

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月12日提出
【計算期間】	第9期(自 2020年7月11日至 2021年7月12日)
【ファンド名】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

各ファンドにつき上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

##### [ 投資対象地域による区分 ]

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

##### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

##### [ 独立した区分 ]

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

##### [ 補足分類 ]

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

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

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### (1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

###### (2) 債券

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

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

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

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

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

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7) その他... 上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

##### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1) グローバル... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉と

する旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## <ファンドの特色>

### 1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

### 2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
  - 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド<sup>#1</sup>等に投資し、オルタナティブ運用<sup>#2</sup>を行います。
- ※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
- ※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、パンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

### 3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びパンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

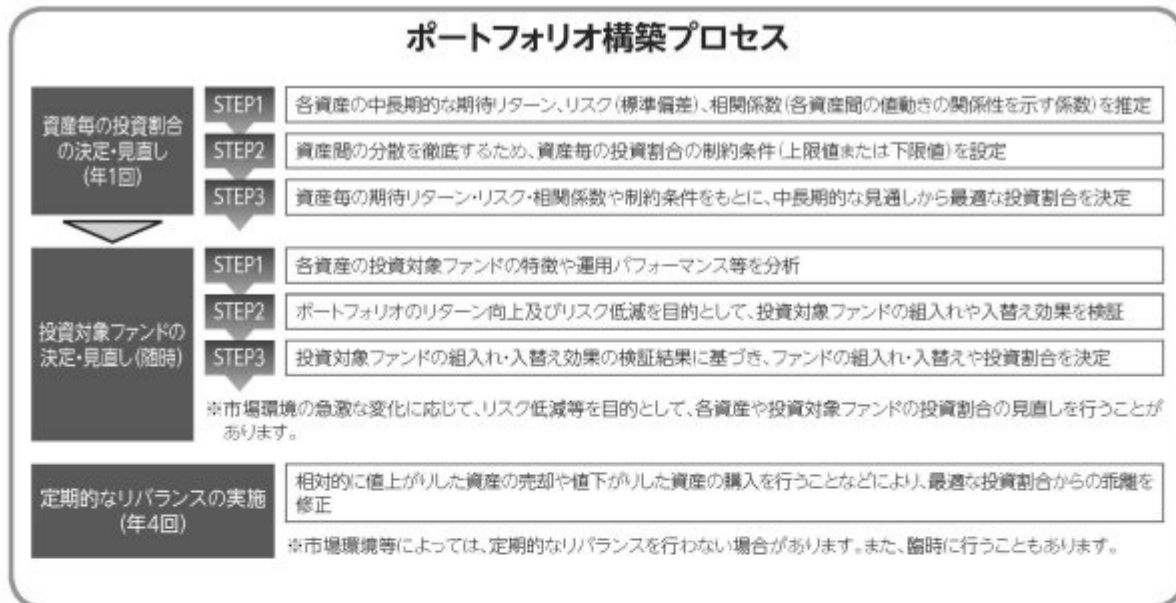
### 4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への投資割合の合計 <sup>#3</sup>	運用の特徴
分散投資コア戦略ファンドA 愛称:コアラップA	原則50%未満	安定性を重視
分散投資コア戦略ファンドS 愛称:コアラップS	原則75%未満	安定性と収益性のバランスを重視

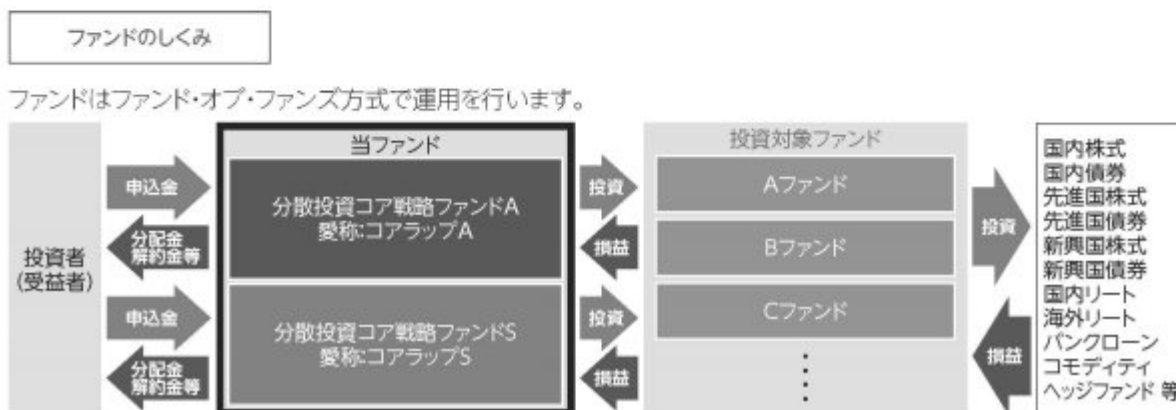
3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。

ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3 投資リスク (1)ファンドのリスク ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



### ? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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



### 分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
  - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
  - 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

### 〈ご参考情報〉

#### バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

#### コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

#### ヘッジファンド

ヘッジとは元々“回避する”という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド\*などがあります。

※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

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

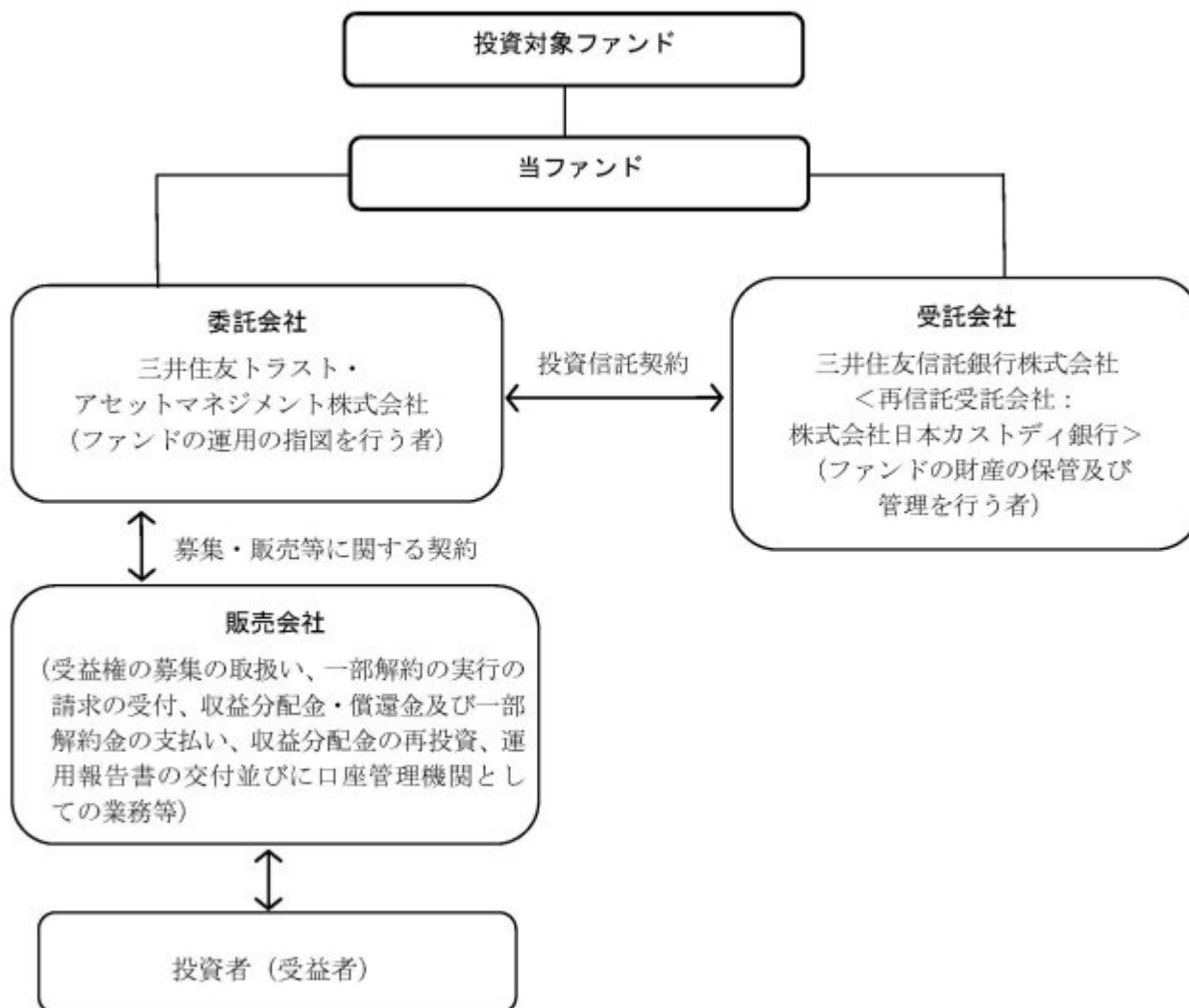
## (2) 【ファンドの沿革】

2013年3月29日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年 7月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

## 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

## 投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

## 投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ<sup>\*1</sup>、ヘッジファンド<sup>\*2</sup>及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

\*1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

\*2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、以下の割合とします。

分散投資コア戦略ファンドA	分散投資コア戦略ファンドS
50%未満	75%未満

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ニ．投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ヘ．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

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

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

## （参考）投資対象ファンドの概要

- ・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2021年7月30日（ ）のファンドに関しては2021年10月12日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

#### 1. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式
投資態度	<p>原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

- ・2022年4月4日に東京証券取引所（以下「東証」といいます。）は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ（スタンダード・グロス）」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロス市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

## 2. 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式
投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI 日本株最小分散インデックス（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

ベンチマーク	MSCI 日本株最小分散インデックス（配当込み）
決算日	年1回：1月22日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年4月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI 日本株最小分散インデックス（配当込み）」とは、MSCI Inc.が開発した日本の株式市場に上場する日本株を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、指数値の変動幅を一定の制約条件下で最小化することを目指します。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

### 3.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>



<p>主な投資制限</p>	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

#### 4. 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債

投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：12月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年1月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

に帰属します。

## 5. 外国株式インデックス マザーファンド

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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 6. 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

主要投資対象	わが国を除く世界の主要国の株式
