  | 2,498,312.60  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 73,512    | 44.94  | 3,303,629.28  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 154,437   | 46.05  | 7,111,823.85  |
| ORPEA                        | 8,232     | 105.25 | 866,418.00    |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 4,419     | 389.80 | 1,722,526.20  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | 46,681    | 47.21  | 2,203,810.01  |
| ARGENX SE                    | 7,993     | 216.00 | 1,726,488.00  |
| BAYER AG-REG                 | 170,499   | 52.95  | 9,027,922.05  |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 23,374    | 83.30  | 1,947,054.20  |
| GRIFOLS SA                   | 49,300    | 21.70  | 1,069,810.00  |
| IPSEN                        | 6,733     | 87.38  | 588,329.54    |
| MERCK KGAA                   | 22,592    | 147.60 | 3,334,579.20  |
| ORION OYJ-CLASS B            | 18,091    | 36.40  | 658,512.40    |
| QIAGEN N.V.                  | 41,399    | 38.42  | 1,590,549.58  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  | 17,261    | 46.96  | 810,576.56    |
| SANOFI                       | 195,376   | 86.18  | 16,837,503.68 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     | 4,900     | 345.40 | 1,692,460.00  |
| UCB SA                       | 20,162    | 75.96  | 1,531,505.52  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         | 75,399    | 11.12  | 838,436.88    |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 1,168,463 | 5.32   | 6,225,570.86  |
| BANCO SANTANDER SA           | 2,997,531 | 3.46   | 10,374,454.79 |
| BNP PARIBAS                  | 193,501   | 57.57  | 11,139,852.57 |
| CAIXABANK SA                 | 794,119   | 2.86   | 2,273,562.69  |
| COMMERZBANK AG               | 161,446   | 6.81   | 1,099,447.26  |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 202,065   | 12.49  | 2,523,791.85  |

|                              |           |          |               |
|------------------------------|-----------|----------|---------------|
| ERSTE GROUP BANK AG          | 50,031    | 34.73    | 1,737,576.63  |
| FINECOBANK SPA               | 98,210    | 14.08    | 1,382,796.80  |
| ING GROEP NV                 | 670,896   | 11.33    | 7,606,618.84  |
| INTESA SANPAOLO              | 2,847,408 | 2.48     | 7,077,232.58  |
| KBC GROUP NV                 | 44,347    | 69.02    | 3,060,829.94  |
| MEDIOBANCA SPA               | 104,907   | 10.01    | 1,050,119.07  |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 26,632    | 20.74    | 552,347.68    |
| SOCIETE GENERALE SA          | 137,482   | 26.73    | 3,675,581.27  |
| UNICREDIT SPA                | 361,677   | 10.85    | 3,927,088.86  |
| AMUNDI SA                    | 10,517    | 73.85    | 776,680.45    |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 356,608   | 12.37    | 4,411,954.17  |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 32,176    | 134.55   | 4,329,280.80  |
| EURAZEO SE                   | 7,132     | 72.65    | 518,139.80    |
| EXOR NV                      | 19,928    | 71.50    | 1,424,852.00  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 20,046    | 94.52    | 1,894,747.92  |
| NATIXIS                      | 139,223   | 4.00     | 556,892.00    |
| SOFINA                       | 2,674     | 348.00   | 930,552.00    |
| WENDEL                       | 4,862     | 115.50   | 561,561.00    |
| AEGON NV                     | 283,341   | 3.82     | 1,082,929.30  |
| AGEAS                        | 28,346    | 49.36    | 1,399,158.56  |
| ALLIANZ SE-REG               | 71,078    | 218.30   | 15,516,327.40 |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 193,640   | 17.25    | 3,340,290.00  |
| AXA SA                       | 334,394   | 22.98    | 7,686,046.09  |
| CNP ASSURANCES               | 31,208    | 14.58    | 455,012.64    |
| HANNOVER RUECK SE            | 9,774     | 144.20   | 1,409,410.80  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 24,386    | 235.80   | 5,750,218.80  |
| NN GROUP NV                  | 47,538    | 41.49    | 1,972,351.62  |
| POSTE ITALIANE SPA           | 87,776    | 12.06    | 1,058,578.56  |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 87,494    | 38.51    | 3,369,393.94  |
| SCOR SE                      | 27,160    | 26.66    | 724,085.60    |
| AROUNDTOWN SA                | 170,559   | 6.98     | 1,190,501.82  |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           | 61,047    | 51.30    | 3,131,711.10  |
| LEG IMMOBILIEN SE            | 12,018    | 120.45   | 1,447,568.10  |
| VONOVIA SE                   | 94,612    | 53.04    | 5,018,220.48  |
| ADYEN NV                     | 3,439     | 1,873.60 | 6,443,310.40  |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 78,699    | 61.90    | 4,871,468.10  |
| ATOS SE                      | 16,434    | 53.38    | 877,246.92    |
| BECHTLE AG                   | 5,550     | 155.30   | 861,915.00    |
| CAPGEMINI SE                 | 27,412    | 150.45   | 4,124,135.40  |
| DASSAULT SYSTEMES SE         | 22,586    | 185.30   | 4,185,185.80  |
| EDENRED                      | 44,251    | 46.60    | 2,062,096.60  |
| NEMETSCHEK SE                | 12,144    | 59.96    | 728,154.24    |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| NEXI SPA                     | 74,508    | 16.64  | 1,239,813.12  |
| SAP SE                       | 180,073   | 115.60 | 20,816,438.80 |
| TEAMVIEWER AG                | 25,425    | 30.79  | 782,835.75    |
| WORLDLINE SA                 | 40,701    | 76.35  | 3,107,521.35  |
| NOKIA OYJ                    | 909,389   | 4.53   | 4,119,532.17  |
| CELLNEX TELECOM SA           | 86,230    | 49.86  | 4,299,427.80  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 576,986   | 17.44  | 10,063,789.81 |
| ELISA OYJ                    | 23,784    | 49.08  | 1,167,318.72  |
| ILIAD SA                     | 2,776     | 133.25 | 369,902.00    |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 71,656    | 9.29   | 665,827.55    |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 562,656   | 2.71   | 1,529,861.66  |
| ORANGE                       | 345,418   | 10.52  | 3,633,797.36  |
| PROXIMUS                     | 26,824    | 17.07  | 458,019.80    |
| TELECOM ITALIA SPA           | 1,943,722 | 0.45   | 882,255.41    |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 847,742   | 0.48   | 407,255.25    |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 168,220   | 2.26   | 380,177.20    |
| TELEFONICA SA                | 910,761   | 3.89   | 3,547,869.47  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 18,896    | 34.13  | 644,920.48    |
| E.ON SE                      | 396,676   | 9.99   | 3,966,363.32  |
| EDF                          | 79,209    | 11.63  | 921,596.71    |
| EDP RENOVAVEIS SA            | 48,589    | 18.58  | 902,783.62    |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 476,013   | 4.52   | 2,155,386.86  |
| ELIA GROUP SA/NV             | 5,662     | 88.75  | 502,502.50    |
| ENAGAS SA                    | 42,336    | 19.55  | 827,668.80    |
| ENDESA SA                    | 52,405    | 21.65  | 1,134,568.25  |
| ENEL SPA                     | 1,406,619 | 8.00   | 11,257,171.85 |
| ENGIE                        | 306,059   | 12.39  | 3,792,071.01  |
| FORTUM OYJ                   | 80,051    | 23.51  | 1,881,999.01  |
| IBERDROLA SA                 | 998,275   | 10.64  | 10,621,646.00 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 47,043    | 21.62  | 1,017,069.66  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 71,520    | 16.67  | 1,192,596.00  |
| RWE AG                       | 107,669   | 30.78  | 3,314,051.82  |
| SNAM SPA                     | 334,118   | 4.91   | 1,641,855.85  |
| SUEZ                         | 55,054    | 20.09  | 1,106,034.86  |
| TERNA SPA                    | 231,929   | 6.38   | 1,481,562.45  |
| UNIPER SE                    | 15,373    | 30.10  | 462,727.30    |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 95,449    | 25.95  | 2,476,901.55  |
| VERBUND AG                   | 11,251    | 74.55  | 838,762.05    |
| ASM INTERNATIONAL NV         | 8,485     | 263.60 | 2,236,646.00  |
| ASML HOLDING NV              | 72,279    | 557.90 | 40,324,454.10 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 222,343   | 33.06  | 7,351,771.29  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 116,211   | 30.11  | 3,499,113.21  |

|        |             |  |                                      |  |
|--------|-------------|--|--------------------------------------|--|
| ユーロ 小計 | 32,484,640  |  | 817,927,358.14<br>(109,070,613,207)  |  |
| 合 計    | 188,920,078 |  | 985,914,241,691<br>(985,914,241,691) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨         | 種 類  | 銘 柄                          | 口数      | 評価額           | 備考 |
|------------|------|------------------------------|---------|---------------|----|
| アメリカ<br>ドル | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 21,575  | 4,045,744.00  |    |
|            |      | AMERICAN TOWER CORP          | 76,604  | 20,578,132.52 |    |
|            |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 24,154  | 5,124,029.56  |    |
|            |      | BOSTON PROPERTIES INC        | 26,047  | 3,207,688.05  |    |
|            |      | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 15,886  | 2,064,544.56  |    |
|            |      | CROWN CASTLE INTL CORP       | 74,377  | 14,729,621.08 |    |
|            |      | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 48,660  | 7,712,610.00  |    |
|            |      | DUKE REALTY CORP             | 65,472  | 3,182,593.92  |    |
|            |      | EQUINIX INC                  | 15,543  | 12,357,617.58 |    |
|            |      | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 27,812  | 2,060,312.96  |    |
|            |      | EQUITY RESIDENTIAL           | 62,517  | 4,967,600.82  |    |
|            |      | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 11,222  | 3,485,777.64  |    |
|            |      | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 22,677  | 3,550,764.66  |    |
|            |      | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 92,453  | 3,151,722.77  |    |
|            |      | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 113,592 | 2,021,937.60  |    |
|            |      | INVITATION HOMES INC         | 99,565  | 3,728,709.25  |    |
|            |      | IRON MOUNTAIN INC            | 48,019  | 2,195,428.68  |    |
|            |      | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 94,870  | 2,020,731.00  |    |
|            |      | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 20,239  | 3,362,102.68  |    |
|            |      | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 37,887  | 1,423,035.72  |    |
|            |      | PROLOGIS INC                 | 127,388 | 15,627,959.84 |    |
|            |      | PUBLIC STORAGE               | 27,334  | 7,960,207.48  |    |
|            |      | REALTY INCOME CORP           | 65,115  | 4,580,840.25  |    |
|            |      | REGENCY CENTERS CORP         | 25,416  | 1,697,788.80  |    |
|            |      | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 18,540  | 5,843,808.00  |    |
|            |      | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 56,850  | 7,617,900.00  |    |
|            |      | SUN COMMUNITIES INC          | 18,903  | 3,248,858.61  |    |
|            |      | UDR INC                      | 51,580  | 2,547,020.40  |    |
|            |      | VENTAS INC                   | 65,472  | 3,741,070.08  |    |
|            |      | VEREIT INC                   | 41,948  | 2,047,481.88  |    |
|            |      | VICI PROPERTIES INC          | 92,751  | 2,994,929.79  |    |

|                  |      |                              |           |                                    |  |
|------------------|------|------------------------------|-----------|------------------------------------|--|
|                  |      | VORNADO REALTY TRUST         | 26,516    | 1,326,065.16                       |  |
|                  |      | WELLTOWER INC                | 71,018    | 5,459,153.66                       |  |
|                  |      | WEYERHAEUSER CO              | 131,799   | 4,705,224.30                       |  |
|                  |      | WP CAREY INC                 | 28,536    | 2,220,671.52                       |  |
| アメリカドル合計         |      |                              | 1,848,337 | 176,589,684.82<br>(19,327,741,003) |  |
| カナダドル            | 投資証券 | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 14,900    | 850,790.00                         |  |
|                  |      | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 30,800    | 669,900.00                         |  |
| カナダドル合計          |      |                              | 45,700    | 1,520,690.00<br>(137,759,307)      |  |
| オーストラリアドル        | 投資証券 | DEXUS                        | 172,849   | 1,835,656.38                       |  |
|                  |      | GOODMAN GROUP                | 281,173   | 5,772,481.69                       |  |
|                  |      | GPT GROUP                    | 311,121   | 1,468,491.12                       |  |
|                  |      | MIRVAC GROUP                 | 732,983   | 2,154,970.02                       |  |
|                  |      | SCENTRE GROUP                | 957,823   | 2,672,326.17                       |  |
|                  |      | STOCKLAND                    | 439,401   | 2,082,760.74                       |  |
|                  |      | VICINITY CENTRES             | 685,696   | 1,124,541.44                       |  |
| オーストラリアドル合計      |      |                              | 3,581,046 | 17,111,227.56<br>(1,451,545,433)   |  |
| イギリス<br>ポンド      | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC          | 132,156   | 685,889.64                         |  |
|                  |      | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 120,755   | 880,062.44                         |  |
|                  |      | SEGRO PLC                    | 205,902   | 2,194,915.32                       |  |
| イギリスポンド合計        |      |                              | 458,813   | 3,760,867.40<br>(583,272,925)      |  |
| 香港ドル             | 投資証券 | LINK REIT                    | 364,100   | 27,070,835.00                      |  |
| 香港ドル合計           |      |                              | 364,100   | 27,070,835.00<br>(381,969,481)     |  |
| シンガ<br>ポールド<br>ル | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 593,200   | 1,732,144.00                       |  |
|                  |      | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 763,500   | 1,618,620.00                       |  |
|                  |      | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 383,600   | 801,724.00                         |  |
|                  |      | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 478,000   | 960,780.00                         |  |
| シンガポールドル合計       |      |                              | 2,218,300 | 5,113,268.00<br>(422,969,528)      |  |
| ユーロ              | 投資証券 | COVIVIO                      | 9,200     | 738,760.00                         |  |
|                  |      | GECINA SA                    | 7,182     | 966,338.10                         |  |
|                  |      | KLEPIERRE                    | 38,539    | 953,069.47                         |  |
|                  |      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 22,743    | 1,677,751.11                       |  |
| ユーロ合計            |      |                              | 77,664    | 4,335,918.68<br>(578,194,755)      |  |
| 合計               |      |                              |           | 22,883,452,432<br>(22,883,452,432) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数       | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 株式 603銘柄  | 97.33%       | —              | 69.71%                  |
|            | 投資証券 35銘柄 | —            | 2.67%          | 1.92%                   |
| カナダドル      | 株式 89銘柄   | 99.63%       | —              | 3.65%                   |
|            | 投資証券 2銘柄  | —            | 0.37%          | 0.01%                   |
| オーストラリアドル  | 株式 56銘柄   | 93.90%       | —              | 2.21%                   |
|            | 投資証券 7銘柄  | —            | 6.10%          | 0.14%                   |
| イギリスポンド    | 株式 84銘柄   | 98.74%       | —              | 4.53%                   |
|            | 投資証券 3銘柄  | —            | 1.26%          | 0.06%                   |
| スイスフラン     | 株式 40銘柄   | 100.00%      | —              | 3.12%                   |
| 香港ドル       | 株式 33銘柄   | 96.15%       | —              | 0.95%                   |
|            | 投資証券 1銘柄  | —            | 3.85%          | 0.04%                   |
| シンガポールドル   | 株式 15銘柄   | 87.70%       | —              | 0.30%                   |
|            | 投資証券 4銘柄  | —            | 12.30%         | 0.04%                   |
| ニュージーランドドル | 株式 7銘柄    | 100.00%      | —              | 0.07%                   |
| スウェーデンクローネ | 株式 44銘柄   | 100.00%      | —              | 1.24%                   |
| ノルウェークローネ  | 株式 11銘柄   | 100.00%      | —              | 0.21%                   |
| デンマーククローネ  | 株式 18銘柄   | 100.00%      | —              | 0.81%                   |
| イスラエルシェケル  | 株式 8銘柄    | 100.00%      | —              | 0.11%                   |
| ユーロ        | 株式 232銘柄  | 99.47%       | —              | 10.81%                  |
|            | 投資証券 4銘柄  | —            | 0.53%          | 0.06%                   |

## 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

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 新興国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 3年 6月 8日現在 ]

|         |                |
|---------|----------------|
| 資産の部    |                |
| 流動資産    |                |
| 預金      | 18,068,150,030 |
| コール・ローン | 1,098,575,836  |

[ 令和 3年 6月 8日現在 ]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 株式          | 230,794,438,956 |
| 新株予約権証券     | 744,464         |
| 投資証券        | 203,412,415     |
| 派生商品評価勘定    | 101,909,988     |
| 未収入金        | 55,855,459      |
| 未収配当金       | 422,566,436     |
| 差入委託証拠金     | 1,941,695,840   |
| 流動資産合計      | 252,687,349,424 |
| 資産合計        | 252,687,349,424 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 19,985,673      |
| 未払金         | 13,824,497,578  |
| 未払解約金       | 609,620,651     |
| 未払利息        | 798             |
| 流動負債合計      | 14,454,104,700  |
| 負債合計        | 14,454,104,700  |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 71,312,614,002  |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 166,920,630,722 |
| 元本等合計       | 238,233,244,724 |
| 純資産合計       | 238,233,244,724 |
| 負債純資産合計     | 252,687,349,424 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |                                                                                                                                                                                      |
|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。<br>新株予約権証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。<br>投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。<br>為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。                                                                                                           |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。                                                                                                                           |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[ 令和 3年 6月 8日現在 ]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

|                                 | [令和 3年 6月 8日現在] |
|---------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                           | 令和 2年12月 9日     |
| 期首元本額                           | 58,534,613,147円 |
| 期中追加設定元本額                       | 16,971,347,687円 |
| 期中一部解約元本額                       | 4,193,346,832円  |
| 元本の内訳                           |                 |
| MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信       | 284,800,726円    |
| eMAXIS 新興国株式インデックス              | 11,016,322,706円 |
| eMAXIS バランス（８資産均等型）             | 1,361,240,645円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）               | 84,103,406円     |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）     | 357,929,760円    |
| コアバランス                          | 107,327円        |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）               | 106,219,301円    |
| eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）        | 3,652,981,068円  |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス         | 19,909,355,406円 |
| つみたて新興国株式                       | 3,518,165,858円  |
| つみたて８資産均等バランス                   | 1,695,350,083円  |
| eMAXIS マイマネージャー １９７０ｓ           | 707,745円        |
| eMAXIS マイマネージャー １９８０ｓ           | 1,218,186円      |
| eMAXIS マイマネージャー １９９０ｓ           | 2,412,666円      |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）         | 2,669,702,908円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）       | 369,957,758円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）    | 7,609,595,869円  |
| 新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）         | 1,526,148,492円  |
| つみたて全世界株式                       | 3,145,166円      |
| ラップ向けインデックスf 新興国株式              | 582,118,973円    |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）       | 2,716,693円      |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）       | 10,179,584円     |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）       | 17,668,409円     |
| 三菱ＵＦＪ DC新興国株式インデックスファンド         | 12,485,678,701円 |
| 新興国株式インデックスオープン                 | 412,753,627円    |
| eMAXIS 全世界株式インデックス              | 568,451,572円    |
| 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）      | 480,020,599円    |
| 新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）          | 720,276円        |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）       | 24,620,046円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）      | 139,010,941円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）         | 123,943,715円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）        | 498,776,958円    |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 1,454,215,308円  |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）   | 2,287,022円      |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）   | 8,405,259円      |
| 世界８資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）      | 12,671,492円     |

|                                  | [令和 3年 6月 8日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定） | 63,970,500円     |
| MUKAM バランスファンド2020-04（適格機関投資家限定） | 67,287,767円     |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 63,166,573円     |
| MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定） | 62,842,560円     |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 61,642,351円     |
| 合計                               | 71,312,614,002円 |
| 2. 受益権の総数                        | 71,312,614,002口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

# 1 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8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」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算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> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

## ２ 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [ 令和 3年 6月 8日現在 ]                                                                                                                                                                                                               |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                          |
| ２．時価の算定方法                 | <p>（１）有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（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</p> <p>デリバティブ取引は、（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）上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</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 | 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。                                                                                                           |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種類      | [ 令和 3年 6月 8日現在 ]  |
|---------|--------------------|
|         | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式      | 6,479,708,946      |
| 新株予約権証券 | 17,277             |
| 投資証券    | 1,503,517          |
| 合計      | 6,478,222,706      |

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

### （デリバティブ取引に関する注記）

#### 取引の時価等に関する事項

#### 株式関連

[ 令和 3年 6月 8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<br>買建 | 7,321,867,347 | —     | 7,406,850,893 | 84,983,546 |
| 合計   |                | 7,321,867,347 | —     | 7,406,850,893 | 84,983,546 |

（注）時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値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、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 先物取引の残高は、契約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。

## 通貨関連

[ 令和 3年 6月 8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         |             |       |             |           |
|           | アメリカドル     | 160,057,896 | —     | 160,054,973 | 2,923     |
|           | マレーシアリンギット | 102,205,015 | —     | 102,200,014 | 5,001     |
|           | 南アフリカランド   | 423,664,800 | —     | 420,612,400 | 3,052,400 |
|           | 売建         |             |       |             |           |
|           | オフショア元     | 1,357,136   | —     | 1,356,043   | 1,093     |
| 合計        |            | 687,284,847 | —     | 684,223,430 | 3,059,231 |

## （注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。  
（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （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。

## （１口当たり情報）

|              | [ 令和 3年 6月 8日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 3.3407円           |
| (1万口当たり純資産額) | (33,407円)         |

## 附属明細表

## 第１ 有価証券明細表

## (1)株式

(単位：円)

| 通貨     | 銘柄                           | 株式数       | 評価額    |               | 備考 |
|--------|------------------------------|-----------|--------|---------------|----|
|        |                              |           | 単価     | 金額            |    |
| アメリカドル | GAZPROM PJSC-SPON ADR        | 1,414,029 | 7.49   | 10,593,905.26 |    |
|        | LUKOIL PJSC-SPON ADR         | 93,713    | 89.90  | 8,424,798.70  |    |
|        | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 22,805    | 215.50 | 4,914,477.50  |    |
|        | ROSNEFT OIL CO PJSC          | 298,130   | 7.54   | 2,248,831.28  |    |
|        | SURGUTNEFTEGAS PJSC          | 2,009,700 | 0.49   | 1,004,620.69  |    |
|        | SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE    | 1,813,700 | 0.63   | 1,155,557.05  |    |
|        | TATNEFT PJSC                 | 365,438   | 7.06   | 2,580,945.45  |    |
|        | YPF S.A.-SPONSORED ADR       | 45,994    | 5.66   | 260,326.04    |    |
|        | ALROSA PJSC                  | 745,960   | 1.69   | 1,264,156.03  |    |
|        | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 49,646    | 11.37  | 564,475.02    |    |
|        | MMC NORILSK NICKEL PJSC      | 15,812    | 358.92 | 5,675,262.60  |    |
|        | NOVOLIPETSK STEEL PJSC       | 371,170   | 3.61   | 1,340,947.72  |    |
|        | PHOSAGRO PJSC-GDR REG S      | 34,870    | 20.60  | 718,322.00    |    |
|        | POLYUS PJSC-REG S-GDR        | 16,271    | 103.70 | 1,687,302.70  |    |
|        | SEVERSTAL PJSC               | 52,868    | 23.06  | 1,219,529.70  |    |
|        | SOUTHERN COPPER CORP         | 23,550    | 68.24  | 1,607,052.00  |    |
|        | 51JOB INC-ADR                | 8,680     | 72.95  | 633,206.00    |    |
|        | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR   | 109,240   | 31.80  | 3,473,832.00  |    |
|        | LI AUTO INC - ADR            | 117,666   | 26.68  | 3,139,328.88  |    |
|        | NIO INC - ADR                | 316,253   | 43.68  | 13,813,931.04 |    |
|        | XPENG INC - ADR              | 80,630    | 38.36  | 3,092,966.80  |    |
|        | GAOTU TECHEDU INC            | 28,579    | 14.19  | 405,536.01    |    |
|        | HUAZHU GROUP LTD-ADR         | 44,809    | 57.35  | 2,569,796.15  |    |
|        | NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 381,738   | 8.87   | 3,386,016.06  |    |
|        | TAL EDUCATION GROUP- ADR     | 101,786   | 28.07  | 2,857,133.02  |    |
|        | YUM CHINA HOLDINGS INC       | 103,808   | 68.80  | 7,141,990.40  |    |
|        | AUTOHOME INC-ADR             | 17,600    | 70.41  | 1,239,216.00  |    |
|        | BAIDU INC - SPON ADR         | 65,999    | 188.92 | 12,468,531.08 |    |
|        | BILIBILI INC-SPONSORED ADR   | 40,229    | 104.63 | 4,209,160.27  |    |
|        | DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR | 18,300    | 7.23   | 132,309.00    |    |
|        | HUYA INC-ADR                 | 20,986    | 14.78  | 310,173.08    |    |
|        | IQIYI INC-ADR                | 77,562    | 14.14  | 1,096,726.68  |    |
|        | JOYY INC-ADR                 | 13,170    | 71.12  | 936,650.40    |    |
|        | MAIL.RU GROUP-GDR REGS       | 34,689    | 22.79  | 790,688.84    |    |

|                              |             |        |               |
|------------------------------|-------------|--------|---------------|
| MOMO INC-SPON ADR            | 32,727      | 13.92  | 455,559.84    |
| NETEASE INC-ADR              | 98,707      | 113.89 | 11,241,740.23 |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 167,982     | 15.22  | 2,556,686.04  |
| WEIBO CORP-SPON ADR          | 16,561      | 47.42  | 785,322.62    |
| YANDEX NV-A                  | 69,293      | 67.48  | 4,675,891.64  |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 435,475     | 216.90 | 94,454,527.50 |
| BAOZUN INC-SPN ADR           | 18,370      | 33.95  | 623,661.50    |
| DADA NEXUS LTD-ADR           | 13,900      | 25.74  | 357,786.00    |
| JD.COM INC-ADR               | 211,489     | 74.68  | 15,793,998.52 |
| OZON HOLDINGS PLC - ADR      | 10,000      | 55.72  | 557,246.50    |
| PINDUODUO INC-ADR            | 107,309     | 127.93 | 13,728,040.37 |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR       | 124,514     | 37.68  | 4,691,687.52  |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR   | 107,883     | 21.55  | 2,324,878.65  |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    | 76,798      | 15.10  | 1,159,649.80  |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 28,003      | 31.00  | 868,093.00    |
| ADECOAGRO SA                 | 21,100      | 11.49  | 242,439.00    |
| RLX TECHNOLOGY INC-ADR       | 25,215      | 9.00   | 226,935.00    |
| BEIGENE LTD-ADR              | 11,307      | 344.27 | 3,892,660.89  |
| BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR | 10,500      | 28.56  | 299,880.00    |
| HUTCHMED CHINA-ADR           | 16,179      | 30.53  | 493,944.87    |
| I-MAB-SPONSORED ADR          | 7,800       | 74.55  | 581,490.00    |
| ZAI LAB LTD-ADR              | 18,649      | 171.28 | 3,194,200.72  |
| COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 334,447     | 3.31   | 1,108,691.80  |
| CREDICORP LTD                | 17,899      | 134.64 | 2,409,921.36  |
| SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 630,915     | 17.22  | 10,867,510.87 |
| TCS GROUP HOLDING-GDR REG S  | 30,355      | 71.76  | 2,178,274.80  |
| VTB BANK PJSC                | 881,970,000 | 0.00   | 590,567.11    |
| 360 DIGITECH INC             | 20,200      | 35.36  | 714,272.00    |
| LUFAX HOLDING LTD-ADR        | 48,053      | 12.62  | 606,428.86    |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 425,170     | 2.40   | 1,022,200.68  |
| NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS   | 7,365       | 44.40  | 327,006.00    |
| UP FINTECH HOLDING LTD - ADR | 18,600      | 26.79  | 498,294.00    |
| KE HOLDINGS INC-ADR          | 87,089      | 44.58  | 3,882,427.62  |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 437,894     | 0.91   | 398,921.43    |
| 21VIANET GROUP INC-ADR       | 18,950      | 20.19  | 382,600.50    |
| AGORA INC-ADR                | 11,200      | 40.41  | 452,592.00    |
| CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR  | 20,600      | 16.15  | 332,690.00    |
| GDS HOLDINGS LTD - ADR       | 21,569      | 74.73  | 1,611,851.37  |
| GLOBANT SA                   | 10,441      | 213.70 | 2,231,241.70  |
| KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR  | 13,811      | 39.81  | 549,815.91    |
| ONECONNECT FINANCIAL TECHNO  | 26,900      | 13.28  | 357,232.00    |
| MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    | 129,213     | 9.34   | 1,206,849.42  |

|            |                              |             |        |                                    |  |
|------------|------------------------------|-------------|--------|------------------------------------|--|
|            | INTER RAO UES PJSC           | 8,865,000   | 0.06   | 607,774.64                         |  |
|            | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR     | 11,620      | 74.49  | 865,573.80                         |  |
| アメリカドル 小計  |                              | 903,742,432 |        | 303,366,759.53<br>(33,203,491,830) |  |
| イギリスポンド    | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC  | 89,250      | 16.68  | 1,489,136.25                       |  |
| イギリスポンド 小計 |                              | 89,250      |        | 1,489,136.25<br>(230,950,141)      |  |
| 香港ドル       | CHINA OILFIELD SERVICES-H    | 394,000     | 7.60   | 2,994,400.00                       |  |
|            | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 5,936,000   | 4.29   | 25,465,440.00                      |  |
|            | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 832,500     | 17.46  | 14,535,450.00                      |  |
|            | PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LT | 190,000     | 2.39   | 454,100.00                         |  |
|            | PETROCHINA CO LTD-H          | 5,351,000   | 3.36   | 17,979,360.00                      |  |
|            | YANZHOU COAL MINING CO-H     | 486,000     | 10.82  | 5,258,520.00                       |  |
|            | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 1,324,000   | 4.36   | 5,772,640.00                       |  |
|            | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 296,000     | 42.90  | 12,698,400.00                      |  |
|            | CHINA HONGQIAO GROUP LTD     | 530,500     | 11.18  | 5,930,990.00                       |  |
|            | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H    | 609,000     | 5.12   | 3,118,080.00                       |  |
|            | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 966,000     | 10.04  | 9,698,640.00                       |  |
|            | CHINA RESOURCES CEMENT       | 686,000     | 8.15   | 5,590,900.00                       |  |
|            | GANFENG LITHIUM CO LTD-H     | 31,600      | 114.60 | 3,621,360.00                       |  |
|            | JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 321,000     | 17.28  | 5,546,880.00                       |  |
|            | LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN | 247,000     | 6.48   | 1,600,560.00                       |  |
|            | MMG LTD                      | 560,000     | 4.10   | 2,296,000.00                       |  |
|            | NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS  | 392,000     | 11.16  | 4,374,720.00                       |  |
|            | SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 155,250     | 15.74  | 2,443,635.00                       |  |
|            | ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H  | 242,500     | 8.19   | 1,986,075.00                       |  |
|            | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 1,476,000   | 11.52  | 17,003,520.00                      |  |
|            | AVICHINA INDUSTRY & TECH-H   | 557,000     | 5.11   | 2,846,270.00                       |  |
|            | BOC AVIATION LTD             | 49,100      | 68.65  | 3,370,715.00                       |  |
|            | CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 654,000     | 3.42   | 2,236,680.00                       |  |
|            | CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 419,000     | 33.20  | 13,910,800.00                      |  |
|            | CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L | 309,000     | 19.70  | 6,087,300.00                       |  |
|            | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 1,124,000   | 4.11   | 4,619,640.00                       |  |
|            | CITIC LTD                    | 1,524,000   | 9.24   | 14,081,760.00                      |  |
|            | FOSUN INTERNATIONAL LTD      | 682,500     | 12.10  | 8,258,250.00                       |  |
|            | HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS  | 200,000     | 28.50  | 5,700,000.00                       |  |
|            | SANY HEAVY EQUIPMENT INTL    | 266,000     | 8.87   | 2,359,420.00                       |  |
|            | SINOTRUK HONG KONG LTD       | 153,500     | 17.38  | 2,667,830.00                       |  |
|            | WEICHAH POWER CO LTD-H       | 406,800     | 17.42  | 7,086,456.00                       |  |
|            | XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H  | 285,000     | 12.70  | 3,619,500.00                       |  |
|            | ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H | 127,400     | 37.40  | 4,764,760.00                       |  |
|            | ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H  | 322,400     | 8.82   | 2,843,568.00                       |  |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| A-LIVING SMART CITY SERVICES | 138,000   | 36.95  | 5,099,100.00   |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 942,111   | 4.55   | 4,286,605.05   |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 365,000   | 78.40  | 28,616,000.00  |
| EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV | 232,000   | 20.05  | 4,651,600.00   |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 316,000   | 12.54  | 3,962,640.00   |
| AIR CHINA LTD-H              | 466,000   | 6.20   | 2,889,200.00   |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 406,000   | 5.48   | 2,224,880.00   |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 324,000   | 12.54  | 4,062,960.00   |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 280,000   | 5.29   | 1,481,200.00   |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 525,500   | 16.68  | 8,765,340.00   |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD     | 360,000   | 6.30   | 2,268,000.00   |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H     | 268,000   | 9.36   | 2,508,480.00   |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS       | 391,500   | 11.62  | 4,549,230.00   |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H     | 332,000   | 6.58   | 2,184,560.00   |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE  | 708,000   | 7.30   | 5,168,400.00   |
| BYD CO LTD-H                 | 189,500   | 189.70 | 35,948,150.00  |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 580,000   | 7.48   | 4,338,400.00   |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 121,600   | 51.50  | 6,262,400.00   |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 1,458,000 | 21.10  | 30,763,800.00  |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H   | 796,000   | 23.15  | 18,427,400.00  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 642,945   | 6.91   | 4,442,749.95   |
| MINTH GROUP LTD              | 174,000   | 34.00  | 5,916,000.00   |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD     | 340,000   | 17.20  | 5,848,000.00   |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 267,000   | 159.70 | 42,639,900.00  |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD      | 804,000   | 4.32   | 3,473,280.00   |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H    | 491,800   | 31.75  | 15,614,650.00  |
| LI NING CO LTD               | 554,500   | 75.00  | 41,587,500.00  |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 205,000   | 190.70 | 39,093,500.00  |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDING | 104,500   | 15.50  | 1,619,750.00   |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN | 178,000   | 19.84  | 3,531,520.00   |
| CHINA YUHUA EDUCATION CORP L | 504,000   | 7.85   | 3,956,400.00   |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 247,000   | 42.30  | 10,448,100.00  |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 202,000   | 27.50  | 5,555,000.00   |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD   | 2,400,000 | 1.05   | 2,520,000.00   |
| CHINA LITERATURE LTD         | 95,400    | 90.95  | 8,676,630.00   |
| KUAISHOU TECHNOLOGY          | 63,000    | 206.80 | 13,028,400.00  |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 1,407,400 | 600.50 | 845,143,700.00 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD    | 219,400   | 212.00 | 46,512,800.00  |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS  | 128,000   | 41.80  | 5,350,400.00   |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD     | 3,218,000 | 1.20   | 3,861,600.00   |
| HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD  | 644,000   | 6.90   | 4,443,600.00   |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC  | 64,450    | 98.30  | 6,335,435.00   |

|                              |           |        |                |  |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| MEITUAN-CLASS B              | 882,300   | 300.00 | 264,690,000.00 |  |
| TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD | 273,200   | 20.00  | 5,464,000.00   |  |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 434,000   | 12.22  | 5,303,480.00   |  |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS    | 150,000   | 68.20  | 10,230,000.00  |  |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD     | 449,500   | 5.90   | 2,652,050.00   |  |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 28,500    | 112.49 | 3,205,965.00   |  |
| CHINA FEIHE LTD              | 902,000   | 20.95  | 18,896,900.00  |  |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS | 372,000   | —      | —              |  |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO       | 786,000   | 44.10  | 34,662,600.00  |  |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 374,000   | 73.75  | 27,582,500.00  |  |
| DALI FOODS GROUP CO LTD      | 498,500   | 4.90   | 2,442,650.00   |  |
| NONGFU SPRING CO LTD-H       | 106,600   | 43.30  | 4,615,780.00   |  |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 304,000   | 49.00  | 14,896,000.00  |  |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 512,000   | 14.96  | 7,659,520.00   |  |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H    | 144,000   | 88.20  | 12,700,800.00  |  |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 301,000   | 8.80   | 2,648,800.00   |  |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 1,135,000 | 5.87   | 6,662,450.00   |  |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING  | 119,000   | 55.75  | 6,634,250.00   |  |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD     | 176,500   | 51.75  | 9,133,875.00   |  |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 101,000   | 26.50  | 2,676,500.00   |  |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 1,028,000 | 18.72  | 19,244,160.00  |  |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD   | 338,000   | 19.38  | 6,550,440.00   |  |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP    | 149,000   | 63.00  | 9,387,000.00   |  |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 106,300   | 89.50  | 9,513,850.00   |  |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 660,000   | 17.34  | 11,444,400.00  |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H   | 265,300   | 17.88  | 4,743,564.00   |  |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 311,600   | 27.85  | 8,678,060.00   |  |
| VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H | 51,000    | 70.90  | 3,615,900.00   |  |
| 3SBIO INC                    | 333,500   | 9.38   | 3,128,230.00   |  |
| AKESO INC                    | 71,000    | 62.20  | 4,416,200.00   |  |
| CANSINO BIOLOGICS INC-H      | 15,600    | 345.00 | 5,382,000.00   |  |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 365,000   | 21.00  | 7,665,000.00   |  |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 560,000   | 5.45   | 3,052,000.00   |  |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 596,000   | 5.04   | 3,003,840.00   |  |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 2,201,840 | 12.28  | 27,038,595.20  |  |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP       | 254,000   | 31.20  | 7,924,800.00   |  |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H | 26,500    | 165.30 | 4,380,450.00   |  |
| HANSON PHARMACEUTICAL GROUP  | 294,000   | 33.35  | 9,804,900.00   |  |
| INNOVENT BIOLOGICS INC       | 288,000   | 89.20  | 25,689,600.00  |  |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-H   | 30,200    | 178.70 | 5,396,740.00   |  |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 96,500    | 61.55  | 5,939,575.00   |  |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL       | 2,557,500 | 8.74   | 22,352,550.00  |  |

|                                  |            |        |                |
|----------------------------------|------------|--------|----------------|
| SSY GROUP LTD                    | 328,000    | 5.16   | 1,692,480.00   |
| WUXI APPTec CO LTD-H             | 64,184     | 168.40 | 10,808,585.60  |
| WUXI APPTec CO LTD-H-NEW         | 10,956     | 168.40 | 1,844,990.40   |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC        | 825,000    | 119.60 | 98,670,000.00  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H     | 6,621,000  | 3.10   | 20,525,100.00  |
| BANK OF CHINA LTD-H              | 19,837,000 | 2.83   | 56,138,710.00  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H      | 2,306,900  | 5.21   | 12,018,949.00  |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD-H        | 541,500    | 3.23   | 1,749,045.00   |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H      | 2,401,000  | 4.17   | 10,012,170.00  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H        | 23,613,550 | 6.20   | 146,404,010.00 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H     | 1,131,000  | 3.22   | 3,641,820.00   |
| CHINA MERCHANTS BANK-H           | 964,050    | 69.05  | 66,567,652.50  |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP-H    | 1,458,320  | 4.06   | 5,920,779.20   |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H     | 178,000    | 3.22   | 573,160.00     |
| IND & COMM BK OF CHINA-H         | 13,886,350 | 4.99   | 69,292,886.50  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H   | 1,973,000  | 5.49   | 10,831,770.00  |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H   | 2,271,000  | 1.64   | 3,724,440.00   |
| CHINA EVERBRIGHT LTD             | 270,000    | 9.63   | 2,600,100.00   |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H     | 1,093,500  | 4.77   | 5,215,995.00   |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT-H | 2,024,000  | 1.02   | 2,064,480.00   |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-H    | 337,200    | 21.95  | 7,401,540.00   |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H        | 600,000    | 20.80  | 12,480,000.00  |
| FAR EAST HORIZON LTD             | 513,000    | 8.30   | 4,257,900.00   |
| GF SECURITIES CO LTD-H           | 303,000    | 10.52  | 3,187,560.00   |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H      | 650,800    | 7.18   | 4,672,744.00   |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H       | 494,200    | 11.44  | 5,653,648.00   |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H        | 1,823,000  | 15.88  | 28,949,240.00  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP-H  | 609,600    | 26.85  | 16,367,760.00  |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD     | 353,400    | 14.04  | 4,961,736.00   |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H    | 241,600    | 28.25  | 6,825,200.00   |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP-H    | 2,258,000  | 2.89   | 6,525,620.00   |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H       | 1,778,000  | 7.28   | 12,943,840.00  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H     | 1,536,500  | 81.55  | 125,301,575.00 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H   | 115,800    | 39.00  | 4,516,200.00   |
| AGILE GROUP HOLDINGS LTD         | 270,000    | 10.74  | 2,899,800.00   |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD           | 264,000    | 7.51   | 1,982,640.00   |
| CHINA EVERGRANDE GROUP           | 457,000    | 11.78  | 5,383,460.00   |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP      | 1,588,000  | 3.05   | 4,843,400.00   |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST     | 929,500    | 18.30  | 17,009,850.00  |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD     | 390,000    | 8.20   | 3,198,000.00   |
| CHINA RESOURCES LAND LTD         | 786,000    | 35.55  | 27,942,300.00  |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE   | 78,600     | 43.60  | 3,426,960.00   |

|                              |            |        |               |
|------------------------------|------------|--------|---------------|
| CHINA VANKE CO LTD-H         | 418,551    | 25.70  | 10,756,760.70 |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD   | 848,000    | 6.86   | 5,817,280.00  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 1,794,232  | 9.35   | 16,776,069.20 |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS     | 164,500    | 8.74   | 1,437,730.00  |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 336,000    | 9.56   | 3,212,160.00  |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS  | 178,000    | 34.60  | 6,158,800.00  |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD     | 567,000    | 3.34   | 1,893,780.00  |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD       | 382,000    | 11.80  | 4,507,600.00  |
| LOGAN GROUP CO LTD           | 270,000    | 12.24  | 3,304,800.00  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD   | 448,000    | 44.70  | 20,025,600.00 |
| POLY PROPERTY SERVICES CO-H  | 20,400     | 60.35  | 1,231,140.00  |
| POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN | 328,000    | 7.56   | 2,479,680.00  |
| SEAZEN GROUP LTD             | 478,000    | 8.20   | 3,919,600.00  |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD      | 542,000    | 2.75   | 1,490,500.00  |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD    | 314,000    | 22.45  | 7,049,300.00  |
| SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD | 135,000    | 21.00  | 2,835,000.00  |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD     | 597,000    | 28.75  | 17,163,750.00 |
| SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD  | 143,000    | 23.45  | 3,353,350.00  |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 343,000    | 27.40  | 9,398,200.00  |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD       | 1,500,000  | 1.92   | 2,880,000.00  |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD  | 386,000    | 4.80   | 1,852,800.00  |
| CHINA YOUZAN LTD             | 3,528,000  | 1.38   | 4,868,640.00  |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR  | 655,000    | 28.55  | 18,700,250.00 |
| KINGSOFT CORP LTD            | 229,000    | 53.05  | 12,148,450.00 |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN | 89,000     | 38.70  | 3,444,300.00  |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H   | 307,000    | 16.66  | 5,114,620.00  |
| WEIMOB INC                   | 446,000    | 16.94  | 7,555,240.00  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 191,000    | 55.00  | 10,505,000.00 |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD   | 181,500    | 53.70  | 9,746,550.00  |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD       | 191,000    | 43.65  | 8,337,150.00  |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 232,500    | 17.48  | 4,064,100.00  |
| LENOVO GROUP LTD             | 1,756,000  | 9.15   | 16,067,400.00 |
| SUNNY OPTICAL TECH           | 178,700    | 200.20 | 35,775,740.00 |
| XIAOMI CORP-CLASS B          | 3,304,600  | 28.35  | 93,685,410.00 |
| ZTE CORP-H                   | 264,931    | 22.25  | 5,894,714.75  |
| CHINA TOWER CORP LTD-H       | 11,378,000 | 1.09   | 12,402,020.00 |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    | 131,500    | 27.55  | 3,622,825.00  |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 1,084,000  | 3.07   | 3,327,880.00  |
| CGN POWER CO LTD-H           | 2,425,000  | 1.71   | 4,146,750.00  |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD       | 778,800    | 29.65  | 23,091,420.00 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 889,000    | 10.72  | 9,530,080.00  |
| CHINA POWER INTERNATIONAL    | 1,234,000  | 1.71   | 2,110,140.00  |

|                |                              |             |        |                                      |  |
|----------------|------------------------------|-------------|--------|--------------------------------------|--|
|                | CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 236,000     | 48.55  | 11,457,800.00                        |  |
|                | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 558,000     | 10.04  | 5,602,320.00                         |  |
|                | ENN ENERGY HOLDINGS LTD      | 197,800     | 142.90 | 28,265,620.00                        |  |
|                | GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 818,000     | 11.28  | 9,227,040.00                         |  |
|                | HUANENG POWER INTL INC-H     | 678,000     | 2.85   | 1,932,300.00                         |  |
|                | KUNLUN ENERGY CO LTD         | 852,000     | 6.79   | 5,785,080.00                         |  |
|                | FLAT GLASS GROUP CO LTD-H    | 108,000     | 22.10  | 2,386,800.00                         |  |
|                | HANERGY THIN FILM POWER GROU | 960,000     | 3.91   | 3,753,600.00                         |  |
|                | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD   | 140,000     | 42.05  | 5,887,000.00                         |  |
|                | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD     | 1,234,000   | 13.10  | 16,165,400.00                        |  |
|                | 香港ドル 小計                      | 212,532,120 |        | 3,535,163,489.05<br>(49,881,156,830) |  |
| マレーシアリン<br>ギット | DIALOG GROUP BHD             | 1,231,180   | 2.92   | 3,595,045.60                         |  |
|                | PETRONAS DAGANGAN BHD        | 94,300      | 18.74  | 1,767,182.00                         |  |
|                | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 616,400     | 8.08   | 4,980,512.00                         |  |
|                | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 823,800     | 5.21   | 4,291,998.00                         |  |
|                | HAP SENG CONSOLIDATED        | 133,100     | 8.03   | 1,068,793.00                         |  |
|                | SIME DARBY BERHAD            | 631,900     | 2.26   | 1,428,094.00                         |  |
|                | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD  | 241,800     | 5.88   | 1,421,784.00                         |  |
|                | MISC BHD                     | 317,800     | 6.82   | 2,167,396.00                         |  |
|                | WESTPORTS HOLDINGS BHD       | 257,600     | 4.30   | 1,107,680.00                         |  |
|                | GENTING BHD                  | 614,800     | 5.06   | 3,110,888.00                         |  |
|                | GENTING MALAYSIA BHD         | 628,000     | 2.87   | 1,802,360.00                         |  |
|                | FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD  | 34,500      | 26.82  | 925,290.00                           |  |
|                | IOI CORP BHD                 | 768,200     | 4.03   | 3,095,846.00                         |  |
|                | KUALA LUMPUR KEPONG BHD      | 136,000     | 21.60  | 2,937,600.00                         |  |
|                | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD     | 18,700      | 135.70 | 2,537,590.00                         |  |
|                | PPB GROUP BERHAD             | 159,940     | 18.50  | 2,958,890.00                         |  |
|                | QL RESOURCES BHD             | 305,250     | 6.00   | 1,831,500.00                         |  |
|                | SIME DARBY PLANTATION BHD    | 454,900     | 4.38   | 1,992,462.00                         |  |
|                | HARTALEGA HOLDINGS BHD       | 441,900     | 8.57   | 3,787,083.00                         |  |
|                | IHH HEALTHCARE BHD           | 356,300     | 5.30   | 1,888,390.00                         |  |
|                | KOSSAN RUBBER INDUSTRIES     | 257,000     | 3.76   | 966,320.00                           |  |
|                | SUPERMAX CORP BHD            | 304,008     | 3.92   | 1,191,711.36                         |  |
|                | TOP GLOVE CORP BHD           | 1,364,000   | 4.90   | 6,683,600.00                         |  |
|                | AMMB HOLDINGS BHD            | 416,500     | 2.92   | 1,216,180.00                         |  |
|                | CIMB GROUP HOLDINGS BHD      | 1,634,300   | 4.45   | 7,272,635.00                         |  |
|                | HONG LEONG BANK BERHAD       | 141,300     | 18.54  | 2,619,702.00                         |  |
|                | HONG LEONG FINANCIAL GROUP   | 66,500      | 17.86  | 1,187,690.00                         |  |
|                | MALAYAN BANKING BHD          | 944,800     | 8.17   | 7,719,016.00                         |  |
|                | PUBLIC BANK BERHAD           | 3,572,500   | 4.20   | 15,004,500.00                        |  |
|                | RHB BANK BHD                 | 468,349     | 5.41   | 2,533,768.09                         |  |

|       |                              |            |        |                                   |  |
|-------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
|       | AXIATA GROUP BERHAD          | 751,100    | 3.87   | 2,906,757.00                      |  |
|       | DIGI.COM BHD                 | 712,600    | 4.18   | 2,978,668.00                      |  |
|       | MAXIS BHD                    | 571,800    | 4.53   | 2,590,254.00                      |  |
|       | TELEKOM MALAYSIA BHD         | 294,900    | 6.15   | 1,813,635.00                      |  |
|       | PETRONAS GAS BHD             | 173,500    | 16.20  | 2,810,700.00                      |  |
|       | TENAGA NASIONAL BHD          | 525,700    | 9.93   | 5,220,201.00                      |  |
|       | マレーシアリングット 小計                | 20,465,227 |        | 113,411,721.05<br>(3,013,326,745) |  |
| タイバーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR   | 355,400    | 120.00 | 42,648,000.00                     |  |
|       | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 645,300    | 31.00  | 20,004,300.00                     |  |
|       | PTT PCL-NVDR                 | 2,443,400  | 41.25  | 100,790,250.00                    |  |
|       | THAI OIL PCL-NVDR            | 238,100    | 59.25  | 14,107,425.00                     |  |
|       | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR   | 420,700    | 44.75  | 18,826,325.00                     |  |
|       | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 515,261    | 63.00  | 32,461,443.00                     |  |
|       | SCG PACKAGING PCL-NVDR       | 272,800    | 56.50  | 15,413,200.00                     |  |
|       | SIAM CEMENT PCL-NVDR         | 188,750    | 428.00 | 80,785,000.00                     |  |
|       | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 1,078,000  | 64.50  | 69,531,000.00                     |  |
|       | BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR      | 1,651,200  | 8.25   | 13,622,400.00                     |  |
|       | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR  | 1,886,600  | 9.50   | 17,922,700.00                     |  |
|       | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR    | 2,111,500  | 4.94   | 10,430,810.00                     |  |
|       | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 730,500    | 32.50  | 23,741,250.00                     |  |
|       | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 385,017    | 37.00  | 14,245,629.00                     |  |
|       | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 1,579,901  | 14.40  | 22,750,574.40                     |  |
|       | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR  | 243,700    | 35.00  | 8,529,500.00                      |  |
|       | CP ALL PCL-NVDR              | 1,425,200  | 60.00  | 85,512,000.00                     |  |
|       | CARABAO GROUP PCL-NVDR       | 62,800     | 132.00 | 8,289,600.00                      |  |
|       | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR  | 893,100    | 27.00  | 24,113,700.00                     |  |
|       | OSOTSPA PCL-NVDR             | 283,900    | 36.75  | 10,433,325.00                     |  |
|       | THAI UNION GROUP PCL-NVDR    | 727,600    | 17.80  | 12,951,280.00                     |  |
|       | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 2,305,700  | 21.60  | 49,803,120.00                     |  |
|       | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 143,300    | 131.00 | 18,772,300.00                     |  |
|       | SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR | 171,400    | 43.25  | 7,413,050.00                      |  |
|       | BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR  | 127,200    | 117.50 | 14,946,000.00                     |  |
|       | KRUNG THAI BANK - NVDR       | 791,400    | 11.00  | 8,705,400.00                      |  |
|       | SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR  | 240,100    | 102.50 | 24,610,250.00                     |  |
|       | BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR | 315,500    | 18.70  | 5,899,850.00                      |  |
|       | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR      | 264,500    | 72.25  | 19,110,125.00                     |  |
|       | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR   | 154,600    | 62.00  | 9,585,200.00                      |  |
|       | SRISAWAD CORP PCL-NVDR       | 213,200    | 74.00  | 15,776,800.00                     |  |
|       | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR     | 472,300    | 53.50  | 25,268,050.00                     |  |
|       | LAND & HOUSES PUB - NVDR     | 1,835,600  | 8.20   | 15,051,920.00                     |  |
|       | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR  | 78,000     | 572.00 | 44,616,000.00                     |  |