投資態度	<p>主としてわが国を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCI コクサイ最小分散インデックス（JPY）（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ最小分散インデックス（JPY）（円換算ベース）
決算日	年1回：5月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年7月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI コクサイ最小分散インデックス（JPY）」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場に上場する銘柄を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、対円の為替変動を含めた指数値の変動幅を、一定の制約条件下で最小化することを目指します。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

## 7. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

#### 8.新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
投資態度	<p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 9. 新興国債券インデックス マザーファンド

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



投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 10. J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

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

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

東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

#### 11. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追隨するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にあ

る唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

## 12. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券

投資態度	<p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）および「ブルームバーグ（Bloomberg<sup>(R)</sup>）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

### 13. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2021年7月30日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。



<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>L B M A 金価格（円ヘッジベース）（ ）（2021年7月30日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年10月11日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

L B M A 金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、L B M A は、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、L B M A 金価格及びL B M A 金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

#### 14. 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

<p>運用会社</p>	<p>三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社</p>
<p>運用の基本方針</p>	<p>この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。</p>

<p>主要投資対象</p>	<p>主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略<sup>1</sup>に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1) この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き<sup>2</sup>を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。</p> <p>2) 当該戦略の参照対象は、S&amp;P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含まれます。</p>
<p>投資態度</p>	<p>円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 15. HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）（ ）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本国債及び国内外の上場投資信託証券を主要投資対象とし、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主として日本国債及び国内外の上場投資信託証券に投資し、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を組み合わせることで、HFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）（ ）の騰落率と概ね同程度の投資成果を目指します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、計量手法に基づいてHFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）の値動きを分析し、日本国債及び上場投資信託証券や上場投資証券の投資割合、株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引の取引量等を決定します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p> <p>なお、当該為替ヘッジとは別に、為替予約取引を活用することで収益の獲得を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年10月20日（予定）
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