|           |                               |            |           |                                     |  |
|-----------|-------------------------------|------------|-----------|-------------------------------------|--|
|           | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR    | 313,300    | 169.50    | 53,104,350.00                       |  |
|           | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR     | 515,900    | 64.50     | 33,275,550.00                       |  |
|           | TRUE CORP PCL-NVDR            | 3,793,576  | 3.16      | 11,987,700.16                       |  |
|           | B GRIMM POWER PCL-NVDR        | 167,500    | 43.25     | 7,244,375.00                        |  |
|           | ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR   | 90,600     | 174.00    | 15,764,400.00                       |  |
|           | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR      | 323,100    | 59.75     | 19,305,225.00                       |  |
|           | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR     | 145,900    | 73.75     | 10,760,125.00                       |  |
|           | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR  | 689,800    | 34.00     | 23,453,200.00                       |  |
|           | RATCH GROUP PCL-NVDR          | 274,000    | 51.50     | 14,111,000.00                       |  |
|           | タイバーツ 小計                      | 31,565,205 |           | 1,095,673,701.56<br>(3,845,814,692) |  |
| フィリピンペソ   | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC   | 481,380    | 39.20     | 18,870,096.00                       |  |
|           | AYALA CORPORATION             | 64,145     | 795.00    | 50,995,275.00                       |  |
|           | GT CAPITAL HOLDINGS INC       | 21,594     | 590.00    | 12,740,460.00                       |  |
|           | JG SUMMIT HOLDINGS INC        | 800,189    | 60.50     | 48,411,434.50                       |  |
|           | SM INVESTMENTS CORP           | 56,225     | 990.00    | 55,662,750.00                       |  |
|           | INTL CONTAINER TERM SVCS INC  | 268,720    | 147.00    | 39,501,840.00                       |  |
|           | JOLLIBEE FOODS CORP           | 85,240     | 196.00    | 16,707,040.00                       |  |
|           | UNIVERSAL ROBINA CORP         | 244,100    | 141.00    | 34,418,100.00                       |  |
|           | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN  | 503,321    | 85.15     | 42,857,783.15                       |  |
|           | BDO UNIBANK INC               | 511,370    | 106.40    | 54,409,768.00                       |  |
|           | METROPOLITAN BANK & TRUST     | 402,156    | 48.85     | 19,645,320.60                       |  |
|           | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO  | 3,662,500  | 4.07      | 14,906,375.00                       |  |
|           | AYALA LAND INC                | 2,032,520  | 36.30     | 73,780,476.00                       |  |
|           | SM PRIME HOLDINGS INC         | 2,411,100  | 36.65     | 88,366,815.00                       |  |
|           | GLOBE TELECOM INC             | 9,035      | 1,840.00  | 16,624,400.00                       |  |
|           | PLDT INC                      | 19,005     | 1,323.00  | 25,143,615.00                       |  |
|           | MANILA ELECTRIC COMPANY       | 50,740     | 275.00    | 13,953,500.00                       |  |
|           | フィリピンペソ 小計                    | 11,623,340 |           | 626,995,048.25<br>(1,439,643,330)   |  |
| インドネシアルピア | ADARO ENERGY TBK PT           | 3,549,400  | 1,205.00  | 4,277,027,000.00                    |  |
|           | UNITED TRACTORS TBK PT        | 453,800    | 22,975.00 | 10,426,055,000.00                   |  |
|           | ANEKA TAMBANG TBK             | 1,970,300  | 2,380.00  | 4,689,314,000.00                    |  |
|           | BARITO PACIFIC TBK PT         | 6,302,100  | 885.00    | 5,577,358,500.00                    |  |
|           | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK   | 597,800    | 8,925.00  | 5,335,365,000.00                    |  |
|           | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA   | 310,600    | 12,300.00 | 3,820,380,000.00                    |  |
|           | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT    | 2,589,200  | 2,700.00  | 6,990,840,000.00                    |  |
|           | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK   | 640,400    | 10,400.00 | 6,660,160,000.00                    |  |
|           | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT    | 5,047,800  | 5,250.00  | 26,500,950,000.00                   |  |
|           | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 1,879,700  | 7,100.00  | 13,345,870,000.00                   |  |
|           | GUDANG GARAM TBK PT           | 96,000     | 33,475.00 | 3,213,600,000.00                    |  |
|           | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T  | 533,700    | 8,350.00  | 4,456,395,000.00                    |  |

|         |                              |            |           |                                       |  |
|---------|------------------------------|------------|-----------|---------------------------------------|--|
|         | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | 965,400    | 6,575.00  | 6,347,505,000.00                      |  |
|         | UNILEVER INDONESIA TBK PT    | 2,166,000  | 5,625.00  | 12,183,750,000.00                     |  |
|         | KALBE FARMA TBK PT           | 4,976,000  | 1,495.00  | 7,439,120,000.00                      |  |
|         | BANK CENTRAL ASIA TBK PT     | 2,753,400  | 32,650.00 | 89,898,510,000.00                     |  |
|         | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT  | 4,382,100  | 6,125.00  | 26,840,362,500.00                     |  |
|         | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 1,705,200  | 5,525.00  | 9,421,230,000.00                      |  |
|         | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 13,764,200 | 4,250.00  | 58,497,850,000.00                     |  |
|         | SARANA MENARA NUSANTARA PT   | 7,334,800  | 1,270.00  | 9,315,196,000.00                      |  |
|         | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 12,592,100 | 3,550.00  | 44,701,955,000.00                     |  |
|         | TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE | 1,859,700  | 2,950.00  | 5,486,115,000.00                      |  |
|         | インドネシアルピア 小計                 | 76,469,700 |           | 365,424,908,000.00<br>(2,813,771,791) |  |
| メキシコペソ  | CEMEX SAB-CPO                | 3,768,168  | 16.85     | 63,493,630.80                         |  |
|         | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 776,170    | 92.88     | 72,090,669.60                         |  |
|         | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 29,305     | 310.49    | 9,098,909.45                          |  |
|         | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 232,398    | 56.02     | 13,018,935.96                         |  |
|         | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 96,600     | 65.23     | 6,301,218.00                          |  |
|         | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 96,600     | 214.95    | 20,764,170.00                         |  |
|         | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B | 48,960     | 351.86    | 17,227,065.60                         |  |
|         | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 56,210     | 162.93    | 9,158,295.30                          |  |
|         | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO   | 609,100    | 58.75     | 35,784,625.00                         |  |
|         | MEGACABLE HOLDINGS-CPO       | 83,700     | 74.54     | 6,238,998.00                          |  |
|         | WALMART DE MEXICO SAB DE CV  | 1,277,700  | 64.62     | 82,564,974.00                         |  |
|         | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV   | 89,966     | 112.05    | 10,080,690.30                         |  |
|         | BECLE SAB DE CV              | 104,800    | 53.28     | 5,583,744.00                          |  |
|         | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV    | 147,200    | 100.57    | 14,803,904.00                         |  |
|         | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 485,300    | 172.03    | 83,486,159.00                         |  |
|         | GRUMA S.A.B. -B              | 46,275     | 216.91    | 10,037,510.25                         |  |
|         | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A    | 424,600    | 44.26     | 18,792,796.00                         |  |
|         | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A   | 382,900    | 37.38     | 14,312,802.00                         |  |
|         | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O   | 637,200    | 138.99    | 88,564,428.00                         |  |
|         | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O   | 550,200    | 21.15     | 11,636,730.00                         |  |
|         | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 8,322,300  | 15.99     | 133,073,577.00                        |  |
|         | TELESITES SAB DE CV          | 434,300    | 19.56     | 8,494,908.00                          |  |
|         | メキシコペソ 小計                    | 18,699,952 |           | 734,608,740.26<br>(4,053,203,724)     |  |
| ブラジルリアル | COSAN SA                     | 271,600    | 24.91     | 6,765,556.00                          |  |
|         | PETROBRAS - PETROLEO BRAS    | 881,300    | 28.72     | 25,310,936.00                         |  |
|         | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 1,207,700  | 28.29     | 34,165,833.00                         |  |
|         | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA    | 151,600    | 21.33     | 3,233,628.00                          |  |
|         | BRADSPAR SA -PREF            | 52,700     | 70.16     | 3,697,432.00                          |  |
|         | BRASKEM SA-PREF A            | 47,300     | 60.20     | 2,847,460.00                          |  |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA  | 178,900   | 44.27  | 7,919,903.00   |
| GERDAU SA-PREF               | 285,100   | 31.89  | 9,091,839.00   |
| KLABIN SA - UNIT             | 169,200   | 25.84  | 4,372,128.00   |
| SUZANO SA                    | 181,822   | 59.50  | 10,818,409.00  |
| VALE SA                      | 969,330   | 111.80 | 108,371,094.00 |
| WEG SA                       | 396,488   | 34.13  | 13,532,135.44  |
| CCR SA                       | 339,300   | 14.08  | 4,777,344.00   |
| LOCALIZA RENT A CAR          | 152,613   | 67.00  | 10,225,071.00  |
| RUMO SA                      | 346,300   | 21.12  | 7,313,856.00   |
| ALPARGATAS SA - PREF         | 50,800    | 46.67  | 2,370,836.00   |
| B2W CIA DIGITAL              | 48,700    | 65.71  | 3,200,077.00   |
| LOJAS AMERICANAS SA-PREF     | 242,661   | 21.81  | 5,292,436.41   |
| LOJAS RENNER S.A.            | 219,920   | 48.40  | 10,644,128.00  |
| MAGAZINE LUIZA SA            | 740,500   | 20.80  | 15,402,400.00  |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA   | 172,000   | 27.71  | 4,766,120.00   |
| VIA VAREJO SA                | 274,300   | 14.65  | 4,018,495.00   |
| ATACADAO SA                  | 123,600   | 23.03  | 2,846,508.00   |
| RAIA DROGASIL SA             | 269,700   | 28.34  | 7,643,298.00   |
| AMBEV SA                     | 1,165,900 | 19.60  | 22,851,640.00  |
| BRF SA                       | 159,700   | 28.51  | 4,553,047.00   |
| JBS SA                       | 262,100   | 29.75  | 7,797,475.00   |
| NATURA &CO HOLDING SA        | 211,500   | 56.86  | 12,025,890.00  |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 296,500   | 15.80  | 4,684,700.00   |
| NOTRE DAME INTERMED PAR SA   | 120,900   | 86.70  | 10,482,030.00  |
| REDE D'OR SAO LUIZ SA        | 56,300    | 68.50  | 3,856,550.00   |
| HYPERA SA                    | 104,800   | 36.98  | 3,875,504.00   |
| BANCO BRADESCO S.A.          | 314,425   | 24.41  | 7,675,114.25   |
| BANCO BRADESCO SA-PREF       | 1,225,733 | 28.44  | 34,859,846.52  |
| BANCO DO BRASIL S.A.         | 186,700   | 36.52  | 6,818,284.00   |
| BANCO INTER SA-UNITS         | 67,800    | 63.78  | 4,324,284.00   |
| BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT  | 92,500    | 45.82  | 4,238,350.00   |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 1,189,130 | 33.04  | 39,288,855.20  |
| ITAUSA SA                    | 1,039,607 | 12.05  | 12,527,264.35  |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO    | 1,510,425 | 17.29  | 26,115,248.25  |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT    | 68,900    | 122.18 | 8,418,202.00   |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES  | 148,900   | 24.61  | 3,664,429.00   |
| TOTVS SA                     | 141,400   | 36.15  | 5,111,610.00   |
| TELEFONICA BRASIL S.A.       | 121,075   | 46.10  | 5,581,557.50   |
| TIM SA                       | 188,377   | 12.53  | 2,360,363.81   |
| CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 73,900    | 46.16  | 3,411,224.00   |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 73,500    | 46.38  | 3,408,930.00   |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 221,777   | 13.96  | 3,096,006.92   |

|       |                              |            |            |                                    |  |
|-------|------------------------------|------------|------------|------------------------------------|--|
|       | CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | 187,000    | 6.37       | 1,191,190.00                       |  |
|       | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP  | 96,700     | 38.79      | 3,750,993.00                       |  |
|       | CPFL ENERGIA SA              | 44,600     | 29.98      | 1,337,108.00                       |  |
|       | ENERGISA SA-UNITS            | 40,100     | 49.01      | 1,965,301.00                       |  |
|       | ENGIE BRASIL ENERGIA SA      | 42,050     | 41.20      | 1,732,460.00                       |  |
|       | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD  | 247,000    | 24.93      | 6,157,710.00                       |  |
|       | ブラジルリアル 小計                   | 17,472,733 |            | 565,788,090.65<br>(12,270,189,743) |  |
| チリペソ  | EMPRESAS COPEC SA            | 93,709     | 7,010.00   | 656,900,090.00                     |  |
|       | EMPRESAS CMPC SA             | 299,994    | 1,660.00   | 497,990,040.00                     |  |
|       | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 31,364     | 32,510.00  | 1,019,643,640.00                   |  |
|       | FALABELLA SA                 | 162,654    | 3,050.00   | 496,094,700.00                     |  |
|       | CENCOSUD SA                  | 308,874    | 1,370.00   | 423,157,380.00                     |  |
|       | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA    | 37,740     | 6,520.00   | 246,064,800.00                     |  |
|       | BANCO DE CHILE               | 13,479,794 | 70.67      | 952,617,041.00                     |  |
|       | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 12,739     | 31,501.00  | 401,291,239.00                     |  |
|       | BANCO SANTANDER CHILE        | 15,407,613 | 37.73      | 581,329,238.00                     |  |
|       | CENCOSUD SHOPPING SA         | 94,600     | 1,168.20   | 110,511,720.00                     |  |
|       | COLBUN SA                    | 1,804,090  | 102.20     | 184,377,998.00                     |  |
|       | ENEL AMERICAS SA             | 5,030,402  | 98.00      | 492,979,396.00                     |  |
|       | ENEL CHILE SA                | 6,014,289  | 40.30      | 242,375,846.00                     |  |
|       | チリペソ 小計                      | 42,777,862 |            | 6,305,333,128.00<br>(964,293,511)  |  |
| 韓国ウォン | GS HOLDINGS                  | 10,450     | 47,400.00  | 495,330,000.00                     |  |
|       | S-OIL CORP                   | 11,837     | 102,500.00 | 1,213,292,500.00                   |  |
|       | SK INNOVATION CO LTD         | 12,409     | 274,500.00 | 3,406,270,500.00                   |  |
|       | HANWHA SOLUTIONS CORP        | 30,542     | 45,100.00  | 1,377,444,200.00                   |  |
|       | HYUNDAI STEEL CO             | 22,295     | 51,800.00  | 1,154,881,000.00                   |  |
|       | KOREA ZINC CO LTD            | 1,964      | 436,500.00 | 857,286,000.00                     |  |
|       | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD   | 4,138      | 229,000.00 | 947,602,000.00                     |  |
|       | LG CHEM LTD                  | 11,280     | 814,000.00 | 9,181,920,000.00                   |  |
|       | LG CHEM LTD-PREFERENCE       | 1,778      | 370,000.00 | 657,860,000.00                     |  |
|       | LOTTE CHEMICAL CORP          | 4,381      | 281,500.00 | 1,233,251,500.00                   |  |
|       | POSCO                        | 18,234     | 339,500.00 | 6,190,443,000.00                   |  |
|       | POSCO CHEMICAL CO LTD        | 6,837      | 143,500.00 | 981,109,500.00                     |  |
|       | SK CHEMICALS CO LTD/NEW      | 1,700      | 253,500.00 | 430,950,000.00                     |  |
|       | SKC CO LTD                   | 4,600      | 134,500.00 | 618,700,000.00                     |  |
|       | CJ CORP                      | 3,215      | 111,500.00 | 358,472,500.00                     |  |
|       | DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 6,507      | 39,400.00  | 256,375,800.00                     |  |
|       | DOOSAN BOBCAT INC            | 11,016     | 51,600.00  | 568,425,600.00                     |  |
|       | DOOSAN HEAVY INDUSTRIES      | 51,831     | 32,000.00  | 1,658,592,000.00                   |  |
|       | GS ENGINEERING & CONSTRUCT   | 12,404     | 44,950.00  | 557,559,800.00                     |  |

|                              |         |            |                   |  |
|------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST  | 19,938  | 56,300.00  | 1,122,509,400.00  |  |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL | 10,300  | 75,100.00  | 773,530,000.00    |  |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES   | 17,547  | 34,550.00  | 606,248,850.00    |  |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 10,023  | 143,000.00 | 1,433,289,000.00  |  |
| LG CORP                      | 20,869  | 99,900.00  | 2,084,813,100.00  |  |
| SAMSUNG C&T CORP             | 20,591  | 141,500.00 | 2,913,626,500.00  |  |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD   | 38,530  | 19,550.00  | 753,261,500.00    |  |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES     | 108,001 | 7,110.00   | 767,887,110.00    |  |
| SK HOLDINGS CO LTD           | 7,904   | 271,000.00 | 2,141,984,000.00  |  |
| S-1 CORPORATION              | 3,622   | 82,000.00  | 297,004,000.00    |  |
| CJ LOGISTICS                 | 1,801   | 166,500.00 | 299,866,500.00    |  |
| HMM CO LTD                   | 64,136  | 42,350.00  | 2,716,159,600.00  |  |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD        | 4,206   | 194,000.00 | 815,964,000.00    |  |
| KOREAN AIR LINES CO LTD      | 33,271  | 32,300.00  | 1,074,653,300.00  |  |
| PAN OCEAN CO LTD             | 57,176  | 6,420.00   | 367,069,920.00    |  |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 16,564  | 53,700.00  | 889,486,800.00    |  |
| HANON SYSTEMS                | 51,109  | 17,350.00  | 886,741,150.00    |  |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD         | 16,273  | 285,500.00 | 4,645,941,500.00  |  |
| HYUNDAI MOTOR CO             | 34,433  | 241,500.00 | 8,315,569,500.00  |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 7,866   | 119,000.00 | 936,054,000.00    |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF     | 5,330   | 115,000.00 | 612,950,000.00    |  |
| KIA CORP                     | 65,233  | 90,000.00  | 5,870,970,000.00  |  |
| COWAY CO LTD                 | 14,159  | 79,800.00  | 1,129,888,200.00  |  |
| FILA HOLDINGS CORP           | 11,149  | 56,600.00  | 631,033,400.00    |  |
| HLB INC                      | 25,479  | 33,000.00  | 840,807,000.00    |  |
| LG ELECTRONICS INC           | 26,380  | 155,000.00 | 4,088,900,000.00  |  |
| KANGWON LAND INC             | 23,051  | 28,550.00  | 658,106,050.00    |  |
| CHEIL WORLDWIDE INC          | 17,976  | 25,050.00  | 450,298,800.00    |  |
| HYBE CO LTD                  | 2,100   | 265,500.00 | 557,550,000.00    |  |
| KAKAO CORP                   | 76,025  | 126,000.00 | 9,579,150,000.00  |  |
| NAVER CORP                   | 30,085  | 362,500.00 | 10,905,812,500.00 |  |
| NCSOFT CORP                  | 4,063   | 843,000.00 | 3,425,109,000.00  |  |
| NETMARBLE CORP               | 4,825   | 140,000.00 | 675,500,000.00    |  |
| PEARL ABYSS CORP             | 8,795   | 57,800.00  | 508,351,000.00    |  |
| CJ ENM CO LTD                | 2,684   | 165,000.00 | 442,860,000.00    |  |
| HOTEL SHILLA CO LTD          | 9,228   | 97,300.00  | 897,884,400.00    |  |
| LOTTE SHOPPING CO            | 2,198   | 122,000.00 | 268,156,000.00    |  |
| SHINSEGAE INC                | 1,778   | 305,500.00 | 543,179,000.00    |  |
| BGF RETAIL CO LTD            | 1,349   | 192,000.00 | 259,008,000.00    |  |
| E-MART INC                   | 4,567   | 160,000.00 | 730,720,000.00    |  |
| CJ CHEILJEDANG CORP          | 1,754   | 471,500.00 | 827,011,000.00    |  |
| KT&G CORP                    | 28,766  | 84,500.00  | 2,430,727,000.00  |  |

|                              |           |              |                   |  |
|------------------------------|-----------|--------------|-------------------|--|
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 6,322     | 119,500.00   | 755,479,000.00    |  |
| AMOREPACIFIC CORP            | 7,777     | 274,000.00   | 2,130,898,000.00  |  |
| AMOREPACIFIC GROUP           | 7,000     | 77,000.00    | 539,000,000.00    |  |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE   | 2,400     | 1,535,000.00 | 3,684,000,000.00  |  |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF   | 464       | 720,000.00   | 334,080,000.00    |  |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD  | 21,013    | 117,300.00   | 2,464,824,900.00  |  |
| ALTEOGEN INC                 | 8,400     | 69,900.00    | 587,160,000.00    |  |
| CELLTRION INC                | 23,588    | 264,500.00   | 6,239,026,000.00  |  |
| CELLTRION PHARM INC          | 3,565     | 135,400.00   | 482,701,000.00    |  |
| GREEN CROSS CORP             | 1,300     | 328,000.00   | 426,400,000.00    |  |
| HANMI PHARM CO LTD           | 1,525     | 332,000.00   | 506,300,000.00    |  |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD     | 4,078     | 842,000.00   | 3,433,676,000.00  |  |
| SEEGENE INC                  | 12,200    | 61,900.00    | 755,180,000.00    |  |
| SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO | 9,500     | 62,900.00    | 597,550,000.00    |  |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 6,576     | 114,000.00   | 749,664,000.00    |  |
| YUHAN CORP                   | 13,058    | 63,800.00    | 833,100,400.00    |  |
| HANA FINANCIAL GROUP         | 74,542    | 47,100.00    | 3,510,928,200.00  |  |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA     | 54,119    | 11,000.00    | 595,309,000.00    |  |
| KB FINANCIAL GROUP INC       | 94,688    | 58,000.00    | 5,491,904,000.00  |  |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD  | 108,536   | 42,900.00    | 4,656,194,400.00  |  |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC    | 125,481   | 11,650.00    | 1,461,853,650.00  |  |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 11,043    | 109,500.00   | 1,209,208,500.00  |  |
| MERITZ SECURITIES CO LTD     | 58,500    | 4,480.00     | 262,080,000.00    |  |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LT | 62,989    | 10,000.00    | 629,890,000.00    |  |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 20,867    | 13,050.00    | 272,314,350.00    |  |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD    | 14,954    | 46,500.00    | 695,361,000.00    |  |
| DB INSURANCE CO LTD          | 9,631     | 50,700.00    | 488,291,700.00    |  |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS    | 7,579     | 217,000.00   | 1,644,643,000.00  |  |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 17,430    | 83,700.00    | 1,458,891,000.00  |  |
| DOUZONE BIZON CO LTD         | 4,200     | 80,800.00    | 339,360,000.00    |  |
| SAMSUNG SDS CO LTD           | 9,231     | 188,500.00   | 1,740,043,500.00  |  |
| KMW CO LTD                   | 6,037     | 54,700.00    | 330,223,900.00    |  |
| LG DISPLAY CO LTD            | 60,126    | 23,700.00    | 1,424,986,200.00  |  |
| LG INNOTEK CO LTD            | 3,321     | 213,000.00   | 707,373,000.00    |  |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 13,353    | 180,000.00   | 2,403,540,000.00  |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | 1,167,585 | 81,900.00    | 95,625,211,500.00 |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | 201,147   | 74,500.00    | 14,985,451,500.00 |  |
| SAMSUNG SDI CO LTD           | 13,450    | 622,000.00   | 8,365,900,000.00  |  |
| LG UPLUS CORP                | 46,629    | 15,400.00    | 718,086,600.00    |  |
| SK TELECOM                   | 9,597     | 323,500.00   | 3,104,629,500.00  |  |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP    | 65,039    | 27,150.00    | 1,765,808,850.00  |  |
| SK HYNIX INC                 | 133,508   | 128,500.00   | 17,155,778,000.00 |  |

|         |                              |           |        |                                        |  |
|---------|------------------------------|-----------|--------|----------------------------------------|--|
|         | 韓国ウォン 小計                     | 3,660,900 |        | 307,883,697,630.00<br>(30,326,544,216) |  |
| ニュー台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP   | 241,150   | 106.50 | 25,682,475.00                          |  |
|         | ASIA CEMENT CORP             | 581,281   | 51.10  | 29,703,459.10                          |  |
|         | CHINA STEEL CORP             | 2,911,947 | 37.30  | 108,615,623.10                         |  |
|         | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE    | 847,430   | 87.60  | 74,234,868.00                          |  |
|         | FORMOSA PLASTICS CORP        | 950,600   | 106.50 | 101,238,900.00                         |  |
|         | NAN YA PLASTICS CORP         | 1,271,557 | 85.60  | 108,845,279.20                         |  |
|         | TAIWAN CEMENT                | 1,223,405 | 51.50  | 63,005,357.50                          |  |
|         | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP   | 34,000    | 994.00 | 33,796,000.00                          |  |
|         | FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 779,138   | 31.75  | 24,737,631.50                          |  |
|         | HIWIN TECHNOLOGIES CORP      | 66,827    | 382.50 | 25,561,327.50                          |  |
|         | EVERGREEN MARINE CORP LTD    | 650,883   | 110.50 | 71,922,571.50                          |  |
|         | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP  | 500,000   | 29.20  | 14,600,000.00                          |  |
|         | WAN HAI LINES LTD            | 143,000   | 153.00 | 21,879,000.00                          |  |
|         | YANG MING MARINE TRANSPORT   | 413,000   | 107.00 | 44,191,000.00                          |  |
|         | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 386,413   | 46.40  | 17,929,563.20                          |  |
|         | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD    | 50,728    | 639.00 | 32,415,192.00                          |  |
|         | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD   | 112,981   | 238.00 | 26,889,478.00                          |  |
|         | GIANT MANUFACTURING          | 78,000    | 318.00 | 24,804,000.00                          |  |
|         | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD  | 35,000    | 411.00 | 14,385,000.00                          |  |
|         | POU CHEN                     | 496,500   | 39.00  | 19,363,500.00                          |  |
|         | HOTAI MOTOR COMPANY LTD      | 72,000    | 560.00 | 40,320,000.00                          |  |
|         | PRESIDENT CHAIN STORE CORP   | 152,000   | 262.00 | 39,824,000.00                          |  |
|         | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 1,145,624 | 73.00  | 83,630,552.00                          |  |
|         | ONENESS BIOTECH CO LTD       | 67,000    | 203.00 | 13,601,000.00                          |  |
|         | CHANG HWA COMMERCIAL BANK    | 986,145   | 16.70  | 16,468,621.50                          |  |
|         | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 4,470,955 | 22.55  | 100,820,035.25                         |  |
|         | E.SUN FINANCIAL HOLDING CO   | 2,758,435 | 25.90  | 71,443,466.50                          |  |
|         | FIRST FINANCIAL HOLDING CO   | 2,611,360 | 22.10  | 57,711,056.00                          |  |
|         | HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 2,078,972 | 18.20  | 37,837,290.40                          |  |
|         | MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 2,685,754 | 33.10  | 88,898,457.40                          |  |
|         | SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS   | 2,455,018 | 13.65  | 33,510,995.70                          |  |
|         | TAISHIN FINANCIAL HOLDING    | 2,423,875 | 15.20  | 36,842,900.00                          |  |
|         | TAIWAN BUSINESS BANK         | 1,473,401 | 9.51   | 14,012,043.51                          |  |
|         | TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 2,262,018 | 21.00  | 47,502,378.00                          |  |
|         | THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 859,000   | 45.00  | 38,655,000.00                          |  |
|         | CHAILEASE HOLDING CO LTD     | 303,217   | 204.50 | 62,007,876.50                          |  |
|         | YUANTA FINANCIAL HOLDING CO  | 2,415,213 | 25.50  | 61,587,931.50                          |  |
|         | CATHAY FINANCIAL HOLDING CO  | 1,862,366 | 54.70  | 101,871,420.20                         |  |
|         | CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL  | 3,250,255 | 12.50  | 40,628,187.50                          |  |
|         | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD  | 459,119   | 24.50  | 11,248,415.50                          |  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO   | 1,581,087 | 73.20    | 115,735,568.40 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING  | 2,867,852 | 9.92     | 28,449,091.84  |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD   | 163,080   | 52.20    | 8,512,776.00   |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP       | 135,000   | 293.50   | 39,622,500.00  |
| ACER INC                     | 681,168   | 31.35    | 21,354,616.80  |
| ADVANTECH CO LTD             | 99,134    | 324.50   | 32,168,983.00  |
| ASUSTEK COMPUTER INC         | 180,774   | 388.00   | 70,140,312.00  |
| AU OPTRONICS CORP            | 1,995,000 | 25.30    | 50,473,500.00  |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD    | 172,000   | 180.50   | 31,046,000.00  |
| COMPAL ELECTRONICS           | 1,118,775 | 23.05    | 25,787,763.75  |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 479,220   | 297.00   | 142,328,340.00 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD    | 205,042   | 63.50    | 13,020,167.00  |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY   | 3,057,272 | 110.50   | 337,828,556.00 |
| INNOLUX CORP                 | 2,043,112 | 23.60    | 48,217,443.20  |
| INVENTEC CORP                | 710,429   | 25.70    | 18,258,025.30  |
| LARGAN PRECISION CO LTD      | 24,820    | 3,080.00 | 76,445,600.00  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP      | 558,160   | 65.30    | 36,447,848.00  |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO  | 175,000   | 171.00   | 29,925,000.00  |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 52,000    | 352.00   | 18,304,000.00  |
| PEGATRON CORP                | 501,976   | 72.90    | 36,594,050.40  |
| QUANTA COMPUTER INC          | 668,150   | 87.00    | 58,129,050.00  |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP  | 380,193   | 59.50    | 22,621,483.50  |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP    | 275,000   | 127.50   | 35,062,500.00  |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP       | 87,000    | 199.50   | 17,356,500.00  |
| WISTRON CORP                 | 719,865   | 30.55    | 21,991,875.75  |
| WIWYNN CORP                  | 18,000    | 898.00   | 16,164,000.00  |
| WPG HOLDINGS LTD             | 448,168   | 51.00    | 22,856,568.00  |
| YAGEO CORPORATION            | 92,952    | 477.50   | 44,384,580.00  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 190,000   | 96.40    | 18,316,000.00  |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD      | 925,000   | 114.00   | 105,450,000.00 |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD  | 405,000   | 65.60    | 26,568,000.00  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD         | 398,400   | 101.00   | 40,238,400.00  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 814,294   | 115.50   | 94,050,957.00  |
| ASMEDIA TECHNOLOGY INC       | 6,000     | 1,395.00 | 8,370,000.00   |
| GLOBALWAFERS CO LTD          | 55,000    | 852.00   | 46,860,000.00  |
| MEDIATEK INC                 | 369,236   | 973.00   | 359,266,628.00 |
| NANYA TECHNOLOGY CORP        | 266,000   | 79.40    | 21,120,400.00  |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 139,000   | 519.00   | 72,141,000.00  |
| PHISON ELECTRONICS CORP      | 34,000    | 468.00   | 15,912,000.00  |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC     | 179,300   | 104.50   | 18,736,850.00  |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP   | 113,703   | 504.00   | 57,306,312.00  |
| SILERGY CORP                 | 20,000    | 3,365.00 | 67,300,000.00  |

|        |                              |            |           |                                      |  |
|--------|------------------------------|------------|-----------|--------------------------------------|--|
|        | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 6,019,000  | 592.00    | 3,563,248,000.00                     |  |
|        | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 2,914,000  | 52.30     | 152,402,200.00                       |  |
|        | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI  | 235,000    | 113.50    | 26,672,500.00                        |  |
|        | WIN SEMICONDUCTORS CORP      | 85,000     | 325.00    | 27,625,000.00                        |  |
|        | WINBOND ELECTRONICS CORP     | 665,000    | 34.10     | 22,676,500.00                        |  |
|        | ニュー台湾ドル 小計                   | 79,888,729 |           | 8,045,709,299.00<br>(31,778,138,018) |  |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD    | 189,962    | 481.40    | 91,447,706.80                        |  |
|        | COAL INDIA LTD               | 338,932    | 156.25    | 52,958,125.00                        |  |
|        | HINDUSTAN PETROLEUM CORP     | 156,492    | 301.10    | 47,119,741.20                        |  |
|        | INDIAN OIL CORP LTD          | 516,993    | 114.70    | 59,299,097.10                        |  |
|        | OIL & NATURAL GAS CORP LTD   | 552,299    | 125.15    | 69,120,219.85                        |  |
|        | PETRONET LNG LTD             | 175,697    | 249.35    | 43,810,046.95                        |  |
|        | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | 695,774    | 2,227.40  | 1,549,767,007.60                     |  |
|        | ACC LTD                      | 22,031     | 2,045.95  | 45,074,324.45                        |  |
|        | AMBUJA CEMENTS LTD           | 186,640    | 339.05    | 63,280,292.00                        |  |
|        | ASIAN PAINTS LTD             | 94,827     | 2,933.10  | 278,137,073.70                       |  |
|        | BERGER PAINTS INDIA LTD      | 71,672     | 810.65    | 58,100,906.80                        |  |
|        | GRASIM INDUSTRIES LTD        | 65,833     | 1,501.00  | 98,815,333.00                        |  |
|        | HINDALCO INDUSTRIES LTD      | 380,502    | 395.00    | 150,298,290.00                       |  |
|        | JSW STEEL LTD                | 212,769    | 715.75    | 152,289,411.75                       |  |
|        | PI INDUSTRIES LTD            | 20,025     | 2,696.25  | 53,992,406.25                        |  |
|        | PIDILITE INDUSTRIES LTD      | 40,406     | 2,084.40  | 84,222,266.40                        |  |
|        | SHREE CEMENT LTD             | 2,750      | 29,155.80 | 80,178,450.00                        |  |
|        | TATA STEEL LTD               | 154,825    | 1,128.70  | 174,750,977.50                       |  |
|        | ULTRATECH CEMENT LTD         | 24,761     | 6,849.65  | 169,604,183.65                       |  |
|        | UPL LTD                      | 123,969    | 850.50    | 105,435,634.50                       |  |
|        | VEDANTA LTD                  | 263,102    | 278.00    | 73,142,356.00                        |  |
|        | ADANI ENTERPRISES LTD        | 63,200     | 1,624.30  | 102,655,760.00                       |  |
|        | BHARAT ELECTRONICS LTD       | 275,300    | 153.30    | 42,203,490.00                        |  |
|        | HAVELLS INDIA LTD            | 51,620     | 1,050.80  | 54,242,296.00                        |  |
|        | LARSEN & TOUBRO LTD          | 171,087    | 1,557.80  | 266,519,328.60                       |  |
|        | SIEMENS LTD                  | 16,922     | 2,110.90  | 35,720,649.80                        |  |
|        | ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 125,868    | 878.60    | 110,587,624.80                       |  |
|        | CONTAINER CORP OF INDIA LTD  | 59,098     | 719.70    | 42,532,830.60                        |  |
|        | INTERGLOBE AVIATION LTD      | 22,647     | 1,755.45  | 39,755,676.15                        |  |
|        | BAJAJ AUTO LTD               | 15,873     | 4,249.75  | 67,456,281.75                        |  |
|        | BALKRISHNA INDUSTRIES LTD    | 24,768     | 2,244.65  | 55,595,491.20                        |  |
|        | BHARAT FORGE LTD             | 57,811     | 750.00    | 43,358,250.00                        |  |
|        | EICHER MOTORS LTD            | 33,754     | 2,754.45  | 92,973,705.30                        |  |
|        | HERO MOTOCORP LTD            | 26,827     | 3,052.25  | 81,882,710.75                        |  |
|        | MAHINDRA & MAHINDRA LTD      | 205,554    | 803.85    | 165,234,582.90                       |  |

|                              |           |           |                  |
|------------------------------|-----------|-----------|------------------|
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | 33,662    | 7,275.65  | 244,912,930.30   |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD   | 292,292   | 253.35    | 74,052,178.20    |
| MRF LTD                      | 469       | 82,400.50 | 38,645,834.50    |
| TATA MOTORS LTD              | 419,109   | 345.50    | 144,802,159.50   |
| PAGE INDUSTRIES LTD          | 1,369     | 30,860.80 | 42,248,435.20    |
| TITAN CO LTD                 | 89,597    | 1,685.10  | 150,979,904.70   |
| JUBILANT FOODWORKS LTD       | 17,171    | 3,146.15  | 54,022,541.65    |
| INFO EDGE INDIA LTD          | 18,889    | 4,661.70  | 88,054,851.30    |
| TRENT LTD                    | 36,111    | 857.50    | 30,965,182.50    |
| AVENUE SUPERMARTS LTD        | 38,140    | 3,188.95  | 121,626,553.00   |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD     | 24,500    | 3,542.60  | 86,793,700.00    |
| ITC LTD                      | 694,531   | 211.45    | 146,858,579.95   |
| NESTLE INDIA LTD             | 7,959     | 17,532.55 | 139,541,565.45   |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD   | 152,648   | 699.95    | 106,845,967.60   |
| UNITED SPIRITS LTD           | 63,364    | 633.35    | 40,131,589.40    |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA)    | 29,776    | 1,710.60  | 50,934,825.60    |
| DABUR INDIA LTD              | 166,828   | 548.50    | 91,505,158.00    |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 89,717    | 849.10    | 76,178,704.70    |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD       | 200,291   | 2,339.30  | 468,540,736.30   |
| MARICO LTD                   | 141,334   | 489.30    | 69,154,726.20    |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE  | 25,912    | 3,315.30  | 85,906,053.60    |
| AUROBINDO PHARMA LTD         | 77,297    | 959.50    | 74,166,471.50    |
| BIOCON LTD                   | 105,275   | 389.05    | 40,957,238.75    |
| CIPLA LTD                    | 124,749   | 939.80    | 117,239,110.20   |
| DIVI'S LABORATORIES LTD      | 31,990    | 4,229.95  | 135,316,100.50   |
| DR. REDDY'S LABORATORIES     | 29,143    | 5,219.20  | 152,103,145.60   |
| IPCA LABORATORIES LTD        | 15,981    | 2,042.35  | 32,638,795.35    |
| LUPIN LTD                    | 61,940    | 1,233.55  | 76,406,087.00    |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS     | 199,821   | 675.35    | 134,949,112.35   |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD  | 11,072    | 2,824.80  | 31,276,185.60    |
| AXIS BANK LTD                | 560,746   | 751.10    | 421,176,320.60   |
| BANDHAN BANK LTD             | 157,300   | 320.00    | 50,336,000.00    |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 418,129   | 2,585.75  | 1,081,177,061.75 |
| ICICI BANK LTD               | 1,249,332 | 648.20    | 809,817,002.40   |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD      | 137,052   | 1,814.90  | 248,735,674.80   |
| STATE BANK OF INDIA          | 435,941   | 432.25    | 188,435,497.25   |
| YES BANK LTD                 | 3,133,500 | 15.05     | 47,159,175.00    |
| BAJAJ FINANCE LTD            | 65,938    | 5,729.75  | 377,808,255.50   |
| BAJAJ FINSERV LTD            | 9,504     | 11,828.55 | 112,418,539.20   |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 93,300    | 580.10    | 54,123,330.00    |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 11,141    | 3,032.70  | 33,787,310.70    |
| MUTHOOT FINANCE LTD          | 23,900    | 1,513.15  | 36,164,285.00    |

|                |                              |            |           |                                       |  |
|----------------|------------------------------|------------|-----------|---------------------------------------|--|
|                | PIRAMAL ENTERPRISES LTD      | 26,950     | 1,960.75  | 52,842,212.50                         |  |
|                | REC LTD                      | 213,247    | 153.60    | 32,754,739.20                         |  |
|                | SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 41,900     | 1,044.30  | 43,756,170.00                         |  |
|                | SHRIRAM TRANSPORT FINANCE    | 48,883     | 1,487.45  | 72,711,018.35                         |  |
|                | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD   | 203,835    | 680.10    | 138,628,183.50                        |  |
|                | ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 54,419     | 1,444.35  | 78,600,082.65                         |  |
|                | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 86,200     | 582.15    | 50,181,330.00                         |  |
|                | SBI LIFE INSURANCE CO LTD    | 113,014    | 988.50    | 111,714,339.00                        |  |
|                | DLF LTD                      | 138,319    | 298.65    | 41,308,969.35                         |  |
|                | HCL TECHNOLOGIES LTD         | 270,381    | 949.60    | 256,753,797.60                        |  |
|                | INFOSYS LTD                  | 832,385    | 1,389.65  | 1,156,723,815.25                      |  |
|                | LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | 13,600     | 3,889.80  | 52,901,280.00                         |  |
|                | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | 225,356    | 3,183.20  | 717,353,219.20                        |  |
|                | TECH MAHINDRA LTD            | 156,694    | 1,034.40  | 162,084,273.60                        |  |
|                | WIPRO LTD                    | 341,227    | 548.25    | 187,077,702.75                        |  |
|                | BHARTI AIRTEL LTD            | 599,870    | 536.45    | 321,800,261.50                        |  |
|                | INDUS TOWERS LTD             | 155,003    | 252.45    | 39,130,507.35                         |  |
|                | ADANI GREEN ENERGY LTD       | 94,700     | 1,264.85  | 119,781,295.00                        |  |
|                | ADANI TOTAL GAS LTD          | 63,300     | 1,626.95  | 102,985,935.00                        |  |
|                | ADANI TRANSMISSION LTD       | 63,200     | 1,589.45  | 100,453,240.00                        |  |
|                | GAIL INDIA LTD               | 421,783    | 168.35    | 71,007,168.05                         |  |
|                | INDRAPRASTHA GAS LTD         | 63,062     | 528.40    | 33,321,960.80                         |  |
|                | NTPC LTD                     | 1,215,434  | 116.40    | 141,476,517.60                        |  |
|                | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 597,071    | 236.25    | 141,058,023.75                        |  |
|                | インドルピー 小計                    | 20,977,143 |           | 15,536,861,447.05<br>(23,460,660,785) |  |
| チェココルナ         | KOMERCNI BANKA AS            | 16,748     | 789.00    | 13,214,172.00                         |  |
|                | MONETA MONEY BANK AS         | 139,823    | 79.00     | 11,046,017.00                         |  |
|                | CEZ AS                       | 38,447     | 636.50    | 24,471,515.50                         |  |
|                | チェココルナ 小計                    | 195,018    |           | 48,731,704.50<br>(255,656,268)        |  |
| クウェートディ<br>ナール | AGILITY                      | 306,283    | 0.93      | 286,987.17                            |  |
|                | BOUBAYAN BANK K.S.C          | 323,041    | 0.67      | 219,021.79                            |  |
|                | KUWAIT FINANCE HOUSE         | 1,183,765  | 0.74      | 884,272.45                            |  |
|                | NATIONAL BANK OF KUWAIT      | 1,694,529  | 0.83      | 1,413,237.18                          |  |
|                | MABANEE CO KPSC              | 117,025    | 0.71      | 83,672.87                             |  |
|                | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 491,210    | 0.59      | 291,778.74                            |  |
|                | クウェートディナール 小計                | 4,115,853  |           | 3,178,970.20<br>(1,159,783,698)       |  |
| コロンビアペソ        | ECOPETROL SA                 | 1,236,668  | 2,355.00  | 2,912,353,140.00                      |  |
|                | BANCOLOMBIA SA               | 56,939     | 27,800.00 | 1,582,904,200.00                      |  |
|                | BANCOLOMBIA SA-PREF          | 117,073    | 28,200.00 | 3,301,458,600.00                      |  |
|                | GRUPO DE INV SURAMERICANA    | 48,828     | 20,050.00 | 979,001,400.00                        |  |

|                |                              |           |           |                                    |  |
|----------------|------------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|--|
|                | INTERCONEXION ELECTRICA SA   | 129,758   | 22,700.00 | 2,945,506,600.00                   |  |
|                | コロンビアベソ 小計                   | 1,589,266 |           | 11,721,223,940.00<br>(355,012,430) |  |
| ハンガリーフォ<br>リント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 119,991   | 2,390.00  | 286,778,490.00                     |  |
|                | RICHTER GEDEON NYRT          | 32,764    | 8,050.00  | 263,750,200.00                     |  |
|                | OTP BANK PLC                 | 56,194    | 16,605.00 | 933,101,370.00                     |  |
|                | ハンガリーフォリント 小計                | 208,949   |           | 1,483,630,060.00<br>(570,234,697)  |  |
| アラブディルハ<br>ム   | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 702,773   | 4.36      | 3,064,090.28                       |  |
|                | ABU DHABI COMMERCIAL BANK    | 756,301   | 7.05      | 5,331,922.05                       |  |
|                | ABU DHABI ISLAMIC BANK       | 533,706   | 5.45      | 2,908,697.70                       |  |
|                | DUBAI ISLAMIC BANK           | 662,318   | 4.97      | 3,291,720.46                       |  |
|                | FIRST ABU DHABI BANK PJSC    | 1,119,282 | 16.90     | 18,915,865.80                      |  |
|                | ALDAR PROPERTIES PJSC        | 1,124,665 | 3.76      | 4,228,740.40                       |  |
|                | EMAAR PROPERTIES PJSC        | 956,316   | 4.11      | 3,930,458.76                       |  |
|                | EMIRATES TELECOM GROUP CO    | 465,196   | 22.00     | 10,234,312.00                      |  |
|                | アラブディルハム 小計                  | 6,320,557 |           | 51,905,807.45<br>(1,549,388,352)   |  |
| ポーランドズロ<br>チ   | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 76,512    | 81.54     | 6,238,788.48                       |  |
|                | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I  | 368,052   | 6.61      | 2,434,295.92                       |  |
|                | KGHM POLSKA MIEDZ SA         | 36,318    | 201.40    | 7,314,445.20                       |  |
|                | LPP SA                       | 246       | 11,110.00 | 2,733,060.00                       |  |
|                | CD PROJEKT SA                | 20,231    | 169.76    | 3,434,414.56                       |  |
|                | CYFROWY POLSAT SA            | 63,798    | 30.70     | 1,958,598.60                       |  |
|                | ALLEGRO.EU SA                | 81,700    | 59.05     | 4,824,385.00                       |  |
|                | DINO POLSKA SA               | 12,811    | 286.10    | 3,665,227.10                       |  |
|                | BANK PEKAO SA                | 48,466    | 98.04     | 4,751,606.64                       |  |
|                | PKO BANK POLSKI SA           | 210,574   | 39.70     | 8,359,787.80                       |  |
|                | SANTANDER BANK POLSKA SA     | 8,248     | 264.40    | 2,180,771.20                       |  |
|                | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 149,572   | 37.65     | 5,631,385.80                       |  |
|                | ORANGE POLSKA SA             | 110,607   | 7.11      | 786,415.77                         |  |
|                | PGE SA                       | 194,020   | 10.75     | 2,085,715.00                       |  |
|                | ポーランドズロチ 小計                  | 1,381,155 |           | 56,398,897.07<br>(1,683,089,725)   |  |
| 南アフリカラン<br>ド   | EXXARO RESOURCES LTD         | 53,022    | 158.52    | 8,405,047.44                       |  |
|                | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 27,534    | 257.40    | 7,087,251.60                       |  |
|                | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD  | 12,668    | 1,705.91  | 21,610,467.88                      |  |
|                | ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 102,261   | 303.97    | 31,084,276.17                      |  |
|                | GOLD FIELDS LTD              | 207,590   | 153.10    | 31,782,029.00                      |  |
|                | HARMONY GOLD MINING CO LTD   | 148,193   | 65.97     | 9,776,292.21                       |  |
|                | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 195,210   | 246.66    | 48,150,498.60                      |  |
|                | KUMBA IRON ORE LTD           | 13,805    | 619.78    | 8,556,062.90                       |  |
|                | NORTHAM PLATINUM LTD         | 91,438    | 222.00    | 20,299,236.00                      |  |