HFRI 総合指数（円ヘッジ・円ベース）（HFRI Weighted Composite Index JPY）は、HFRI Fund Weighted Composite Index の日本円ヘッジバージョンであり、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）が月次為替予約のコストを適用して算出します。

HFRI Fund Weighted Composite Indexは、HFRのデータベースに登録されたヘッジファンドを対象とするグローバルな等加重インデックスです。データベースへの登録条件は、運用会社がHFRからの質問項目に回答すること、5,000万米ドル以上の運用資産残高を有するか、12か月間以上の運用実績と1,000万米ドル以上の運用資産残高を有すること、毎月、手数料控除後の米ドルベースのパフォーマンスと運用資産残高をHFRに対して報告することとなっています。なお、ファンド・オブ・ヘッジファンドは対象としていません。

「HFRI Weighted Composite Index JPY」および「HFRI」は、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）の商標です。その使用については、ライセンス契約に基づいてHFRから三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社、その関連会社、またはそれらの金融商品とは一切関係ありません。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社のいかなる金融商品の組成にも関与しておらず、それらの金融商品への投資を支持、承認、推奨するものではありません。また、それらの当該金融商品に関連するいかなる種類または性質の損害に対しても責任を負いません。

#### 16. ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ファミリーファンド方式により、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として、ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を投資対象とします。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。 当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、その主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI総合指数（HFRI Weighted Composite Index）（ ）を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 マザーファンドの組入れ比率は高位に保つことを原則とします。 当ファンドは、原則として対円での為替ヘッジを行います。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時（原則として毎年8月15日）に分配対象収益の中から、収益分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。ただし、信託財産の状況によっては、分配を行わないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.5775%（税抜 0.525%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2012年8月8日
信託期間	原則として2012年8月8日から2022年6月27日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「HFRI総合指数（HFRI Weighted Composite Index）」（以下「HFR指数」といいます。）は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク（HFR）の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」に関する使用を、BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR及びHFR指数（当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている）は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFRは、当該投資信託を發起、支持、販売又は推奨していません。HFRは、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日における当該投資信託の運用成績がHFR指数の運用成績あるいはHFR指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFRは当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR指数の過誤について通知する義務を負いません。HFRは、HFR指数の計算に使用される方法を含むHFR指数をいつでも修正、変更し、HFR指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。HFRは、当該投資信託及び当該投資信託の投資家に対して、HFR指数の過誤を含むいかなる種類、性質の損害も賠償する責任を負いません。

HFR指数に関して、HFRは、全ての明示的あるいは暗示的な保証（特定の目的に係る商品性又は適合

性、権利及び非侵害性の保証を含むがこれに限らない）を明示的に否認します。

#### 17.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 18.FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHL ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 19. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------