|        |                              |           |          |                                     |  |
|--------|------------------------------|-----------|----------|-------------------------------------|--|
|        | SASOL LTD                    | 132,236   | 233.51   | 30,878,428.36                       |  |
|        | SIBANYE STILLWATER LTD       | 661,317   | 65.70    | 43,448,526.90                       |  |
|        | BIDVEST GROUP LTD            | 67,039    | 194.90   | 13,065,901.10                       |  |
|        | MULTICHOICE GROUP LTD        | 100,361   | 137.50   | 13,799,637.50                       |  |
|        | MR PRICE GROUP LTD           | 66,487    | 223.30   | 14,846,547.10                       |  |
|        | NASPERS LTD-N SHS            | 106,436   | 2,992.74 | 318,535,274.64                      |  |
|        | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 260,375   | 54.36    | 14,153,985.00                       |  |
|        | BID CORP LTD                 | 81,010    | 291.80   | 23,638,718.00                       |  |
|        | CLICKS GROUP LTD             | 64,977    | 260.48   | 16,925,208.96                       |  |
|        | SHOPRITE HOLDINGS LTD        | 121,567   | 157.68   | 19,168,684.56                       |  |
|        | SPAR GROUP LIMITED/THE       | 43,448    | 192.64   | 8,369,822.72                        |  |
|        | TIGER BRANDS LTD             | 38,449    | 219.96   | 8,457,242.04                        |  |
|        | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 102,424   | 162.63   | 16,657,215.12                       |  |
|        | ABSA GROUP LTD               | 176,667   | 143.06   | 25,273,981.02                       |  |
|        | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD    | 18,909    | 1,663.77 | 31,460,226.93                       |  |
|        | NEDBANK GROUP LTD            | 81,532    | 168.41   | 13,730,804.12                       |  |
|        | STANDARD BANK GROUP LTD      | 314,573   | 134.08   | 42,177,947.84                       |  |
|        | FIRSTRAND LTD                | 1,221,929 | 56.00    | 68,428,024.00                       |  |
|        | REINET INVESTMENTS SCA       | 33,819    | 281.63   | 9,524,444.97                        |  |
|        | REMGRO LTD                   | 136,922   | 121.21   | 16,596,315.62                       |  |
|        | DISCOVERY LTD                | 99,383    | 139.63   | 13,876,848.29                       |  |
|        | OLD MUTUAL LTD               | 1,200,484 | 14.08    | 16,902,814.72                       |  |
|        | RAND MERCHANT INVESTMENT HOL | 139,332   | 33.57    | 4,677,375.24                        |  |
|        | SANLAM LTD                   | 469,382   | 61.89    | 29,050,051.98                       |  |
|        | NEPI ROCKCASTLE PLC          | 112,929   | 94.97    | 10,724,867.13                       |  |
|        | MTN GROUP LTD                | 424,312   | 106.17   | 45,049,205.04                       |  |
|        | VODACOM GROUP LTD            | 162,466   | 135.35   | 21,989,773.10                       |  |
|        | 南アフリカランド 小計                  | 7,290,486 |          | 1,078,159,033.80<br>(8,722,306,583) |  |
| オフショア元 | CHINA MERCHANTS ENERGY -A    | 57,700    | 5.12     | 295,424.00                          |  |
|        | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 724,325   | 4.53     | 3,281,192.25                        |  |
|        | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A    | 86,528    | 20.30    | 1,756,518.40                        |  |
|        | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A | 26,000    | 6.07     | 157,820.00                          |  |
|        | OFFSHORE OIL ENGINEERING-A   | 42,000    | 4.47     | 187,740.00                          |  |
|        | PETROCHINA CO LTD-A          | 308,400   | 4.75     | 1,464,900.00                        |  |
|        | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 201,900   | 12.17    | 2,457,123.00                        |  |
|        | SHANXI COKING COAL ENERGY-A  | 38,870    | 7.68     | 298,521.60                          |  |
|        | SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A | 28,400    | 12.56    | 356,704.00                          |  |
|        | SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A | 39,000    | 7.47     | 291,330.00                          |  |
|        | YANTAI JEREH OILFIELD-A      | 9,100     | 41.77    | 380,107.00                          |  |
|        | YANZHOU COAL MINING CO-A     | 21,055    | 14.58    | 306,981.90                          |  |
|        | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 124,400   | 5.17     | 643,148.00                          |  |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A  | 79,700  | 48.55  | 3,869,435.00 |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO-A    | 484,796 | 7.73   | 3,747,473.08 |
| BBMG CORPORATION-A           | 79,100  | 2.74   | 216,734.00   |
| CHIFENG JILONG GOLD MINING-A | 56,700  | 16.93  | 959,931.00   |
| CHINA JUSHI CO LTD -A        | 37,947  | 15.89  | 602,977.83   |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A    | 435,701 | 5.59   | 2,435,568.59 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 34,500  | 22.42  | 773,490.00   |
| GANFENG LITHIUM CO LTD-A     | 24,708  | 127.00 | 3,137,916.00 |
| GEM CO LTD-A                 | 39,400  | 9.83   | 387,302.00   |
| GUANGDONG HONGDA BLASTING -A | 9,000   | 28.80  | 259,200.00   |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 19,890  | 95.93  | 1,908,047.70 |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A  | 96,900  | 27.84  | 2,697,696.00 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO -A   | 35,148  | 13.10  | 460,438.80   |
| HESTEEL CO LTD-A             | 100,800 | 2.45   | 246,960.00   |
| HUAFON CHEMICAL CO LTD -A    | 106,636 | 13.30  | 1,418,258.80 |
| HUAXIN CEMENT CO LTD-A       | 12,900  | 20.76  | 267,804.00   |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A  | 40,200  | 6.67   | 268,134.00   |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A  | 433,400 | 1.62   | 702,108.00   |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 80,316  | 5.90   | 473,864.40   |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 72,300  | 17.02  | 1,230,546.00 |
| JIANGSU SHAGANG CO LTD -A    | 48,700  | 9.58   | 466,546.00   |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A | 2,900   | 113.98 | 330,542.00   |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A      | 19,700  | 24.83  | 489,151.00   |
| KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A   | 59,800  | 21.57  | 1,289,886.00 |
| LOMON BILLIONS GROUP CO -A   | 19,300  | 36.72  | 708,696.00   |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A | 116,800 | 14.01  | 1,636,368.00 |
| PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 81,700  | 2.26   | 184,642.00   |
| RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A | 126,271 | 17.62  | 2,224,895.02 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 34,524  | 20.40  | 704,289.60   |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A   | 20,150  | 33.12  | 667,368.00   |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A  | 113,700 | 3.84   | 436,608.00   |
| SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A | 9,200   | 51.33  | 472,236.00   |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A | 24,600  | 14.35  | 353,010.00   |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 12,040  | 109.29 | 1,315,851.60 |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A   | 54,100  | 6.66   | 360,306.00   |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 11,600  | 94.09  | 1,091,444.00 |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A | 1,000   | 22.59  | 22,590.00    |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A  | 58,100  | 3.74   | 217,294.00   |
| SKSHU PAINT CO LTD-A         | 6,900   | 228.00 | 1,573,200.00 |
| TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A | 12,800  | 13.08  | 167,424.00   |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A       | 17,600  | 22.21  | 390,896.00   |
| TONGLING NONFERROUS METALS-A | 100,100 | 2.83   | 283,283.00   |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A    | 30,906  | 6.99   | 216,032.94    |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A  | 39,800  | 113.71 | 4,525,658.00  |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 4,900   | 70.14  | 343,686.00    |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A     | 13,400  | 21.42  | 287,028.00    |
| YINTAI GOLD CO LTD-A         | 26,460  | 10.77  | 284,974.20    |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A | 15,500  | 174.50 | 2,704,750.00  |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 10,250  | 99.70  | 1,021,925.00  |
| ZHEJIANG JUHUA CO-A          | 26,100  | 10.51  | 274,311.00    |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A | 30,900  | 13.99  | 432,291.00    |
| ZHEJIANG SATELLITE PETROCH-A | 43,260  | 35.68  | 1,543,516.80  |
| ZHONGJIN GOLD CORP-A         | 98,400  | 9.35   | 920,040.00    |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A  | 281,300 | 11.17  | 3,142,121.00  |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL-A   | 10,900  | 21.40  | 233,260.00    |
| AECC AVIATION POWER CO-A     | 36,700  | 52.00  | 1,908,400.00  |
| AVIC AVIATION HIGH-TECHNOL-A | 16,500  | 29.20  | 481,800.00    |
| AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A  | 34,300  | 10.41  | 357,063.00    |
| AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A | 20,600  | 76.00  | 1,565,600.00  |
| AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A | 26,300  | 26.75  | 703,525.00    |
| AVICOPTER PLC-A              | 5,500   | 53.72  | 295,460.00    |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 16,100  | 47.97  | 772,317.00    |
| CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A | 25,900  | 7.28   | 188,552.00    |
| CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A | 13,900  | 15.74  | 218,786.00    |
| CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A | 43,700  | 6.98   | 305,026.00    |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A    | 291,100 | 5.37   | 1,563,207.00  |
| CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A  | 359,104 | 4.12   | 1,479,508.48  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A  | 533,680 | 4.87   | 2,599,021.60  |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 33,008  | 407.50 | 13,450,760.00 |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 26,100  | 10.71  | 279,531.00    |
| EVE ENERGY CO LTD-A          | 35,088  | 99.13  | 3,478,273.44  |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A | 36,143  | 8.21   | 296,734.03    |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A    | 10,800  | 37.98  | 410,184.00    |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A | 7,800   | 192.72 | 1,503,216.00  |
| HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A | 6,400   | 50.25  | 321,600.00    |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A   | 7,100   | 55.23  | 392,133.00    |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 12,432  | 76.35  | 949,183.20    |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A | 29,200  | 10.46  | 305,432.00    |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 169,634 | 3.05   | 517,383.70    |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A     | 75,200  | 29.93  | 2,250,736.00  |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 293,400 | 3.89   | 1,141,326.00  |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 111,916 | 30.16  | 3,375,386.56  |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A | 84,500  | 2.91   | 245,895.00    |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 407,700 | 4.38   | 1,785,726.00  |

|                              |         |        |              |  |
|------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 50,851  | 59.22  | 3,011,396.22 |  |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 20,000  | 82.82  | 1,656,400.00 |  |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A  | 14,700  | 34.50  | 507,150.00   |  |
| SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A | 25,400  | 7.96   | 202,184.00   |  |
| TBEA CO LTD-A                | 35,200  | 11.42  | 401,984.00   |  |
| TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A | 26,700  | 19.73  | 526,791.00   |  |
| WEICHAJ POWER CO LTD-A       | 201,351 | 17.99  | 3,622,304.49 |  |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A   | 74,400  | 6.48   | 482,112.00   |  |
| XIAMEN C & D INC-A           | 26,900  | 8.15   | 219,235.00   |  |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A | 32,800  | 11.75  | 385,400.00   |  |
| YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A | 18,200  | 59.49  | 1,082,718.00 |  |
| YUTONG BUS CO LTD-A          | 21,000  | 13.29  | 279,090.00   |  |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A | 4,620   | 62.75  | 289,905.00   |  |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A | 34,113  | 21.24  | 724,560.12   |  |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A | 15,000  | 23.90  | 358,500.00   |  |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A  | 143,900 | 10.31  | 1,483,609.00 |  |
| BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A | 30,000  | 7.25   | 217,500.00   |  |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 8,800   | 86.59  | 761,992.00   |  |
| AIR CHINA LTD-A              | 142,600 | 8.38   | 1,194,988.00 |  |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A  | 719,300 | 5.64   | 4,056,852.00 |  |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A  | 88,800  | 5.23   | 464,424.00   |  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 205,800 | 6.34   | 1,304,772.00 |  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 204,100 | 21.59  | 4,406,519.00 |  |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A      | 249,689 | 6.81   | 1,700,382.09 |  |
| GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A | 19,688  | 11.52  | 226,805.76   |  |
| S F HOLDING CO LTD-A         | 69,700  | 73.33  | 5,111,101.00 |  |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 9,100   | 48.71  | 443,261.00   |  |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 420,000 | 4.68   | 1,965,600.00 |  |
| SINOTRANS LIMITED-A          | 41,600  | 4.50   | 187,200.00   |  |
| SPRING AIRLINES CO LTD-A     | 8,700   | 63.25  | 550,275.00   |  |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A   | 75,200  | 10.42  | 783,584.00   |  |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A       | 18,460  | 13.85  | 255,671.00   |  |
| BYD CO LTD -A                | 33,900  | 190.35 | 6,452,865.00 |  |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | 2,600   | 207.08 | 538,408.00   |  |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A  | 37,000  | 22.80  | 843,600.00   |  |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A   | 73,700  | 10.98  | 809,226.00   |  |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 46,838  | 53.20  | 2,491,781.60 |  |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A    | 34,900  | 38.19  | 1,332,831.00 |  |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A  | 29,900  | 24.86  | 743,314.00   |  |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A  | 47,400  | 18.20  | 862,680.00   |  |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A  | 12,360  | 17.56  | 217,041.60   |  |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A  | 10,000  | 37.00  | 370,000.00   |  |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| SAIC MOTOR CORP LTD-A        | 97,044  | 20.06  | 1,946,702.64 |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 11,400  | 45.36  | 517,104.00   |
| WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A  | 7,900   | 24.71  | 195,209.00   |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A    | 5,000   | 182.00 | 910,000.00   |
| GUANGDONG XINBAO ELECTRICA-A | 22,500  | 29.89  | 672,525.00   |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A    | 88,929  | 29.12  | 2,589,612.48 |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A  | 9,000   | 45.71  | 411,390.00   |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A | 12,000  | 106.80 | 1,281,600.00 |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A | 12,400  | 84.63  | 1,049,412.00 |
| JOYOUNG CO LTD -A            | 4,600   | 33.86  | 155,756.00   |
| MIDEA GROUP CO LTD-A         | 59,600  | 76.78  | 4,576,088.00 |
| NAVINFO CO LTD-A             | 18,600  | 13.96  | 259,656.00   |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A      | 3,717   | 154.65 | 574,834.05   |
| SHENZHEN MTC CO LTD -A       | 1,000   | 5.61   | 5,610.00     |
| SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A | 8,700   | 26.96  | 234,552.00   |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A  | 128,600 | 7.85   | 1,009,510.00 |
| XIAMEN INTRETECH INC-A       | 2,040   | 43.06  | 87,842.40    |
| ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A  | 17,100  | 11.55  | 197,505.00   |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A     | 5,200   | 69.48  | 361,296.00   |
| OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A | 25,100  | 27.05  | 678,955.00   |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 6,400   | 62.61  | 400,704.00   |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A  | 78,000  | 8.80   | 686,400.00   |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 24,843  | 18.10  | 449,658.30   |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 27,900  | 12.40  | 345,960.00   |
| BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A | 31,200  | 18.28  | 570,336.00   |
| CHINA FILM CO LTD-A          | 14,700  | 12.75  | 187,425.00   |
| CHINA SOUTH PUBLISHING -A    | 17,000  | 9.72   | 165,240.00   |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 280,502 | 10.14  | 2,844,290.28 |
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A  | 700     | 577.55 | 404,285.00   |
| GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A | 12,800  | 14.00  | 179,200.00   |
| LEO GROUP CO LTD-A           | 173,000 | 2.32   | 401,360.00   |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 25,280  | 70.20  | 1,774,656.00 |
| NANJI E-COMMERCE CO LTD-A    | 23,400  | 9.78   | 228,852.00   |
| ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A | 32,600  | 8.81   | 287,206.00   |
| PERFECT WORLD CO LTD-A       | 18,300  | 21.63  | 395,829.00   |
| WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A | 20,000  | 25.49  | 509,800.00   |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A  | 126,520 | 6.88   | 870,457.60   |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A | 27,599  | 317.00 | 8,748,883.00 |
| LIAONING CHENG DA CO LTD-A   | 14,500  | 20.07  | 291,015.00   |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A | 30,800  | 14.21  | 437,668.00   |
| SUNING.COM CO LTD-A          | 326,380 | 6.59   | 2,150,844.20 |
| WANGFUJING GROUP CO LTD-A    | 1,000   | 32.88  | 32,880.00    |

|                              |        |          |               |
|------------------------------|--------|----------|---------------|
| WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A  | 48,200 | 7.49     | 361,018.00    |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 11,404 | 70.44    | 803,297.76    |
| LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A  | 3,780  | 55.17    | 208,542.60    |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 6,552  | 63.27    | 414,545.04    |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A | 91,000 | 5.53     | 503,230.00    |
| ANGEL YEAST CO LTD-A         | 7,800  | 58.90    | 459,420.00    |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 3,600  | 254.80   | 917,280.00    |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 5,625  | 69.94    | 393,412.50    |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 40,300 | 8.07     | 325,221.00    |
| BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A   | 7,000  | 57.64    | 403,480.00    |
| BEIJING YANJING BREWERY CO-A | 26,800 | 8.37     | 224,316.00    |
| CHACHA FOOD CO LTD-A         | 2,000  | 51.35    | 102,700.00    |
| CHONGQING BREWERY CO-A       | 4,600  | 178.00   | 818,800.00    |
| CHONGQING FULING ZHACAI-A    | 7,500  | 39.57    | 296,775.00    |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 52,371 | 136.13   | 7,129,264.23  |
| FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A | 5,900  | 232.07   | 1,369,213.00  |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A  | 9,800  | 25.55    | 250,390.00    |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A    | 25,019 | 77.88    | 1,948,479.72  |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE-A   | 16,900 | 15.08    | 254,852.00    |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 38,400 | 34.77    | 1,335,168.00  |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A  | 82,100 | 37.69    | 3,094,349.00  |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 11,890 | 60.88    | 723,863.20    |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A    | 19,681 | 232.06   | 4,567,172.86  |
| JIANGXI ZHENGBO TECH -A      | 23,200 | 13.13    | 304,616.00    |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A       | 3,600  | 259.91   | 935,676.00    |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 7,600  | 47.28    | 359,328.00    |
| JUEWEI FOOD CO LTD-A         | 5,500  | 83.12    | 457,160.00    |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A     | 17,078 | 2,271.00 | 38,784,138.00 |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A      | 19,500 | 283.22   | 5,522,790.00  |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A    | 65,324 | 64.40    | 4,206,865.60  |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A      | 59,400 | 14.70    | 873,180.00    |
| QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A  | 1,000  | 29.68    | 29,680.00     |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A | 12,605 | 124.39   | 1,567,935.95  |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 12,300 | 498.89   | 6,136,347.00  |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A    | 4,600  | 141.97   | 653,062.00    |
| TOLY BREAD CO LTD-A          | 7,280  | 34.28    | 249,558.40    |
| TONGWEI CO LTD-A             | 71,800 | 35.00    | 2,513,000.00  |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A    | 6,600  | 111.10   | 733,260.00    |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A | 89,540 | 14.24    | 1,275,049.60  |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A     | 55,300 | 312.91   | 17,303,923.00 |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 23,700 | 99.75    | 2,364,075.00  |
| YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A | 12,500 | 16.29    | 203,625.00    |

|                              |        |        |              |  |
|------------------------------|--------|--------|--------------|--|
| BY-HEALTH CO LTD-A           | 15,000 | 37.02  | 555,300.00   |  |
| C&S PAPER CO LTD-A           | 8,799  | 33.91  | 298,374.09   |  |
| PROYA COSMETICS CO LTD-A     | 4,500  | 176.50 | 794,250.00   |  |
| SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A  | 6,400  | 56.60  | 362,240.00   |  |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 53,652 | 83.90  | 4,501,402.80 |  |
| AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A | 3,510  | 80.34  | 281,993.40   |  |
| CHINA NATIONAL MEDICINES-A   | 7,200  | 35.00  | 252,000.00   |  |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 4,400  | 145.25 | 639,100.00   |  |
| GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A | 10,010 | 73.17  | 732,431.70   |  |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A    | 16,640 | 46.67  | 776,588.80   |  |
| INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A | 7,400  | 105.80 | 782,920.00   |  |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A   | 7,600  | 91.54  | 695,704.00   |  |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A  | 9,500  | 32.91  | 312,645.00   |  |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A    | 17,800 | 16.99  | 302,422.00   |  |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A    | 16,960 | 32.50  | 551,200.00   |  |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 35,560 | 11.41  | 405,739.60   |  |
| OVCTEK CHINA INC-A           | 17,260 | 102.45 | 1,768,287.00 |  |
| SHANDONG PHARMACEUTICAL - A  | 1,000  | 38.00  | 38,000.00    |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A   | 18,300 | 22.63  | 414,129.00   |  |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 18,000 | 483.30 | 8,699,400.00 |  |
| TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A | 3,000  | 366.60 | 1,099,800.00 |  |
| WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A  | 20,020 | 15.75  | 315,315.00   |  |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO-A   | 15,000 | 26.83  | 402,450.00   |  |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A | 2,200  | 386.80 | 850,960.00   |  |
| BEIJING Tiantan BIOLOGICAL-A | 11,880 | 32.83  | 390,020.40   |  |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A | 3,800  | 119.65 | 454,670.00   |  |
| BGI GENOMICS CO LTD-A        | 3,800  | 128.56 | 488,528.00   |  |
| CANSINO BIOLOGICS INC-A      | 2,600  | 620.70 | 1,613,820.00 |  |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A  | 5,200  | 424.50 | 2,207,400.00 |  |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 9,300  | 26.55  | 246,915.00   |  |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 21,098 | 188.20 | 3,970,643.60 |  |
| DAAN GENE CO LTD-A           | 19,360 | 23.34  | 451,862.40   |  |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A        | 6,200  | 38.24  | 237,088.00   |  |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A  | 13,400 | 31.20  | 418,080.00   |  |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 7,089  | 186.00 | 1,318,554.00 |  |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 17,290 | 38.85  | 671,716.50   |  |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A | 29,900 | 26.77  | 800,423.00   |  |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A | 80,536 | 82.44  | 6,639,387.84 |  |
| JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A | 11,100 | 15.60  | 173,160.00   |  |
| JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A | 10,700 | 19.86  | 212,502.00   |  |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A | 18,400 | 14.47  | 266,248.00   |  |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A | 5,800  | 50.42  | 292,436.00   |  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| MACCURA BIOTECH CO LTD-A     | 1,000   | 45.20  | 45,200.00     |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A | 7,410   | 42.35  | 313,813.50    |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-A   | 12,500  | 184.90 | 2,311,250.00  |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A | 10,780  | 23.22  | 250,311.60    |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A | 48,600  | 64.70  | 3,144,420.00  |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A | 57,900  | 7.43   | 430,197.00    |
| SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A | 9,900   | 16.61  | 164,439.00    |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 9,641   | 169.30 | 1,632,221.30  |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A    | 8,200   | 35.16  | 288,312.00    |
| SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A  | 11,500  | 29.69  | 341,435.00    |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 13,600  | 21.25  | 289,000.00    |
| TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A | 19,300  | 12.69  | 244,917.00    |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A    | 14,680  | 66.55  | 976,954.00    |
| WUXI APPTec CO LTD-A         | 41,476  | 175.84 | 7,293,139.84  |
| YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A | 11,700  | 19.61  | 229,437.00    |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 18,900  | 121.03 | 2,287,467.00  |
| ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A  | 9,200   | 418.38 | 3,849,096.00  |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A | 13,860  | 21.40  | 296,604.00    |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A        | 24,480  | 31.55  | 772,344.00    |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A | 5,000   | 64.54  | 322,700.00    |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 928,800 | 3.32   | 3,083,616.00  |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A    | 346,600 | 4.93   | 1,708,738.00  |
| BANK OF CHENGDU CO LTD-A     | 34,393  | 13.85  | 476,343.05    |
| BANK OF CHINA LTD-A          | 333,900 | 3.14   | 1,048,446.00  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A  | 506,033 | 4.90   | 2,479,561.70  |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A    | 48,700  | 16.18  | 787,966.00    |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A     | 324,350 | 7.72   | 2,503,982.00  |
| BANK OF NANJING CO LTD -A    | 169,500 | 10.22  | 1,732,290.00  |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A     | 80,011  | 42.60  | 3,408,468.60  |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A    | 220,069 | 8.52   | 1,874,987.88  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A    | 91,200  | 6.78   | 618,336.00    |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A   | 563,010 | 3.85   | 2,167,588.50  |
| CHINA MERCHANTS BANK-A       | 303,899 | 57.00  | 17,322,243.00 |
| CHINA MINSHENG BANKING-A     | 430,928 | 4.68   | 2,016,743.04  |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 241,200 | 4.00   | 964,800.00    |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A | 403,200 | 4.21   | 1,697,472.00  |
| HUAXIA BANK CO LTD-A         | 198,750 | 6.37   | 1,266,037.50  |
| IND & COMM BK OF CHINA-A     | 896,128 | 5.17   | 4,632,981.76  |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A    | 273,374 | 22.28  | 6,090,772.72  |
| JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A | 26,000  | 6.77   | 176,020.00    |
| PING AN BANK CO LTD-A        | 252,461 | 24.30  | 6,134,802.30  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 592,600 | 5.44   | 3,223,744.00  |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A | 30,300  | 4.41   | 133,623.00   |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 480,637 | 10.23  | 4,916,916.51 |
| AVIC CAPITAL CO LTD -A       | 85,300  | 4.00   | 341,200.00   |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 34,125  | 10.93  | 372,986.25   |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 52,500  | 7.59   | 398,475.00   |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 70,200  | 10.79  | 757,458.00   |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 58,000  | 10.39  | 602,620.00   |
| CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A | 32,692  | 60.60  | 1,981,135.20 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 86,900  | 20.09  | 1,745,821.00 |
| CITIC SECURITIES CO-A        | 141,845 | 26.06  | 3,696,480.70 |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A       | 79,800  | 33.10  | 2,641,380.00 |
| DONGXING SECURITIES CO LT-A  | 26,200  | 11.21  | 293,702.00   |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A  | 168,416 | 31.20  | 5,254,579.20 |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A   | 37,200  | 17.43  | 648,396.00   |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 97,100  | 7.13   | 692,323.00   |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A  | 78,300  | 9.73   | 761,859.00   |
| GF SECURITIES CO LTD-A       | 101,100 | 15.75  | 1,592,325.00 |
| GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A | 60,500  | 13.12  | 793,760.00   |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A  | 51,600  | 14.88  | 767,808.00   |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A   | 212,700 | 11.01  | 2,341,827.00 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 109,200 | 17.49  | 1,909,908.00 |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A  | 31,900  | 7.97   | 254,243.00   |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 133,879 | 11.69  | 1,565,045.51 |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 5,130   | 113.41 | 581,793.30   |
| HUAAN SECURITIES CO LTD-A    | 34,400  | 6.22   | 213,968.00   |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A   | 108,940 | 16.63  | 1,811,672.20 |
| HUAXI SECURITIES CO LTD-A    | 24,900  | 9.91   | 246,759.00   |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A   | 63,600  | 9.80   | 623,280.00   |
| NANJING SECURITIES CO LTD-A  | 31,300  | 9.36   | 292,968.00   |
| NORTHEAST SECURITIES CO LT-A | 22,200  | 8.72   | 193,584.00   |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A   | 56,800  | 9.78   | 555,504.00   |
| PACIFIC SECURITIES CO/THE-A  | 64,800  | 3.50   | 226,800.00   |
| SDIC CAPITAL CO LTD-A        | 167,100 | 13.87  | 2,317,677.00 |
| SEALAND SECURITIES CO LTD -A | 40,000  | 4.35   | 174,000.00   |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A   | 26,900  | 7.00   | 188,300.00   |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A  | 339,514 | 4.70   | 1,595,715.80 |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD-A | 28,700  | 13.03  | 373,961.00   |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A  | 28,500  | 8.55   | 243,675.00   |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 53,700  | 5.03   | 270,111.00   |
| TIANFENG SECURITIES CO LTD-A | 115,900 | 4.93   | 571,387.00   |
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A  | 33,200  | 8.57   | 284,524.00   |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 74,000  | 13.08  | 967,920.00   |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A    | 42,700  | 35.40  | 1,511,580.00  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 108,000 | 33.97  | 3,668,760.00  |
| HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A | 47,000  | 3.86   | 181,420.00    |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 31,386  | 49.44  | 1,551,723.84  |
| PICC HOLDING CO-A            | 81,000  | 6.10   | 494,100.00    |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 181,822 | 70.28  | 12,778,450.16 |
| CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A | 37,050  | 5.24   | 194,142.00    |
| CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A | 21,688  | 20.10  | 435,928.80    |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 188,523 | 11.31  | 2,132,195.13  |
| CHINA VANKE CO LTD -A        | 137,656 | 25.94  | 3,570,796.64  |
| FINANCIAL STREET HOLDINGS-A  | 28,300  | 7.20   | 203,760.00    |
| GEMDALE CORP-A               | 42,900  | 10.75  | 461,175.00    |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A | 77,200  | 5.87   | 453,164.00    |
| JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A | 35,200  | 6.60   | 232,320.00    |
| JINKE PROPERTIES GROUP CO -A | 50,700  | 5.62   | 284,934.00    |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 156,300 | 13.10  | 2,047,530.00  |
| RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A  | 41,300  | 6.04   | 249,452.00    |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A     | 21,500  | 46.32  | 995,880.00    |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A  | 45,200  | 21.22  | 959,144.00    |
| SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A   | 14,800  | 19.07  | 282,236.00    |
| XINHU ZHONGBAO CO LTD-A      | 81,700  | 3.14   | 256,538.00    |
| YANGO GROUP CO LTD-A         | 38,500  | 5.34   | 205,590.00    |
| YOUNGOR GROUP CO-A           | 106,400 | 7.49   | 796,936.00    |
| ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A | 35,800  | 2.82   | 100,956.00    |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 51,100  | 11.85  | 605,535.00    |
| BEIJING E-HUALU INFO TECH-A  | 17,160  | 26.66  | 457,485.60    |
| BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 8,400   | 38.00  | 319,200.00    |
| BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A  | 14,700  | 15.30  | 224,910.00    |
| CHINA NATIONAL SOFTWARE -A   | 4,700   | 58.94  | 277,018.00    |
| CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A | 14,100  | 16.46  | 232,086.00    |
| DHC SOFTWARE CO LTD -A       | 29,500  | 7.74   | 228,330.00    |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A   | 10,049  | 88.68  | 891,145.32    |
| IFLYTEK CO LTD - A           | 48,285  | 59.76  | 2,885,511.60  |
| LAKALA PAYMENT CO LTD-A      | 1,000   | 29.41  | 29,410.00     |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A   | 3,200   | 255.05 | 816,160.00    |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 8,000   | 64.79  | 518,320.00    |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 3,300   | 146.00 | 481,800.00    |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A  | 47,115  | 34.41  | 1,621,227.15  |
| ADDSINO CO LTD -A            | 15,000  | 18.47  | 277,050.00    |
| AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A  | 10,000  | 76.06  | 760,600.00    |
| BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A | 17,600  | 42.97  | 756,272.00    |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 452,400 | 6.11   | 2,764,164.00  |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 16,597  | 38.74  | 642,967.78   |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 27,800  | 15.09  | 419,502.00   |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A | 296,998 | 5.67   | 1,683,978.66 |
| FIBERHOME TELECOM TECH CO-A  | 11,100  | 18.68  | 207,348.00   |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 88,700  | 12.49  | 1,107,863.00 |
| GOERTEK INC -A               | 47,300  | 37.47  | 1,772,331.00 |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO -A  | 22,900  | 11.66  | 267,014.00   |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A | 21,800  | 9.96   | 217,128.00   |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 8,400   | 132.00 | 1,108,800.00 |
| HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A | 18,000  | 12.09  | 217,620.00   |
| HUAGONG TECH CO LTD-A        | 33,500  | 21.07  | 705,845.00   |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A | 12,300  | 30.32  | 372,936.00   |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A     | 63,100  | 28.33  | 1,787,623.00 |
| LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A | 24,200  | 7.15   | 173,030.00   |
| LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A | 54,200  | 8.50   | 460,700.00   |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 79,812  | 39.42  | 3,146,189.04 |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 3,420   | 418.80 | 1,432,296.00 |
| NINESTAR CORP-A              | 10,100  | 26.76  | 270,276.00   |
| OFILM GROUP CO LTD-A         | 25,700  | 8.91   | 228,987.00   |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A | 21,600  | 22.97  | 496,152.00   |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A    | 4,480   | 92.55  | 414,624.00   |
| SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A  | 29,600  | 17.88  | 529,248.00   |
| SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A | 9,200   | 29.06  | 267,352.00   |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A  | 15,300  | 18.80  | 287,640.00   |
| TIANJIN712 COMMUNICATION &-A | 9,000   | 37.38  | 336,420.00   |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A    | 19,400  | 14.12  | 273,928.00   |
| UNISPLENDOR CORP LTD-A       | 38,248  | 22.38  | 855,990.24   |
| UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A | 13,800  | 16.32  | 225,216.00   |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 25,000  | 87.56  | 2,189,000.00 |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 21,182  | 26.85  | 568,736.70   |
| WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A  | 20,000  | 8.45   | 169,000.00   |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A | 16,400  | 15.68  | 257,152.00   |
| WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A | 13,440  | 58.95  | 792,288.00   |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 7,050   | 76.63  | 540,241.50   |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A  | 28,500  | 22.42  | 638,970.00   |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A   | 5,700   | 40.67  | 231,819.00   |
| ZTE CORP-A                   | 44,200  | 33.64  | 1,486,888.00 |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 360,064 | 19.74  | 7,107,663.36 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A    | 64,400  | 3.40   | 218,960.00   |
| HUANENG POWER INTL INC-A     | 157,200 | 4.17   | 655,524.00   |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 64,500  | 9.64   | 621,780.00   |
| SHENERGY COMPANY LIMITED-A   | 46,600  | 6.19   | 288,454.00   |

|                |                              |            |        |                                    |  |
|----------------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
|                | SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A | 37,560     | 10.30  | 386,868.00                         |  |
|                | SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A | 41,800     | 11.72  | 489,896.00                         |  |
|                | GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A | 48,300     | 2.91   | 140,553.00                         |  |
|                | GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A | 13,556     | 143.89 | 1,950,572.84                       |  |
|                | HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 16,440     | 72.30  | 1,188,612.00                       |  |
|                | HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 12,500     | 42.77  | 534,625.00                         |  |
|                | INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A  | 10,100     | 89.45  | 903,445.00                         |  |
|                | JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 29,000     | 33.09  | 959,610.00                         |  |
|                | JCET GROUP CO LTD-A          | 47,200     | 36.96  | 1,744,512.00                       |  |
|                | LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 50,434     | 93.80  | 4,730,709.20                       |  |
|                | NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A  | 8,100      | 215.60 | 1,746,360.00                       |  |
|                | SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A | 65,200     | 29.35  | 1,913,620.00                       |  |
|                | SG MICRO CORP-A              | 2,700      | 273.26 | 737,802.00                         |  |
|                | SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A | 7,400      | 133.00 | 984,200.00                         |  |
|                | SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A | 8,600      | 111.26 | 956,836.00                         |  |
|                | TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A | 26,500     | 29.12  | 771,680.00                         |  |
|                | TIANSUI HUATIAN TECHNOLOG-A  | 51,100     | 13.40  | 684,740.00                         |  |
|                | TONGFU MICROELECTRONIC CO-A  | 29,100     | 21.97  | 639,327.00                         |  |
|                | UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 5,700      | 138.19 | 787,683.00                         |  |
|                | WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A  | 10,100     | 285.99 | 2,888,499.00                       |  |
|                | ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 29,700     | 42.67  | 1,267,299.00                       |  |
|                | オフショア元 小計                    | 31,258,949 |        | 611,442,105.46<br>(10,474,981,573) |  |
| サウジアラビア<br>リヤル | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 54,323     | 22.46  | 1,220,094.58                       |  |
|                | SAUDI ARABIAN OIL CO         | 535,928    | 35.45  | 18,998,647.60                      |  |
|                | ADVANCED PETROCHEMICALS CO   | 33,966     | 82.00  | 2,785,212.00                       |  |
|                | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 82,000     | 19.42  | 1,592,440.00                       |  |
|                | NATIONAL PETROCHEMICAL CO    | 25,114     | 48.15  | 1,209,239.10                       |  |
|                | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO      | 48,947     | 115.00 | 5,628,905.00                       |  |
|                | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 109,039    | 28.70  | 3,129,419.30                       |  |
|                | SAUDI ARABIAN MINING CO      | 109,522    | 59.50  | 6,516,559.00                       |  |
|                | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP  | 219,703    | 126.00 | 27,682,578.00                      |  |
|                | SAUDI CEMENT                 | 16,059     | 65.20  | 1,047,046.80                       |  |
|                | SAUDI IND INVESTMENT GROUP   | 49,895     | 36.00  | 1,796,220.00                       |  |
|                | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 175,108    | 17.76  | 3,109,918.08                       |  |
|                | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 69,492     | 71.30  | 4,954,779.60                       |  |
|                | JARIR MARKETING CO           | 12,646     | 210.80 | 2,665,776.80                       |  |
|                | ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS   | 8,000      | 129.00 | 1,032,000.00                       |  |
|                | ALMARAI CO                   | 57,048     | 58.90  | 3,360,127.20                       |  |
|                | SAVOLA                       | 52,366     | 41.40  | 2,167,952.40                       |  |
|                | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 10,808     | 167.60 | 1,811,420.80                       |  |
|                | MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 11,336     | 187.00 | 2,119,832.00                       |  |

|         |                              |           |        |                                   |  |
|---------|------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|--|
|         | AL RAJHI BANK                | 301,916   | 103.40 | 31,218,114.40                     |  |
|         | ALINMA BANK                  | 230,293   | 20.18  | 4,647,312.74                      |  |
|         | ARAB NATIONAL BANK           | 158,868   | 22.50  | 3,574,530.00                      |  |
|         | BANK AL-JAZIRA               | 114,405   | 18.26  | 2,089,035.30                      |  |
|         | BANK ALBILAD                 | 87,410    | 36.95  | 3,229,799.50                      |  |
|         | BANQUE SAUDI FRANSI          | 149,679   | 36.75  | 5,500,703.25                      |  |
|         | RIYAD BANK                   | 323,315   | 26.30  | 8,503,184.50                      |  |
|         | SAUDI BRITISH BANK           | 201,932   | 30.80  | 6,219,505.60                      |  |
|         | THE SAUDI NATIONAL BANK      | 535,655   | 53.80  | 28,818,239.00                     |  |
|         | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE  | 13,218    | 123.40 | 1,631,101.20                      |  |
|         | CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | 14,550    | 84.30  | 1,226,565.00                      |  |
|         | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 180,939   | 10.64  | 1,925,190.96                      |  |
|         | EMAAR ECONOMIC CITY          | 89,567    | 12.00  | 1,074,804.00                      |  |
|         | ETIHAD ETISALAT CO           | 87,547    | 34.05  | 2,980,975.35                      |  |
|         | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 142,448   | 14.84  | 2,113,928.32                      |  |
|         | SAUDI TELECOM CO             | 145,029   | 132.00 | 19,143,828.00                     |  |
|         | SAUDI ELECTRICITY CO         | 207,982   | 24.76  | 5,149,634.32                      |  |
|         | サウジアラビアリアル 小計                | 4,666,053 |        | 221,874,619.70<br>(6,485,395,133) |  |
| トルコリラ   | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 29,380    | 102.90 | 3,023,202.00                      |  |
|         | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 294,834   | 19.11  | 5,634,277.74                      |  |
|         | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI    | 166,850   | 15.46  | 2,579,501.00                      |  |
|         | KOC HOLDING AS               | 155,842   | 19.20  | 2,992,166.40                      |  |
|         | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 272,686   | 8.19   | 2,233,298.34                      |  |
|         | FORD OTOMOTIV SANAYI AS      | 14,221    | 176.80 | 2,514,272.80                      |  |
|         | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS    | 96,899    | 61.95  | 6,002,893.05                      |  |
|         | AKBANK T.A.S.                | 865,040   | 5.38   | 4,653,915.20                      |  |
|         | TURKIYE GARANTI BANKASI      | 654,573   | 8.29   | 5,426,410.17                      |  |
|         | TURKIYE IS BANKASI-C         | 268,383   | 5.28   | 1,417,062.24                      |  |
|         | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS  | 252,686   | 16.31  | 4,121,308.66                      |  |
|         | トルコリラ 小計                     | 3,071,394 |        | 40,598,307.60<br>(515,988,250)    |  |
| ユーロ     | FF GROUP                     | 5,889     | 4.80   | 28,267.20                         |  |
|         | OPAP SA                      | 48,759    | 13.47  | 656,783.73                        |  |
|         | JUMBO SA                     | 33,461    | 15.32  | 512,622.52                        |  |
|         | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 587,000   | 0.79   | 468,895.60                        |  |
|         | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 52,724    | 14.70  | 775,042.80                        |  |
|         | ユーロ 小計                       | 727,833   |        | 2,441,611.85<br>(325,588,940)     |  |
| カタールリアル | QATAR FUEL QSC               | 112,465   | 17.86  | 2,008,624.90                      |  |
|         | QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT) | 488,719   | 3.05   | 1,490,592.95                      |  |
|         | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 1,036,433 | 1.91   | 1,983,732.76                      |  |
|         | INDUSTRIES QATAR             | 364,461   | 12.73  | 4,639,588.53                      |  |

|            |                              |               |       |                                      |  |
|------------|------------------------------|---------------|-------|--------------------------------------|--|
|            | COMMERCIAL BANK PSQC         | 434,616       | 5.29  | 2,303,030.18                         |  |
|            | MASRAF AL RAYAN              | 789,908       | 4.42  | 3,496,132.80                         |  |
|            | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC  | 191,996       | 9.57  | 1,837,401.72                         |  |
|            | QATAR ISLAMIC BANK           | 298,908       | 17.25 | 5,156,163.00                         |  |
|            | QATAR NATIONAL BANK          | 1,103,409     | 17.70 | 19,530,339.30                        |  |
|            | BARWA REAL ESTATE CO         | 648,638       | 3.18  | 2,067,857.94                         |  |
|            | QOOREDOO QPSC                | 167,287       | 6.96  | 1,164,317.52                         |  |
|            | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 112,139       | 16.49 | 1,849,172.11                         |  |
| カタールリアル 小計 |                              | 5,748,979     |       | 47,526,953.71<br>(1,415,827,951)     |  |
| 合 計        |                              | 1,506,539,085 |       | 230,794,438,956<br>(230,794,438,956) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨         | 種 類     | 銘 柄                         | 券面総額      | 評価額                            | 備考 |
|------------|---------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----|
| タイバーツ      | 新株予約権証券 | MINOR INTL PCL-CW23         | 25,190.00 | 124,438.60                     |    |
|            |         | MINOR INTL PCL-CW24         | 22,828.00 | 87,659.52                      |    |
| タイバーツ合計    |         |                             | 48,018.00 | 212,098.12<br>(744,464)        |    |
| メキシコペソ     | 投資証券    | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 842,200   | 19,833,810.00                  |    |
| メキシコペソ合計   |         |                             | 842,200   | 19,833,810.00<br>(109,433,046) |    |
| 南アフリカランド   | 投資証券    | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD  | 798,950   | 11,616,733.00                  |    |
| 南アフリカランド合計 |         |                             | 798,950   | 11,616,733.00<br>(93,979,369)  |    |
| 合計         |         |                             |           | 204,156,879<br>(204,156,879)   |    |

(注1)投資証券の券面総額は口数です。

(注2)新株予約権証券の券面総額は証券数です。

(注3)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注4)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類     | 銘柄数     | 組入株式<br>時価比率 | 組入新株予約権<br>証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|--------|---------|--------------|-----------------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル | 株式 78銘柄 | 100.00%      | —                     | —              | 14.37%                  |

|                |             |       |         |       |       |        |
|----------------|-------------|-------|---------|-------|-------|--------|
| イギリスポンド        | 株式          | 1銘柄   | 100.00% | —     | —     | 0.10%  |
| 香港ドル           | 株式          | 213銘柄 | 100.00% | —     | —     | 21.59% |
| マレーシアリング<br>ット | 株式          | 36銘柄  | 100.00% | —     | —     | 1.30%  |
| タイバーツ          | 株式          | 43銘柄  | 99.98%  | —     | —     | 1.66%  |
|                | 新株予約権<br>証券 | 2銘柄   | —       | 0.02% | —     | 0.00%  |
| フィリピンペソ        | 株式          | 17銘柄  | 100.00% | —     | —     | 0.62%  |
| インドネシアルピア      | 株式          | 22銘柄  | 100.00% | —     | —     | 1.22%  |
| メキシコペソ         | 株式          | 22銘柄  | 97.37%  | —     | —     | 1.75%  |
|                | 投資証券        | 1銘柄   | —       | —     | 2.63% | 0.05%  |
| ブラジルリアル        | 株式          | 54銘柄  | 100.00% | —     | —     | 5.31%  |
| チリペソ           | 株式          | 13銘柄  | 100.00% | —     | —     | 0.42%  |
| 韓国ウォン          | 株式          | 103銘柄 | 100.00% | —     | —     | 13.13% |
| ニュー台湾ドル        | 株式          | 87銘柄  | 100.00% | —     | —     | 13.76% |
| インドルピー         | 株式          | 101銘柄 | 100.00% | —     | —     | 10.16% |
| チェココルナ         | 株式          | 3銘柄   | 100.00% | —     | —     | 0.11%  |
| クウェートディナ<br>ール | 株式          | 6銘柄   | 100.00% | —     | —     | 0.50%  |
| コロンビアペソ        | 株式          | 5銘柄   | 100.00% | —     | —     | 0.15%  |
| ハンガリーフォリ<br>ント | 株式          | 3銘柄   | 100.00% | —     | —     | 0.25%  |
| アラブディルハム       | 株式          | 8銘柄   | 100.00% | —     | —     | 0.67%  |
| ポーランドズロチ       | 株式          | 14銘柄  | 100.00% | —     | —     | 0.73%  |
| 南アフリカランド       | 株式          | 36銘柄  | 98.93%  | —     | —     | 3.78%  |
|                | 投資証券        | 1銘柄   | —       | —     | 1.07% | 0.04%  |
| オフショア元         | 株式          | 454銘柄 | 100.00% | —     | —     | 4.53%  |
| サウジアラビアリ<br>ヤル | 株式          | 36銘柄  | 100.00% | —     | —     | 2.81%  |
| トルコリラ          | 株式          | 11銘柄  | 100.00% | —     | —     | 0.22%  |
| ユーロ            | 株式          | 5銘柄   | 100.00% | —     | —     | 0.14%  |
| カタールリアル        | 株式          | 12銘柄  | 100.00% | —     | —     | 0.61%  |

## 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

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

日本株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 3年 6月 8日現在 ]

|             |                |
|-------------|----------------|
| 資産の部        |                |
| 流動資産        |                |
| コール・ローン     | 155,602,674    |
| 株式          | 11,991,664,120 |
| 投資証券        | 185,369,400    |
| 派生商品評価勘定    | 1,798,350      |
| 未収配当金       | 58,695,660     |
| 差入委託証拠金     | 5,670,000      |
| 流動資産合計      | 12,398,800,204 |
| 資産合計        | 12,398,800,204 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 派生商品評価勘定    | 502,200        |
| 前受金         | 915,000        |
| 未払金         | 194,803,016    |
| 未払解約金       | 7,784,491      |
| 未払利息        | 113            |
| 流動負債合計      | 204,004,820    |
| 負債合計        | 204,004,820    |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 9,383,667,198  |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 2,811,128,186  |
| 元本等合計       | 12,194,795,384 |
| 純資産合計       | 12,194,795,384 |
| 負債純資産合計     | 12,398,800,204 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                                                                      |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。<br>投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。                                                                                      |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[ 令和 3年 6月 8日現在 ]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

|       |                   |
|-------|-------------------|
|       | [ 令和 3年 6月 8日現在 ] |
| 1. 期首 | 令和 2年12月 9日       |
| 期首元本額 | 4,298,465,453円    |

|                              | [令和 3年 6月 8日現在] |
|------------------------------|-----------------|
| 期中追加設定元本額                    | 5,097,668,608円  |
| 期中一部解約元本額                    | 12,466,863円     |
| 元本の内訳                        |                 |
| MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信    | 347,226,392円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー） | 9,032,621,438円  |
| つみたて全世界株式                    | 3,819,368円      |
| 合計                           | 9,383,667,198円  |
| 2. 受益権の総数                    | 9,383,667,198口  |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

### 1 金融商品の状況に関する事項

| 区分                      | 自 令和 2年12月 9日<br>至 令和 3年 6月 8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」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算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> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                           |

### 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | [ 令和 3年 6月 8日現在 ]                                              |
|---------------------|----------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                         |
| 2.時価の算定方法           | <p>（１）有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（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> |

| 区分                        | [ 令和 3年 6月 8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 ) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、( 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 ) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</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> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [ 令和 3年 6月 8日現在 ]  |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 299,244,434        |
| 投資証券 | 7,389,106          |
| 合計   | 306,633,540        |

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

[ 令和 3年 6月 8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<br>買建 | 136,285,000 | —     | 137,585,000 | 1,300,000 |
|      | 合計             | 136,285,000 | —     | 137,585,000 | 1,300,000 |

## （注）時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値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、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 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。

## （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。

（１口当たり情報）

|              | [ 令和 3年 6月 8日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.2996円           |
| (1万口当たり純資産額) | (12,996円)         |

## 附属明細表

### 第１ 有価証券明細表

#### (1) 株式

（単位：円）

|      | 銘 柄              | 株式数    | 評価額       |            | 備考 |
|------|------------------|--------|-----------|------------|----|
|      |                  |        | 単価        | 金額         |    |
| 1605 | I N P E X        | 28,400 | 801.00    | 22,748,400 |    |
| 1801 | 大成建設             | 5,300  | 3,780.00  | 20,034,000 |    |
| 1802 | 大林組              | 18,000 | 926.00    | 16,668,000 |    |
| 1803 | 清水建設             | 15,300 | 937.00    | 14,336,100 |    |
| 1812 | 鹿島建設             | 12,500 | 1,488.00  | 18,600,000 |    |
| 1878 | 大東建託             | 1,800  | 12,000.00 | 21,600,000 |    |
| 1925 | 大和ハウス工業          | 15,700 | 3,357.00  | 52,704,900 |    |
| 1928 | 積水ハウス            | 17,100 | 2,260.00  | 38,646,000 |    |
| 2002 | 日清製粉グループ本社       | 5,500  | 1,664.00  | 9,152,000  |    |
| 2267 | ヤクルト本社           | 3,600  | 6,080.00  | 21,888,000 |    |
| 2269 | 明治ホールディングス       | 3,400  | 6,730.00  | 22,882,000 |    |
| 2282 | 日本ハム             | 2,300  | 4,525.00  | 10,407,500 |    |
| 2502 | アサヒグループホールディングス  | 12,700 | 5,442.00  | 69,113,400 |    |
| 2503 | 麒麟ホールディングス       | 22,800 | 2,284.00  | 52,075,200 |    |
| 2587 | サントリー食品インターナショナル | 3,900  | 4,330.00  | 16,887,000 |    |
| 2593 | 伊藤園              | 1,500  | 6,400.00  | 9,600,000  |    |
| 2801 | キッコーマン           | 4,000  | 7,090.00  | 28,360,000 |    |
| 2802 | 味の素              | 12,900 | 2,638.00  | 34,030,200 |    |
| 2875 | 東洋水産             | 2,500  | 4,355.00  | 10,887,500 |    |
| 2897 | 日清食品ホールディングス     | 1,800  | 7,810.00  | 14,058,000 |    |
| 2914 | 日本たばこ産業          | 33,300 | 2,191.50  | 72,976,950 |    |
| 3402 | 東レ               | 38,500 | 764.50    | 29,433,250 |    |
| 3861 | 王子ホールディングス       | 22,500 | 653.00    | 14,692,500 |    |
| 3407 | 旭化成              | 34,800 | 1,275.00  | 44,370,000 |    |
| 4005 | 住友化学             | 41,300 | 615.00    | 25,399,500 |    |
| 4021 | 日産化学             | 3,400  | 5,750.00  | 19,550,000 |    |