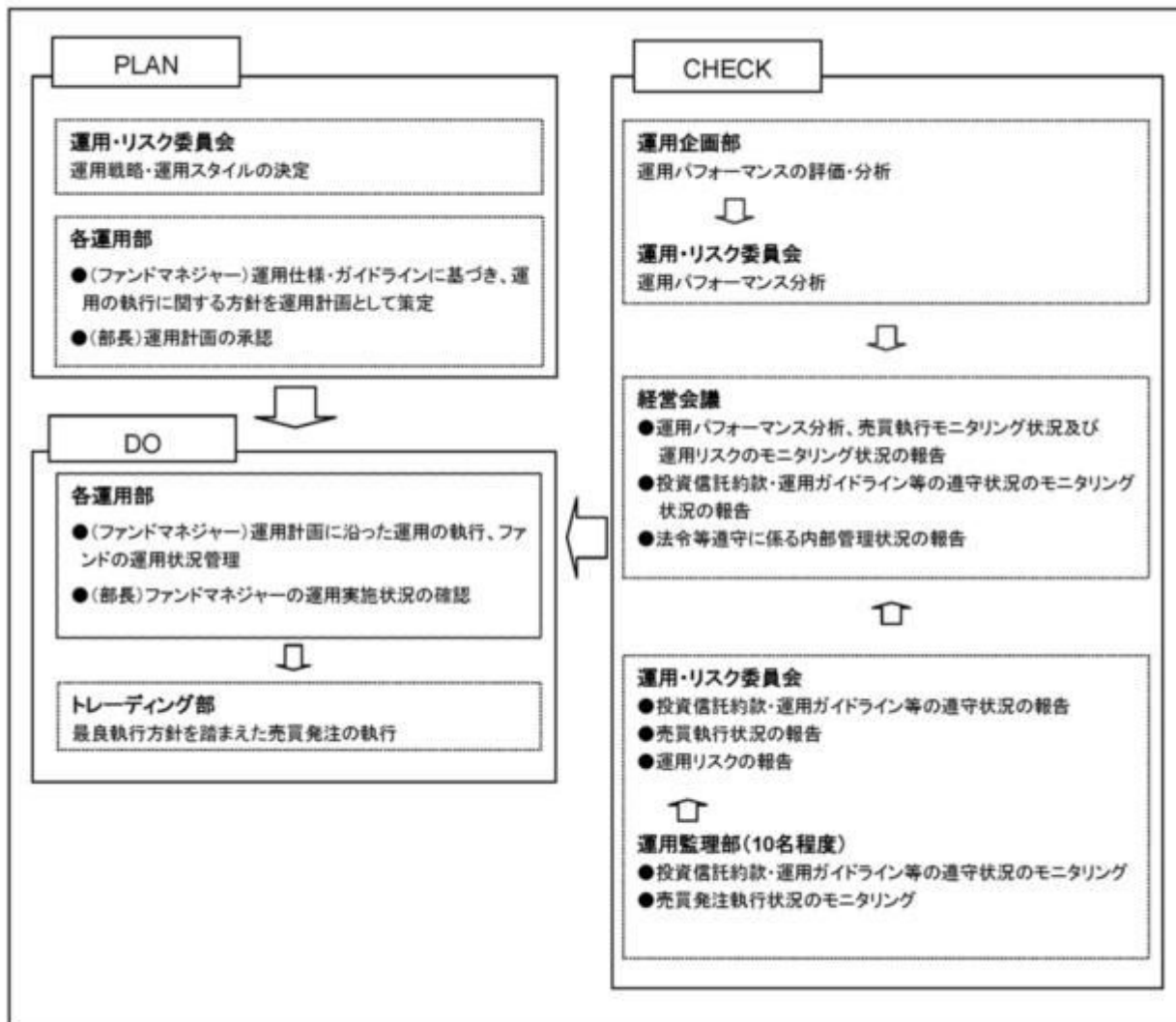


運用の基本方針	この投資信託は、わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」といいます。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」といいます。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引に係る実質投資額は原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.88%（税抜 0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2013年4月2日
信託期間	2013年4月2日から2026年3月26日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### （３）【運用体制】

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



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

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

### （４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年7月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として

次の通り収益分配を行う方針です。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

### ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

### ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

### ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

### ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

### チ．外国為替予約取引の指図

委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

### リ．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資

信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

（二）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

<その他の投資制限>

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

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

#### リートの価格変動リスク

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

### 商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 為替変動リスク

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

### 信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受け、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

### 流動性リスク

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

### カントリーリスク

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

### 資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

### ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

### 仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

#### ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があります。ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

## (2) リスクの管理体制

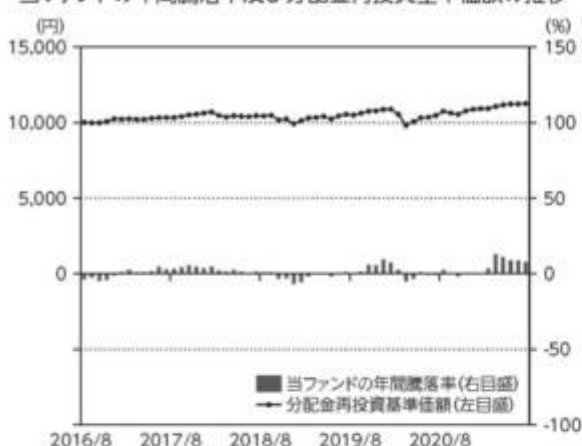
### 委託会社におけるリスク管理体制

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

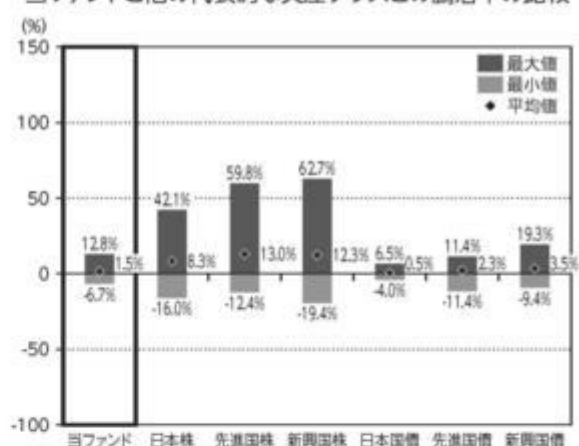
## 〔参考情報〕

## 分散投資コア戦略ファンドA

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

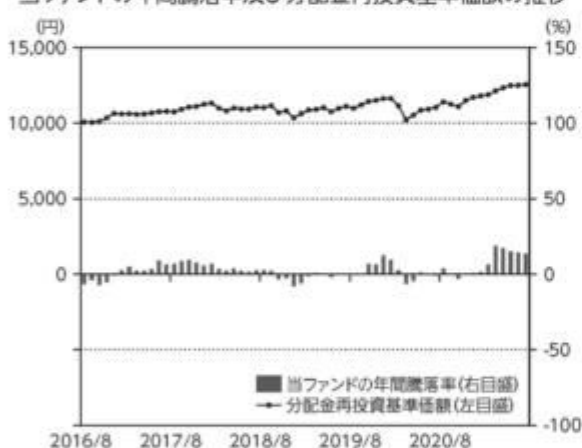


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

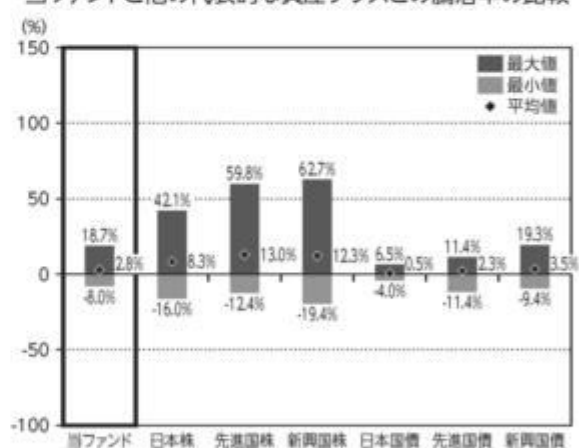


## 分散投資コア戦略ファンドS

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

\*2016年8月～2021年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

※各資産クラスの詳細については、後掲「各資産クラスの指数について」をご覧ください。



## 【参考情報】

## 各資産クラスの指数について

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

## (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.935%（税抜 0.85%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.495% （税抜 0.45%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
------	----------------------	------------------------------

販売会社	年率 0.385% (税抜 0.35%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

#### （参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。
H Fリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.5775% (税抜 0.525%)

F0Fs用 ピクテ マルチストラテジー リンク ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066%	（税抜 0.06%）
F0Fs用 MAN AHL ダイバーシファイ ド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066%	（税抜 0.06%）
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関 投資家専用）	年率 0.88%	（税抜 0.8%）

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

実質的な信託報酬率：年率0.935%～1.42646%程度（税抜 0.85%～1.3145%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（ ）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

しておりません。

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・ FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・ FOFs用 MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2021年7月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年7月30日現在の状況について記載してあります。