|      |                    |        |           |             |  |
|------|--------------------|--------|-----------|-------------|--|
| 4042 | 東ソー                | 7,200  | 1,980.00  | 14,256,000  |  |
| 4063 | 信越化学工業             | 9,800  | 19,005.00 | 186,249,000 |  |
| 4091 | 日本酸素ホールディングス       | 4,200  | 2,135.00  | 8,967,000   |  |
| 4182 | 三菱瓦斯化学             | 4,400  | 2,516.00  | 11,070,400  |  |
| 4183 | 三井化学               | 5,100  | 3,855.00  | 19,660,500  |  |
| 4185 | J S R              | 5,600  | 3,185.00  | 17,836,000  |  |
| 4188 | 三菱ケミカルホールディングス     | 35,500 | 905.00    | 32,127,500  |  |
| 4204 | 積水化学工業             | 10,600 | 1,896.00  | 20,097,600  |  |
| 4452 | 花王                 | 13,400 | 6,713.00  | 89,954,200  |  |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス     | 19,700 | 1,563.00  | 30,791,100  |  |
| 4613 | 関西ペイント             | 4,900  | 2,912.00  | 14,268,800  |  |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス     | 10,000 | 7,689.00  | 76,890,000  |  |
| 4911 | 資生堂                | 11,100 | 7,934.00  | 88,067,400  |  |
| 4912 | ライオン               | 6,200  | 1,918.00  | 11,891,600  |  |
| 4922 | コーセー               | 900    | 17,860.00 | 16,074,000  |  |
| 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス   | 2,500  | 2,969.00  | 7,422,500   |  |
| 4967 | 小林製薬               | 1,500  | 9,330.00  | 13,995,000  |  |
| 6988 | 日東電工               | 4,200  | 8,500.00  | 35,700,000  |  |
| 8113 | ユニ・チャーム            | 11,200 | 4,386.00  | 49,123,200  |  |
| 4151 | 協和キリン              | 7,500  | 3,640.00  | 27,300,000  |  |
| 4502 | 武田薬品工業             | 43,700 | 3,702.00  | 161,777,400 |  |
| 4503 | アステラス製薬            | 51,600 | 1,905.00  | 98,298,000  |  |
| 4506 | 大日本住友製薬            | 5,000  | 2,272.00  | 11,360,000  |  |
| 4507 | 塩野義製薬              | 7,300  | 5,595.00  | 40,843,500  |  |
| 4516 | 日本新薬               | 1,400  | 8,320.00  | 11,648,000  |  |
| 4519 | 中外製薬               | 18,600 | 4,225.00  | 78,585,000  |  |
| 4523 | エーザイ               | 6,500  | 9,251.00  | 60,131,500  |  |
| 4528 | 小野薬品工業             | 10,300 | 2,444.50  | 25,178,350  |  |
| 4530 | 久光製薬               | 1,400  | 5,780.00  | 8,092,000   |  |
| 4536 | 参天製薬               | 10,000 | 1,496.00  | 14,960,000  |  |
| 4568 | 第一三共               | 47,200 | 2,483.00  | 117,197,600 |  |
| 4578 | 大塚ホールディングス         | 10,800 | 4,653.00  | 50,252,400  |  |
| 4581 | 大正製薬ホールディングス       | 900    | 6,220.00  | 5,598,000   |  |
| 4587 | ベプチドリーム            | 2,700  | 5,030.00  | 13,581,000  |  |
| 5019 | 出光興産               | 5,800  | 2,693.00  | 15,619,400  |  |
| 5020 | E N E O Sホールディングス  | 85,100 | 473.30    | 40,277,830  |  |
| 5108 | ブリヂストン             | 15,800 | 4,941.00  | 78,067,800  |  |
| 5201 | A G C              | 5,400  | 4,840.00  | 26,136,000  |  |
| 5332 | T O T O            | 3,900  | 5,850.00  | 22,815,000  |  |
| 5333 | 日本碍子               | 7,200  | 2,051.00  | 14,767,200  |  |
| 5401 | 日本製鉄               | 23,700 | 1,936.50  | 45,895,050  |  |
| 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 13,600 | 1,340.00  | 18,224,000  |  |
| 5486 | 日立金属               | 5,900  | 2,120.00  | 12,508,000  |  |

|      |                   |        |           |             |  |
|------|-------------------|--------|-----------|-------------|--|
| 5713 | 住友金属鉱山            | 6,900  | 4,665.00  | 32,188,500  |  |
| 5802 | 住友電気工業            | 20,900 | 1,741.50  | 36,397,350  |  |
| 3436 | S U M C O         | 7,700  | 2,569.00  | 19,781,300  |  |
| 5938 | L I X I L         | 7,400  | 2,882.00  | 21,326,800  |  |
| 5947 | リンナイ              | 1,000  | 10,440.00 | 10,440,000  |  |
| 6005 | 三浦工業              | 2,400  | 5,090.00  | 12,216,000  |  |
| 6146 | ディスコ              | 800    | 33,200.00 | 26,560,000  |  |
| 6268 | ナブテスコ             | 3,100  | 4,990.00  | 15,469,000  |  |
| 6273 | S M C             | 1,600  | 65,380.00 | 104,608,000 |  |
| 6301 | 小松製作所             | 24,300 | 3,143.00  | 76,374,900  |  |
| 6305 | 日立建機              | 3,000  | 3,565.00  | 10,695,000  |  |
| 6324 | ハーモニック・ドライブ・システムズ | 1,200  | 5,760.00  | 6,912,000   |  |
| 6326 | クボタ               | 28,500 | 2,416.00  | 68,856,000  |  |
| 6367 | ダイキン工業            | 6,900  | 20,520.00 | 141,588,000 |  |
| 6370 | 栗田工業              | 2,700  | 5,140.00  | 13,878,000  |  |
| 6383 | ダイフク              | 2,800  | 9,270.00  | 25,956,000  |  |
| 6465 | ホシザキ              | 1,500  | 10,340.00 | 15,510,000  |  |
| 6471 | 日本精工              | 10,700 | 1,048.00  | 11,213,600  |  |
| 6481 | T H K             | 3,300  | 3,530.00  | 11,649,000  |  |
| 6586 | マキタ               | 6,200  | 5,070.00  | 31,434,000  |  |
| 7011 | 三菱重工業             | 8,900  | 3,490.00  | 31,061,000  |  |
| 4062 | イビデン              | 2,900  | 5,530.00  | 16,037,000  |  |
| 6448 | ブラザー工業            | 6,500  | 2,336.00  | 15,184,000  |  |
| 6479 | ミネベアミツミ           | 10,100 | 2,968.00  | 29,976,800  |  |
| 6501 | 日立製作所             | 26,900 | 6,088.00  | 163,767,200 |  |
| 6502 | 東芝                | 11,400 | 4,745.00  | 54,093,000  |  |
| 6503 | 三菱電機              | 50,600 | 1,800.00  | 91,080,000  |  |
| 6504 | 富士電機              | 3,500  | 5,280.00  | 18,480,000  |  |
| 6506 | 安川電機              | 6,700  | 5,210.00  | 34,907,000  |  |
| 6594 | 日本電産              | 12,400 | 12,515.00 | 155,186,000 |  |
| 6645 | オムロン              | 5,100  | 8,530.00  | 43,503,000  |  |
| 6701 | 日本電気              | 6,800  | 5,110.00  | 34,748,000  |  |
| 6702 | 富士通               | 5,500  | 18,640.00 | 102,520,000 |  |
| 6723 | ルネサスエレクトロニクス      | 24,000 | 1,204.00  | 28,896,000  |  |
| 6724 | セイコーエプソン          | 7,800  | 2,025.00  | 15,795,000  |  |
| 6752 | パナソニック            | 61,300 | 1,267.00  | 77,667,100  |  |
| 6753 | シャープ              | 5,900  | 2,001.00  | 11,805,900  |  |
| 6758 | ソニーグループ           | 35,000 | 10,995.00 | 384,825,000 |  |
| 6762 | T D K             | 3,600  | 14,130.00 | 50,868,000  |  |
| 6806 | ヒロセ電機             | 900    | 16,500.00 | 14,850,000  |  |
| 6841 | 横河電機              | 6,300  | 1,746.00  | 10,999,800  |  |
| 6845 | アズビル              | 3,400  | 4,260.00  | 14,484,000  |  |
| 6857 | アドバンテスト           | 5,500  | 10,050.00 | 55,275,000  |  |

|      |                 |        |           |             |  |
|------|-----------------|--------|-----------|-------------|--|
| 6861 | キーエンス           | 5,400  | 54,390.00 | 293,706,000 |  |
| 6869 | シスメックス          | 4,600  | 11,840.00 | 54,464,000  |  |
| 6920 | レーザーテック         | 2,100  | 20,710.00 | 43,491,000  |  |
| 6923 | スタンレー電気         | 3,600  | 3,295.00  | 11,862,000  |  |
| 6952 | カシオ計算機          | 5,400  | 1,939.00  | 10,470,600  |  |
| 6954 | ファナック           | 5,300  | 25,545.00 | 135,388,500 |  |
| 6963 | ローム             | 2,400  | 10,090.00 | 24,216,000  |  |
| 6965 | 浜松ホトニクス         | 3,900  | 6,700.00  | 26,130,000  |  |
| 6971 | 京セラ             | 8,900  | 6,817.00  | 60,671,300  |  |
| 6981 | 村田製作所           | 15,900 | 8,450.00  | 134,355,000 |  |
| 7276 | 小糸製作所           | 2,900  | 7,240.00  | 20,996,000  |  |
| 7751 | キヤノン            | 27,700 | 2,607.50  | 72,227,750  |  |
| 7752 | リコー             | 18,600 | 1,415.00  | 26,319,000  |  |
| 8035 | 東京エレクトロン        | 4,100  | 48,270.00 | 197,907,000 |  |
| 6201 | 豊田自動織機          | 4,100  | 9,820.00  | 40,262,000  |  |
| 6902 | デンソー            | 12,000 | 7,898.00  | 94,776,000  |  |
| 7201 | 日産自動車           | 64,400 | 558.50    | 35,967,400  |  |
| 7202 | いすゞ自動車          | 15,300 | 1,559.00  | 23,852,700  |  |
| 7203 | トヨタ自動車          | 58,800 | 9,856.00  | 579,532,800 |  |
| 7205 | 日野自動車           | 8,000  | 1,038.00  | 8,304,000   |  |
| 7259 | アイシン            | 4,100  | 4,890.00  | 20,049,000  |  |
| 7261 | マツダ             | 15,800 | 1,025.00  | 16,195,000  |  |
| 7267 | 本田技研工業          | 45,200 | 3,592.00  | 162,358,400 |  |
| 7269 | スズキ             | 10,200 | 4,820.00  | 49,164,000  |  |
| 7270 | S U B A R U     | 17,100 | 2,230.50  | 38,141,550  |  |
| 7272 | ヤマハ発動機          | 7,800  | 3,355.00  | 26,169,000  |  |
| 7309 | シマノ             | 2,100  | 24,650.00 | 51,765,000  |  |
| 4543 | テルモ             | 17,900 | 4,261.00  | 76,271,900  |  |
| 7701 | 島津製作所           | 6,600  | 4,055.00  | 26,763,000  |  |
| 7733 | オリンパス           | 32,300 | 2,404.00  | 77,649,200  |  |
| 7741 | H O Y A         | 10,300 | 13,880.00 | 142,964,000 |  |
| 7747 | 朝日インテック         | 5,800  | 2,649.00  | 15,364,200  |  |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス | 5,500  | 7,921.00  | 43,565,500  |  |
| 7911 | 凸版印刷            | 7,300  | 1,954.00  | 14,264,200  |  |
| 7912 | 大日本印刷           | 6,300  | 2,477.00  | 15,605,100  |  |
| 7951 | ヤマハ             | 3,700  | 6,510.00  | 24,087,000  |  |
| 7956 | ピジョン            | 3,200  | 3,340.00  | 10,688,000  |  |
| 7974 | 任天堂             | 3,100  | 68,540.00 | 212,474,000 |  |
| 9501 | 東京電力ホールディングス    | 42,400 | 344.00    | 14,585,600  |  |
| 9502 | 中部電力            | 17,900 | 1,342.50  | 24,030,750  |  |
| 9503 | 関西電力            | 19,500 | 1,092.50  | 21,303,750  |  |
| 9506 | 東北電力            | 11,900 | 888.00    | 10,567,200  |  |
| 9531 | 東京瓦斯            | 10,400 | 2,135.50  | 22,209,200  |  |

|      |                      |        |           |             |  |
|------|----------------------|--------|-----------|-------------|--|
| 9532 | 大阪瓦斯                 | 10,400 | 2,066.00  | 21,486,400  |  |
| 9533 | 東邦瓦斯                 | 2,100  | 5,640.00  | 11,844,000  |  |
| 9001 | 東武鉄道                 | 5,200  | 2,980.00  | 15,496,000  |  |
| 9005 | 東急                   | 13,900 | 1,591.00  | 22,114,900  |  |
| 9007 | 小田急電鉄                | 8,200  | 2,929.00  | 24,017,800  |  |
| 9008 | 京王電鉄                 | 2,900  | 6,970.00  | 20,213,000  |  |
| 9009 | 京成電鉄                 | 3,600  | 3,690.00  | 13,284,000  |  |
| 9020 | 東日本旅客鉄道              | 8,400  | 8,412.00  | 70,660,800  |  |
| 9021 | 西日本旅客鉄道              | 4,500  | 6,881.00  | 30,964,500  |  |
| 9022 | 東海旅客鉄道               | 4,000  | 17,925.00 | 71,700,000  |  |
| 9041 | 近鉄グループホールディングス       | 4,800  | 4,155.00  | 19,944,000  |  |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス         | 6,300  | 3,615.00  | 22,774,500  |  |
| 9062 | 日本通運                 | 2,100  | 9,140.00  | 19,194,000  |  |
| 9064 | ヤマトホールディングス          | 8,100  | 2,969.00  | 24,048,900  |  |
| 9143 | S Gホールディングス          | 8,900  | 2,581.00  | 22,970,900  |  |
| 9101 | 日本郵船                 | 4,500  | 5,090.00  | 22,905,000  |  |
| 9201 | 日本航空                 | 4,000  | 2,644.00  | 10,576,000  |  |
| 9202 | A N Aホールディングス        | 4,400  | 2,807.00  | 12,350,800  |  |
| 3626 | T I S                | 6,200  | 2,777.00  | 17,217,400  |  |
| 3635 | コーエーテクモホールディングス      | 1,600  | 5,210.00  | 8,336,000   |  |
| 3659 | ネクソン                 | 13,500 | 2,494.00  | 33,669,000  |  |
| 3769 | G M Oペイメントゲートウェイ     | 1,100  | 12,880.00 | 14,168,000  |  |
| 4307 | 野村総合研究所              | 9,800  | 3,400.00  | 33,320,000  |  |
| 4385 | メルカリ                 | 2,800  | 5,220.00  | 14,616,000  |  |
| 4684 | オービック                | 1,900  | 20,310.00 | 38,589,000  |  |
| 4689 | Zホールディングス            | 73,600 | 514.40    | 37,859,840  |  |
| 4704 | トレンドマイクロ             | 3,700  | 5,630.00  | 20,831,000  |  |
| 4716 | 日本オラクル               | 1,100  | 9,970.00  | 10,967,000  |  |
| 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ       | 2,700  | 3,385.00  | 9,139,500   |  |
| 4768 | 大塚商会                 | 3,200  | 5,910.00  | 18,912,000  |  |
| 9432 | 日本電信電話               | 35,700 | 2,912.50  | 103,976,250 |  |
| 9433 | K D D I              | 44,700 | 3,711.00  | 165,881,700 |  |
| 9434 | ソフトバンク               | 79,700 | 1,420.50  | 113,213,850 |  |
| 9435 | 光通信                  | 600    | 21,360.00 | 12,816,000  |  |
| 9602 | 東宝                   | 3,100  | 4,600.00  | 14,260,000  |  |
| 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ         | 17,500 | 1,736.00  | 30,380,000  |  |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 2,400  | 5,760.00  | 13,824,000  |  |
| 9697 | カプコン                 | 4,900  | 3,385.00  | 16,586,500  |  |
| 9719 | S C S K              | 1,400  | 6,310.00  | 8,834,000   |  |
| 9766 | コナミホールディングス          | 2,600  | 7,360.00  | 19,136,000  |  |
| 9984 | ソフトバンクグループ           | 34,800 | 8,019.00  | 279,061,200 |  |
| 3038 | 神戸物産                 | 3,800  | 2,867.00  | 10,894,600  |  |
| 7459 | メディパルホールディングス        | 5,100  | 2,169.00  | 11,061,900  |  |

|      |                          |         |           |             |  |
|------|--------------------------|---------|-----------|-------------|--|
| 8001 | 伊藤忠商事                    | 33,000  | 3,366.00  | 111,078,000 |  |
| 8002 | 丸紅                       | 43,400  | 1,002.50  | 43,508,500  |  |
| 8015 | 豊田通商                     | 5,900   | 5,070.00  | 29,913,000  |  |
| 8031 | 三井物産                     | 42,900  | 2,535.50  | 108,772,950 |  |
| 8053 | 住友商事                     | 31,200  | 1,531.50  | 47,782,800  |  |
| 8058 | 三菱商事                     | 35,000  | 3,070.00  | 107,450,000 |  |
| 9962 | ミスミグループ本社                | 7,900   | 3,570.00  | 28,203,000  |  |
| 2651 | ローソン                     | 1,400   | 5,100.00  | 7,140,000   |  |
| 2670 | エービーシー・マート               | 900     | 6,610.00  | 5,949,000   |  |
| 2702 | 日本マクドナルドホールディングス         | 2,200   | 5,010.00  | 11,022,000  |  |
| 3064 | M o n o t a R O          | 7,000   | 2,532.00  | 17,724,000  |  |
| 3092 | Z O Z O                  | 3,500   | 3,885.00  | 13,597,500  |  |
| 3141 | ウエルシアホールディングス            | 2,600   | 3,460.00  | 8,996,000   |  |
| 3349 | コスモス薬品                   | 600     | 15,530.00 | 9,318,000   |  |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス          | 20,900  | 4,960.00  | 103,664,000 |  |
| 3391 | ツルハホールディングス              | 1,100   | 13,720.00 | 15,092,000  |  |
| 7453 | 良品計画                     | 7,000   | 2,110.00  | 14,770,000  |  |
| 7532 | パン・パシフィック・インターナショナルホ     | 11,400  | 2,272.00  | 25,900,800  |  |
| 8267 | イオン                      | 18,100  | 2,992.00  | 54,155,200  |  |
| 9831 | ヤマダホールディングス              | 18,800  | 526.00    | 9,888,800   |  |
| 9843 | ニトリホールディングス              | 2,200   | 18,630.00 | 40,986,000  |  |
| 9983 | ファーストリテイリング              | 1,600   | 83,260.00 | 133,216,000 |  |
| 7182 | ゆうちょ銀行                   | 11,200  | 938.00    | 10,505,600  |  |
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ      | 30,200  | 417.00    | 12,593,400  |  |
| 8306 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ        | 339,100 | 634.20    | 215,057,220 |  |
| 8308 | りそなホールディングス              | 59,200  | 462.40    | 27,374,080  |  |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス        | 9,400   | 3,744.00  | 35,193,600  |  |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ          | 36,200  | 4,015.00  | 145,343,000 |  |
| 8331 | 千葉銀行                     | 14,700  | 701.00    | 10,304,700  |  |
| 8355 | 静岡銀行                     | 12,400  | 893.00    | 11,073,200  |  |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ           | 66,900  | 1,690.00  | 113,061,000 |  |
| 8473 | S B Iホールディングス            | 6,800   | 2,770.00  | 18,836,000  |  |
| 8601 | 大和証券グループ本社               | 40,100  | 647.70    | 25,972,770  |  |
| 8604 | 野村ホールディングス               | 85,200  | 601.70    | 51,264,840  |  |
| 7181 | かんぽ生命保険                  | 6,200   | 2,200.00  | 13,640,000  |  |
| 8630 | S O M P Oホールディングス        | 8,800   | 4,379.00  | 38,535,200  |  |
| 8725 | M S & A Dインシュアランスグループホール | 12,300  | 3,453.00  | 42,471,900  |  |
| 8750 | 第一生命ホールディングス             | 28,300  | 2,240.50  | 63,406,150  |  |
| 8766 | 東京海上ホールディングス             | 17,500  | 5,209.00  | 91,157,500  |  |
| 8795 | T & Dホールディングス            | 14,900  | 1,498.00  | 22,320,200  |  |
| 8439 | 東京センチュリー                 | 1,000   | 6,360.00  | 6,360,000   |  |
| 8572 | アコム                      | 9,800   | 510.00    | 4,998,000   |  |

|      |                |           |           |                |  |
|------|----------------|-----------|-----------|----------------|--|
| 8591 | オリックス          | 33,900    | 1,992.50  | 67,545,750     |  |
| 8593 | 三菱ＨＣキャピタル      | 18,300    | 630.00    | 11,529,000     |  |
| 8697 | 日本取引所グループ      | 14,100    | 2,554.50  | 36,018,450     |  |
| 3003 | ヒューリック         | 7,500     | 1,291.00  | 9,682,500      |  |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス  | 3,200     | 2,942.00  | 9,414,400      |  |
| 3291 | 飯田グループホールディングス | 4,100     | 3,055.00  | 12,525,500     |  |
| 8801 | 三井不動産          | 25,400    | 2,702.00  | 68,630,800     |  |
| 8802 | 三菱地所           | 32,800    | 1,851.50  | 60,729,200     |  |
| 8830 | 住友不動産          | 8,600     | 3,840.00  | 33,024,000     |  |
| 2127 | 日本Ｍ＆Ａセンター      | 8,400     | 2,653.00  | 22,285,200     |  |
| 2181 | パーソルホールディングス   | 4,900     | 2,198.00  | 10,770,200     |  |
| 2331 | 総合警備保障         | 2,000     | 5,150.00  | 10,300,000     |  |
| 2371 | カカクコム          | 3,700     | 3,460.00  | 12,802,000     |  |
| 2413 | エムスリー          | 12,200    | 7,201.00  | 87,852,200     |  |
| 2433 | 博報堂ＤＹホールディングス  | 6,500     | 1,860.00  | 12,090,000     |  |
| 4324 | 電通グループ         | 6,000     | 3,890.00  | 23,340,000     |  |
| 4661 | オリエンタルランド      | 5,500     | 16,720.00 | 91,960,000     |  |
| 4732 | ユー・エス・エス       | 6,100     | 1,869.00  | 11,400,900     |  |
| 4751 | サイバーエージェント     | 11,200    | 2,156.00  | 24,147,200     |  |
| 4755 | 楽天グループ         | 24,000    | 1,318.00  | 31,632,000     |  |
| 6098 | リクルートホールディングス  | 37,600    | 5,761.00  | 216,613,600    |  |
| 6178 | 日本郵政           | 43,700    | 920.70    | 40,234,590     |  |
| 9735 | セコム            | 5,800     | 8,723.00  | 50,593,400     |  |
| 合 計  |                | 3,855,900 |           | 11,991,664,120 |  |

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種 類  | 銘 柄               | 口数  | 評価額         | 備考 |
|------|-------------------|-----|-------------|----|
| 投資証券 | G L P 投資法人        | 114 | 21,511,800  |    |
|      | 日本プロロジスリート投資法人    | 57  | 20,064,000  |    |
|      | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 118 | 21,818,200  |    |
|      | 日本ビルファンド投資法人      | 41  | 29,233,000  |    |
|      | ジャパンリアルエステイト投資法人  | 35  | 23,835,000  |    |
|      | 日本都市ファンド投資法人      | 194 | 22,154,800  |    |
|      | オリックス不動産投資法人      | 73  | 15,461,400  |    |
|      | ユナイテッド・アーバン投資法人   | 82  | 13,251,200  |    |
|      | 大和ハウスリート投資法人      | 55  | 18,040,000  |    |
| 合計   |                   | 769 | 185,369,400 |    |

## 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

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## ２【ファンドの現況】

### 【ＭＡＸＩＳ全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

#### 【純資産額計算書】

令和 ３年 ６月30日現在

（単位：円）

|                 |               |
|-----------------|---------------|
| 資産総額            | 8,400,072,301 |
| 負債総額            | 44,180,839    |
| 純資産総額（ - ）      | 8,355,891,462 |
| 発行済口数           | 640,000口      |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 13,056        |

（参考）

### 外国株式インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

令和 ３年 ６月30日現在

（単位：円）

|                 |                   |
|-----------------|-------------------|
| 資産総額            | 1,079,430,137,922 |
| 負債総額            | 2,724,337,429     |
| 純資産総額（ - ）      | 1,076,705,800,493 |
| 発行済口数           | 258,025,391,355口  |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 4.1729            |
| （10,000口当たり）    | （41,729）          |

### 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

令和 ３年 ６月30日現在

（単位：円）

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 255,056,547,100 |
| 負債総額            | 7,348,776,593   |
| 純資産総額（ - ）      | 247,707,770,507 |
| 発行済口数           | 73,381,049,557口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 3.3756          |
| （10,000口当たり）    | （33,756）        |

## 日本株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 13,220,133,611  |
| 負債総額            | 70,070,994      |
| 純資産総額（ - ）      | 13,150,062,617  |
| 発行済口数           | 10,191,977,979口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.2902          |
| （10,000口当たり）    | （12,902）        |

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第１【委託会社等の概況】

##### １【委託会社等の概況】

< 更新後 >

##### （１）資本金の額等

2021年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

##### （２）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

###### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

###### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

###### 投資行動のモニタリング１

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

###### 投資行動のモニタリング２

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

###### ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

### < 更新後 >

「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）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2021年 6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本 数<br>( 本 ) | 純資産総額<br>( 百万円 ) |
|------------|--------------|------------------|
| 追加型株式投資信託  | 897          | 17,600,344       |
| 追加型公社債投資信託 | 16           | 1,436,394        |
| 単位型株式投資信託  | 79           | 355,163          |
| 単位型公社債投資信託 | 45           | 187,593          |
| 合 計        | 1,037        | 19,579,494       |

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

## 3【委託会社等の経理状況】

### < 更新後 >

#### ( 1 ) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱ＵＦＪ国際投信株式会社（以下「当社」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。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「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）」に基づき作成しております。

なお、財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### ( 2 ) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

|        | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| (資産の部) |                       |                       |

|                 |   |            |   |             |
|-----------------|---|------------|---|-------------|
| <b>流動資産</b>     |   |            |   |             |
| 現金及び預金          | 2 | 56,398,457 | 2 | 56,803,388  |
| 有価証券            |   | 1,960,318  |   | 2,001       |
| 前払費用            |   | 575,904    |   | 598,135     |
| 未収入金            |   | 14,559     |   | 31,359      |
| 未収委託者報酬         |   | 10,296,453 |   | 13,216,357  |
| 未収収益            | 2 | 638,994    | 2 | 662,230     |
| 金銭の信託           |   | 100,000    |   | 2,300,000   |
| その他             |   | 254,330    |   | 269,506     |
| 流動資産合計          |   | 70,239,017 |   | 73,882,978  |
| <b>固定資産</b>     |   |            |   |             |
| <b>有形固定資産</b>   |   |            |   |             |
| 建物              | 1 | 584,048    | 1 | 548,902     |
| 器具備品            | 1 | 871,893    | 1 | 1,435,369   |
| 土地              |   | 628,433    |   | 628,433     |
| 有形固定資産合計        |   | 2,084,375  |   | 2,612,705   |
| <b>無形固定資産</b>   |   |            |   |             |
| 電話加入権           |   | 15,822     |   | 15,822      |
| ソフトウェア          |   | 3,369,611  |   | 3,569,171   |
| ソフトウェア仮勘定       |   | 1,374,932  |   | 1,895,190   |
| 無形固定資産合計        |   | 4,760,365  |   | 5,480,184   |
| <b>投資その他の資産</b> |   |            |   |             |
| 投資有価証券          |   | 16,704,756 |   | 18,616,670  |
| 関係会社株式          |   | 320,136    |   | 320,136     |
| 投資不動産           | 1 | 819,255    | 1 | 814,684     |
| 長期差入保証金         |   | 565,358    |   | 538,497     |
| 前払年金費用          |   | 375,031    |   | 258,835     |
| 繰延税金資産          |   | 1,912,824  |   | 916,962     |
| その他             |   | 45,230     |   | 45,230      |
| 貸倒引当金           |   | 23,600     |   | 23,600      |
| 投資その他の資産合計      |   | 20,718,993 |   | 21,487,417  |
| 固定資産合計          |   | 27,563,734 |   | 29,580,307  |
| 資産合計            |   | 97,802,752 |   | 103,463,286 |

(単位：千円)

|         | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |           | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |           |
|---------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
| (負債の部)  |                       |           |                       |           |
| 流動負債    |                       |           |                       |           |
| 預り金     |                       | 687,565   |                       | 533,622   |
| 未払金     |                       |           |                       |           |
| 未払収益分配金 |                       | 131,478   |                       | 158,856   |
| 未払償還金   |                       | 395,400   |                       | 133,877   |
| 未払手数料   | 2                     | 4,026,078 | 2                     | 5,200,810 |
| その他未払金  | 2                     | 3,818,195 | 2                     | 4,412,521 |
| 未払費用    | 2                     | 4,402,578 | 2                     | 4,755,909 |
| 未払消費税等  |                       | 629,469   |                       | 752,617   |
| 未払法人税等  |                       | 617,341   |                       | 873,027   |
| 賞与引当金   |                       | 933,517   |                       | 933,381   |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 役員賞与引当金   | 124,590    | 160,710    |
| その他       | 701,285    | 691,143    |
| 流動負債合計    | 16,467,499 | 18,606,476 |
| 固定負債      |            |            |
| 長期未払金     | 32,400     | 21,600     |
| 退職給付引当金   | 1,010,401  | 1,145,514  |
| 役員退職慰労引当金 | 130,784    | 117,938    |
| 時効後支払損引当金 | 238,811    | 245,426    |
| 固定負債合計    | 1,412,398  | 1,530,479  |
| 負債合計      | 17,879,897 | 20,136,956 |
| (純資産の部)   |            |            |
| 株主資本      |            |            |
| 資本金       | 2,000,131  | 2,000,131  |
| 資本剰余金     |            |            |
| 資本準備金     | 3,572,096  | 3,572,096  |
| その他資本剰余金  | 41,160,616 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計   | 44,732,712 | 44,732,712 |
| 利益剰余金     |            |            |
| 利益準備金     | 342,589    | 342,589    |
| その他利益剰余金  |            |            |
| 別途積立金     | 6,998,000  | 6,998,000  |
| 繰越利益剰余金   | 25,847,605 | 26,951,289 |
| 利益剰余金合計   | 33,188,194 | 34,291,879 |
| 株主資本合計    | 79,921,039 | 81,024,723 |

(単位：千円)

|              | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 評価・換算差額等     |                       |                       |
| その他有価証券評価差額金 | 1,815                 | 2,301,606             |
| 評価・換算差額等合計   | 1,815                 | 2,301,606             |
| 純資産合計        | 79,922,854            | 83,326,329            |
| 負債純資産合計      | 97,802,752            | 103,463,286           |

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

|         | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |
|---------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 営業収益    |                                      |                                     |
| 委託者報酬   | 67,967,489                           | 67,963,712                          |
| 投資顧問料   | 2,385,084                            | 2,443,980                           |
| その他営業収益 | 16,085                               | 21,613                              |
| 営業収益合計  | 70,368,658                           | 70,429,306                          |
| 営業費用    |                                      |                                     |
| 支払手数料   | 2 27,106,451                         | 2 26,689,896                        |

|             |            |            |
|-------------|------------|------------|
| 広告宣伝費       | 696,418    | 668,150    |
| 公告費         | 1,000      | 250        |
| 調査費         |            |            |
| 調査費         | 1,857,271  | 2,077,942  |
| 委託調査費       | 11,579,175 | 12,035,954 |
| 事務委託費       | 847,769    | 798,528    |
| 営業雑経費       |            |            |
| 通信費         | 153,731    | 296,490    |
| 印刷費         | 427,118    | 378,180    |
| 協会費         | 52,053     | 51,841     |
| 諸会費         | 15,990     | 16,613     |
| 事務機器関連費     | 1,953,926  | 1,977,769  |
| その他営業雑経費    | -          | 8,391      |
| 営業費用合計      | 44,690,907 | 45,000,009 |
| 一般管理費       |            |            |
| 給料          |            |            |
| 役員報酬        | 331,987    | 352,879    |
| 給料・手当       | 6,611,427  | 6,461,546  |
| 賞与引当金繰入     | 933,517    | 933,381    |
| 役員賞与引当金繰入   | 124,590    | 160,710    |
| 福利厚生費       | 1,276,950  | 1,272,568  |
| 交際費         | 11,871     | 2,721      |
| 旅費交通費       | 165,891    | 22,768     |
| 租税公課        | 360,165    | 402,939    |
| 不動産賃借料      | 647,402    | 666,331    |
| 退職給付費用      | 422,919    | 481,135    |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 48,183     | 11,763     |
| 固定資産減価償却費   | 1,307,555  | 1,358,911  |
| 諸経費         | 427,212    | 413,538    |
| 一般管理費合計     | 12,669,674 | 12,541,193 |
| 営業利益        | 13,008,076 | 12,888,103 |

(単位：千円)

|             | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |
|-------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 営業外収益       |                                      |                                     |
| 受取配当金       | 90,965                               | 170,807                             |
| 受取利息        | 2 4,169                              | 2 2,726                             |
| 投資有価証券償還益   | 585,179                              | 81,557                              |
| 収益分配金等時効完成分 | 101,734                              | 275,835                             |
| 受取賃貸料       | 2 65,808                             | 2 65,808                            |
| その他         | 19,987                               | 12,504                              |
| 営業外収益合計     | 867,845                              | 609,239                             |
| 営業外費用       |                                      |                                     |
| 投資有価証券償還損   | 96,379                               | 95,946                              |
| 時効後支払損引当金繰入 | -                                    | 16,395                              |
| 事務過誤費       | 3,483                                | -                                   |
| 賃貸関連費用      | 20,339                               | 13,472                              |
| その他         | 1,920                                | 2,932                               |
| 営業外費用合計     | 122,122                              | 128,747                             |

|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 経常利益         |   | 13,753,799 |   | 13,368,595 |
| 特別利益         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却益    |   | 174,842    |   | 2,007,655  |
| 特別利益合計       |   | 174,842    |   | 2,007,655  |
| 特別損失         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却損    |   | 75,963     |   | 51,737     |
| 投資有価証券評価損    |   | 163,865    |   | 26,317     |
| 固定資産除却損      | 1 | 8,832      | 1 | 536        |
| 固定資産売却損      |   | 435        |   | -          |
| 特別損失合計       |   | 249,096    |   | 78,591     |
| 税引前当期純利益     |   | 13,679,545 |   | 15,297,659 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2 | 4,146,534  | 2 | 4,755,427  |
| 法人税等調整額      |   | 79,824     |   | 19,122     |
| 法人税等合計       |   | 4,226,359  |   | 4,736,304  |
| 当期純利益        |   | 9,453,186  |   | 10,561,354 |

## （３）【株主資本等変動計算書】

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

（単位：千円）

|                             | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |             |            |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|                             | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益<br>準備金 | 利益剰余金     |             |             | 株主資本合計     |
|                             |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |           | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                             |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |             |            |
| 当期首残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 26,069,594  | 33,410,184  | 80,143,028 |
| 当期変動額                       |           |           |              |             |           |           |             |             |            |
| 剰余金の配当                      |           |           |              |             |           |           | 9,675,175   | 9,675,175   | 9,675,175  |
| 当期純利益                       |           |           |              |             |           |           | 9,453,186   | 9,453,186   | 9,453,186  |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) |           |           |              |             |           |           |             |             |            |
| 当期変動額合計                     | —         | —         | —            | —           | —         | —         | 221,989     | 221,989     | 221,989    |
| 当期末残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 25,847,605  | 33,188,194  | 79,921,039 |

|                             | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計      |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高                       | 1,126,733            | 1,126,733      | 81,269,762 |
| 当期変動額                       |                      |                |            |
| 剰余金の配当                      |                      |                | 9,675,175  |
| 当期純利益                       |                      |                | 9,453,186  |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) | 1,124,917            | 1,124,917      | 1,124,917  |
| 当期変動額合計                     | 1,124,917            | 1,124,917      | 1,346,907  |
| 当期末残高                       | 1,815                | 1,815          | 79,922,854 |

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

（単位：千円）

|       | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |             |            |
|-------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|       | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益<br>準備金 | 利益剰余金     |             |             | 株主資本合計     |
|       |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |           | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|       |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |             |            |
| 当期首残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 25,847,605  | 33,188,194  | 79,921,039 |

|                             |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
|-----------------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
| 当期変動額                       |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 剰余金の配当                      |           |           |            |            |         |           | 9,457,670  | 9,457,670  | 9,457,670  |
| 当期純利益                       |           |           |            |            |         |           | 10,561,354 | 10,561,354 | 10,561,354 |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 当期変動額合計                     | —         | —         | —          | —          | —       | —         | 1,103,684  | 1,103,684  | 1,103,684  |
| 当期末残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 26,951,289 | 34,291,879 | 81,024,723 |

|                             | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計      |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高                       | 1,815                | 1,815          | 79,922,854 |
| 当期変動額                       |                      |                |            |
| 剰余金の配当                      |                      |                | 9,457,670  |
| 当期純利益                       |                      |                | 10,561,354 |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) | 2,299,791            | 2,299,791      | 2,299,791  |
| 当期変動額合計                     | 2,299,791            | 2,299,791      | 3,403,475  |
| 当期末残高                       | 2,301,606            | 2,301,606      | 83,326,329 |

#### [注記事項]

##### (重要な会計方針)

##### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

###### (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

###### (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(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)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

##### 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

##### 3. 固定資産の減価償却の方法

###### (1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

|       |        |
|-------|--------|
| 建物    | 5年～50年 |
| 器具備品  | 2年～20年 |
| 投資不動産 | 3年～47年 |

###### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

##### 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

##### 5. 引当金の計上基準

###### (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

## (2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4)退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

## (5)役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

## (6)時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

## 6. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

## (1)消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

## (2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (3)「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」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「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」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

## （未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

## (1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

## (2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

|       | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 建物    | 599,542千円             | 643,920千円             |
| 器具備品  | 1,408,613千円           | 1,545,179千円           |
| 投資不動産 | 145,391千円             | 151,833千円             |

2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|        | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 預金     | 314,247千円             | 40,328,414千円          |
| 未収収益   | 15,773千円              | 14,138千円              |
| 未払手数料  | 712,210千円             | 772,495千円             |
| その他未払金 | 3,029,426千円           | 3,425,136千円           |
| 未払費用   | 432,019千円             | 349,222千円             |

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

|      | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |
|------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 器具備品 | 8,832千円                              | 536千円                               |

|   |         |       |
|---|---------|-------|
| 計 | 8,832千円 | 536千円 |
|---|---------|-------|

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|              | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |
|--------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 支払手数料        | 5,234,629千円                          | 5,128,270千円                         |
| 受取利息         | 2千円                                  | 143千円                               |
| 受取賃貸料        | 65,808千円                             | 65,808千円                            |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,030,180千円                          | 3,492,898千円                         |

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数 (株) | 当事業年度増加<br>株式数 (株) | 当事業年度減少<br>株式数 (株) | 当事業年度末<br>株式数 (株) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| 発行済株式 |                    |                    |                    |                   |
| 普通株式  | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |
| 合計    | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |

### 2. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 9,675,175千円 |
| 1株当たり配当額 | 45,728円     |
| 基準日      | 平成31年3月31日  |
| 効力発生日    | 令和元年6月27日   |

#### (2) 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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 9,457,670千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金       |
| 1株当たり配当額 | 44,700円     |
| 基準日      | 令和2年3月31日   |
| 効力発生日    | 令和2年6月29日   |

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数 (株) | 当事業年度増加<br>株式数 (株) | 当事業年度減少<br>株式数 (株) | 当事業年度末<br>株式数 (株) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| 発行済株式 |                    |                    |                    |                   |
| 普通株式  | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |
| 合計    | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |

### 2. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 9,457,670千円 |
| 1株当たり配当額 | 44,700円     |
| 基準日      | 令和2年3月31日   |
| 効力発生日    | 令和2年6月29日   |

#### (2) 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

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 10,576,511千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金        |
| 1株当たり配当額 | 49,988円      |
| 基準日      | 令和3年3月31日    |
| 効力発生日    | 令和3年6月29日    |

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

|     | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 1年内 | 675,956千円             | 709,808千円             |
| 1年超 | —                     | 709,808千円             |
| 合計  | 675,956千円             | 1,419,616千円           |

（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

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

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、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第35期(令和2年3月31日現在)

|             | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|-------------|------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 56,398,457       | 56,398,457 | -      |
| (2) 有価証券    | 1,960,318        | 1,960,318  | -      |
| (3) 金銭の信託   | 100,000          | 100,000    | -      |
| (4) 未収委託者報酬 | 10,296,453       | 10,296,453 | -      |
| (5) 投資有価証券  | 16,673,396       | 16,673,396 | -      |
| 資産計         | 85,428,625       | 85,428,625 | -      |
| (1) 未払手数料   | 4,026,078        | 4,026,078  | -      |
| 負債計         | 4,026,078        | 4,026,078  | -      |

第36期(令和3年3月31日現在)

|             | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|-------------|------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 56,803,388       | 56,803,388 | -      |
| (2) 有価証券    | 2,001            | 2,001      | -      |
| (3) 金銭の信託   | 2,300,000        | 2,300,000  | -      |
| (4) 未収委託者報酬 | 13,216,357       | 13,216,357 | -      |
| (5) 投資有価証券  | 18,585,310       | 18,585,310 | -      |
| 資産計         | 90,907,057       | 90,907,057 | -      |

|           |           |           |   |
|-----------|-----------|-----------|---|
| (1) 未払手数料 | 5,200,810 | 5,200,810 | - |
| 負債計       | 5,200,810 | 5,200,810 | - |

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1)現金及び預金、(4)未収委託者報酬

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。

## (2)有価証券、(5)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

## (3)金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

負 債

## (1)未払手数料

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。

## (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

(単位：千円)

| 区分     | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式  | 31,360                | 31,360                |
| 子会社株式  | 160,600               | 160,600               |
| 関連会社株式 | 159,536               | 159,536               |

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (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

第35期(令和2年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 56,398,457 | -           | -            | -      |
| 金銭の信託             | 100,000    | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 10,296,453 | -           | -            | -      |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |        |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |        |
| 投資信託              | 1,960,318  | 5,652,257   | 4,813,929    | 27,375 |
| 合計                | 68,755,228 | 5,652,257   | 4,813,929    | 27,375 |

第36期(令和3年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 56,803,388 | -           | -            | -      |
| 金銭の信託             | 2,300,000  | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 13,216,357 | -           | -            | -      |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |        |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |        |
| 投資信託              | 2,001      | 8,412,286   | 3,123,026    | 11,398 |
| 合計                | 72,321,747 | 8,412,286   | 3,123,026    | 11,398 |

## （有価証券関係）

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第35期(令和2年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 9,859,345        | 8,694,010    | 1,165,334 |
|                      | 小計  | 9,859,345        | 8,694,010    | 1,165,334 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 8,874,369        | 10,037,087   | 1,162,718 |
|                      | 小計  | 8,874,369        | 10,037,087   | 1,162,718 |
| 合計                   |     | 18,733,714       | 18,731,098   | 2,616     |

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は100,000千円）を含めておりません。

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、含めておりません。

第36期(令和3年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 14,810,957       | 11,362,471   | 3,448,485 |
|                      | 小計  | 14,810,957       | 11,362,471   | 3,448,485 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 6,076,354        | 6,207,447    | 131,093   |
|                      | 小計  | 6,076,354        | 6,207,447    | 131,093   |
| 合計                   |     | 20,887,311       | 17,569,919   | 3,317,392 |

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は2,300,000千円）を含めておりません。

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、含めておりません。

## 3. 売却したその他有価証券

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

| 種類  | 売却額(千円)   | 売却益の合計額(千円) | 売却損の合計額(千円) |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式  | 8,940     | -           | 15,060      |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 2,035,469 | 174,842     | 60,903      |
| 合計  | 2,044,409 | 174,842     | 75,963      |

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

| 種類 | 売却額(千円) | 売却益の合計額(千円) | 売却損の合計額(千円) |
|----|---------|-------------|-------------|
| 株式 | -       | -           | -           |

|     |           |           |        |
|-----|-----------|-----------|--------|
| 債券  | -         | -         | -      |
| その他 | 5,747,529 | 2,007,655 | 51,737 |
| 合計  | 5,747,529 | 2,007,655 | 51,737 |

#### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について26,317千円（その他有価証券のその他26,317千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

#### （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、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

##### 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

|                  | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |
|------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高      | 3,712,289 千円                         | 3,718,736 千円                        |
| 勤務費用             | 204,225                              | 203,106                             |
| 利息費用             | 17,557                               | 19,110                              |
| 数理計算上の差異の<br>発生額 | 52,430                               | 18,826                              |
| 退職給付の支払額         | 162,904                              | 192,890                             |
| 過去勤務費用の発生額       | -                                    | -                                   |
| 退職給付債務の期末残高      | 3,718,736                            | 3,729,235                           |

###### (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|                  | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |
|------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 年金資産の期首残高        | 2,666,937 千円                         | 2,460,824 千円                        |
| 期待運用収益           | 47,757                               | 44,130                              |
| 数理計算上の差異の<br>発生額 | 164,633                              | 304,281                             |
| 事業主からの拠出額        | 51,282                               | -                                   |
| 退職給付の支払額         | 140,518                              | 159,390                             |
| 年金資産の期末残高        | 2,460,824                            | 2,649,846                           |

###### (3) 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及び前払年金費用の調整表

|                  | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| 積立型制度の<br>退職給付債務 | 2,969,807 千円          | 2,810,893 千円          |
| 年金資産             | 2,460,824             | 2,649,846             |
|                  | 508,982               | 161,046               |
| 非積立型制度の退職給付債務    | 748,929               | 918,342               |
| 未積立退職給付債務        | 1,257,911             | 1,079,388             |
| 未認識数理計算上の差異      | 203,136               | 161,333               |

|                     |           |           |
|---------------------|-----------|-----------|
| 未認識過去勤務費用           | 419,405   | 354,043   |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 635,370   | 886,678   |
| 退職給付引当金             | 1,010,401 | 1,145,514 |
| 前払年金費用              | 375,031   | 258,835   |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 635,370   | 886,678   |

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                 | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |
|-----------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 勤務費用            | 204,225 千円                           | 203,106 千円                          |
| 利息費用            | 17,557                               | 19,110                              |
| 期待運用収益          | 47,757                               | 44,130                              |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 24,035                               | 41,361                              |
| 過去勤務費用の費用処理額    | 65,361                               | 65,361                              |
| その他             | 6,427                                | 44,446                              |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 269,848                              | 329,255                             |

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額、再就職支援金及び退職金です。

## (5)年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|     | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 債券  | 64.7 %                | 62.7 %                |
| 株式  | 32.3                  | 35.4                  |
| その他 | 3.0                   | 1.9                   |
| 合計  | 100                   | 100                   |

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

|           | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 割引率       | 0.095～0.52%           | 0.051～0.59%           |
| 長期期待運用収益率 | 1.5～1.8%              | 1.5～1.8%              |

## 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153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

## (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

|        | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産 |                       |                       |
| 減損損失   | 427,046千円             | 418,394千円             |

|               |           |           |
|---------------|-----------|-----------|
| 投資有価証券評価損     | 226,322   | 188,859   |
| 未払事業税         | 117,461   | 180,263   |
| 賞与引当金         | 285,842   | 285,801   |
| 役員賞与引当金       | 19,703    | 25,472    |
| 役員退職慰労引当金     | 40,046    | 36,112    |
| 退職給付引当金       | 309,384   | 350,756   |
| 減価償却超過額       | 96,767    | 68,024    |
| 委託者報酬         | 213,044   | 209,938   |
| 長期差入保証金       | 40,180    | 48,639    |
| 時効後支払損引当金     | 73,124    | 75,149    |
| 連結納税適用による時価評価 | 57,656    | 38,873    |
| その他           | 123,248   | 87,023    |
| 繰延税金資産 小計     | 2,029,829 | 2,013,308 |
| 評価性引当額        | -         | -         |
| 繰延税金資産 合計     | 2,029,829 | 2,013,308 |
| 繰延税金負債        |           |           |
| 前払年金費用        | 114,834   | 79,225    |
| 連結納税適用による時価評価 | 1,260     | 1,203     |
| その他有価証券評価差額金  | 801       | 1,015,785 |
| その他           | 109       | 101       |
| 繰延税金負債 合計     | 117,005   | 1,096,346 |
| 繰延税金資産の純額     | 1,912,824 | 916,962   |

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  
第35期（令和2年3月31日現在）及び第36期（令和3年3月31日現在）

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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客へ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

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用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。

[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]

当社は、資産運用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。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用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。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                       | 所在地             | 資本金              | 事業の内容       | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注4)    | 科目     | 期末残高<br>(注4)    |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | 連結納税                                          | 連結納税に<br>伴う支払<br>(注1)                 | 3,030,180<br>千円 | その他未払金 | 3,029,426<br>千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株)             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 5,234,629<br>千円 | 未払手数料  | 712,210<br>千円   |
|     |                              |                 |                  |             |                        | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 583,270<br>千円   | 未払費用   | 302,681<br>千円   |

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                       | 所在地             | 資本金              | 事業の内容       | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注4)    | 科目     | 期末残高<br>(注4)    |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | 連結納税                                          | 連結納税に<br>伴う支払<br>(注1)                 | 3,492,898<br>千円 | その他未払金 | 3,425,136<br>千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株)             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 5,128,270<br>千円 | 未払手数料  | 772,495<br>千円   |
|     |                              |                 |                  |             |                        | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 523,327<br>千円   | 未払費用   | 290,120<br>千円   |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

| 種類          | 会社等の名称             | 所在地     | 資本金              | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                             | 取引の内容                 | 取引金額<br>(注3)     | 科目     | 期末残高<br>(注3)     |
|-------------|--------------------|---------|------------------|-------|------------------------|-------------------------------------------|-----------------------|------------------|--------|------------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | ㈱三菱UFJ銀行           | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業   | なし                     | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等<br><br>取引銀行 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1） | 4,073,855<br>千円  | 未払手数料  | 697,109<br>千円    |
|             |                    |         |                  |       |                        |                                           | コーラブル預金の払戻（注2）        | 20,000,000<br>千円 |        |                  |
|             |                    |         |                  |       |                        |                                           | コーラブル預金の預入（注2）        | 20,000,000<br>千円 | 現金及び預金 | 20,000,000<br>千円 |
|             |                    |         |                  |       |                        |                                           | コーラブル預金に係る受取利息（注2）    | 4,126<br>千円      | 未収収益   | 997<br>千円        |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円    | 証券業   | なし                     | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等             | 投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1） | 5,714,501<br>千円  | 未払手数料  | 944,351<br>千円    |

## 第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

| 種類          | 会社等の名称             | 所在地     | 資本金              | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                 | 取引の内容                 | 取引金額<br>(注3)    | 科目    | 期末残高<br>(注3)    |
|-------------|--------------------|---------|------------------|-------|------------------------|-------------------------------|-----------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | ㈱三菱UFJ銀行           | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業   | なし                     | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1） | 3,729,785<br>千円 | 未払手数料 | 764,501<br>千円   |
|             |                    |         |                  |       |                        |                               |                       |                 |       |                 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円    | 証券業   | なし                     | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1） | 5,655,482<br>千円 | 未払手数料 | 1,193,245<br>千円 |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
2. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
3. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示して

おります。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（非上場）

### （１株当たり情報）

|              | 第35期<br>（自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日） | 第36期<br>（自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日） |
|--------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| １株当たり純資産額    | 377,741.17円                          | 393,827.09円                         |
| １株当たり当期純利益金額 | 44,678.80円                           | 49,916.36円                          |

（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、記載していません。

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。

|                    | 第35期<br>（自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日） | 第36期<br>（自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日） |
|--------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益金額（千円）        | 9,453,186                            | 10,561,354                          |
| 普通株主に帰属しない金額（千円）   | -                                    | -                                   |
| 普通株式に係る当期純利益金額（千円） | 9,453,186                            | 10,561,354                          |
| 普通株式の期中平均株式数（株）    | 211,581                              | 211,581                             |

## 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】

< 更新後 >

#### （１）受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

資本金の額：324,279百万円（2021年３月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### （２）販売会社

| 名称                    | 資本金の額<br>（2021年３月末現在） | 事業の内容                         |
|-----------------------|-----------------------|-------------------------------|
| 三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社 | 40,500 百万円            | 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。 |
| ゴールドマン・サックス証券株式会社     | 83,616 百万円            | 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。 |
| みずほ証券株式会社             | 125,167 百万円           | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 野村證券株式会社              | 10,000 百万円            | 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。 |

|                         |             |                               |
|-------------------------|-------------|-------------------------------|
| ＢＮＰパリバ証券株式会社            | 102,025 百万円 | 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。 |
| エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社 | 5,500 百万円   | 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。 |

### 3【資本関係】

#### <訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2020年12月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

#### <訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2021年6月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

# 独立監査人の監査報告書

令和３年７月７日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 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MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信の令和２年12月９日から令和３年６月８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、MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信の令和３年６月８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、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

#### 利害関係

三菱ＵＦＪ国際投信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）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

令和3年6月28日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

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

青木 裕晃 印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

伊藤 鉄也 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36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、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和3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並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。