【分散投資コア戦略ファンドA】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	14,333,101,671	17.75
親投資信託受益証券	日本	65,690,212,816	81.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		737,469,224	0.91
合計(純資産総額)		80,760,783,711	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	27,501,766,685	1.4131	38,863,297,466	1.4160	38,942,501,625	48.22
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,876,550,513	3.8849	7,290,211,087	3.9067	7,331,119,889	9.08
日本	投資信託受益証券	FOFs用ピクテマルチストラテジーリンクファンド(適格機関投資家専用)	4,626,462,532	1.0767	4,981,312,208	1.0679	4,940,599,337	6.12
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	4,009,641,839	1.0182	4,082,617,320	1.0223	4,099,056,852	5.08
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	3,137,168,962	1.2644	3,966,636,435	1.2783	4,010,243,084	4.97
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	2,004,794,091	1.8864	3,781,843,573	1.8361	3,681,002,430	4.56
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,164,439,715	3.0772	3,583,213,890	3.0869	3,594,508,956	4.45
日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	2,762,660,495	1.178	3,254,414,063	1.1774	3,252,756,466	4.03
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	1,549,734,376	1.4518	2,249,904,367	1.4650	2,270,360,860	2.81
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHLダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	1,778,533,220	1.1254	2,001,561,285	1.1474	2,040,689,016	2.53
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	2,026,367,965	0.8951	1,813,801,965	0.8898	1,803,062,215	2.23
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	948,216,705	1.1558	1,095,948,867	1.1250	1,066,743,793	1.32
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	266,983,353	3.7166	992,270,329	3.6326	969,843,728	1.20
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	366,997,863	2.2917	841,049,003	2.2759	835,250,436	1.03
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックスマザーファンド	345,347,104	2.2787	786,942,445	2.2848	789,049,063	0.98
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	224,890,391	1.7618	396,211,890	1.7632	396,526,737	0.49

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	17.75
親投資信託受益証券	81.34
合計	99.09

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2013年 7月10日)	258,830,299	258,830,299	9,811	9,811
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	16,628,969,770	16,628,969,770	10,208	10,208
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	23,204,975,199	23,204,975,199	10,550	10,550
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	40,992,277,841	40,992,277,841	9,890	9,890
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	47,152,867,522	47,152,867,522	10,297	10,297
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	56,957,731,265	56,957,731,265	10,442	10,442
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	64,206,017,914	64,206,017,914	10,533	10,533
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	69,610,450,591	69,610,450,591	10,401	10,401
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	80,414,109,882	80,414,109,882	11,262	11,262
2020年 7月末日	70,510,861,414		10,473	
8月末日	72,636,388,746		10,746	
9月末日	71,679,790,702		10,635	
10月末日	72,200,765,004		10,557	
11月末日	73,418,724,095		10,767	
12月末日	74,638,883,412		10,884	
2021年 1月末日	75,770,981,126		10,925	
2月末日	75,647,116,097		10,936	
3月末日	77,412,534,510		11,064	
4月末日	78,224,175,602		11,171	
5月末日	79,460,590,901		11,237	
6月末日	79,117,926,476		11,237	
7月末日	80,760,783,711		11,262	

### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
--	-----	---------------

第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	1.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	4.0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.3
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	4.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.4
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.3
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	263,825,167		263,825,167
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	16,300,810,769	274,885,382	16,289,750,554
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	6,829,705,615	1,125,034,771	21,994,421,398
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	21,115,619,373	1,662,548,782	41,447,491,989
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	6,712,164,459	2,368,251,334	45,791,405,114
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	11,384,212,208	2,627,192,900	54,548,424,422
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	9,304,566,486	2,896,398,134	60,956,592,774
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	10,458,038,852	4,487,544,486	66,927,087,140
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8,942,057,064	4,467,543,464	71,401,600,740

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

## 【分散投資コア戦略ファンドS】

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	26,149,973,812	15.18
親投資信託受益証券	日本	144,464,514,867	83.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,640,170,657	0.95
合計(純資産総額)		172,254,659,336	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	28,458,238,458	1.4131	40,215,806,001	1.4160	40,296,865,656	23.39
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	9,325,182,835	3.8849	36,227,402,796	3.9067	36,430,691,781	21.15
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	12,026,495,095	1.2644	15,206,300,398	1.2783	15,373,468,679	8.92
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	7,145,826,516	1.8864	13,479,887,139	1.8361	13,120,452,066	7.62
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	7,499,598,114	1.4518	10,887,916,541	1.4650	10,986,911,237	6.38
日本	投資信託受益証券	FOFs用 ビクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	8,217,875,003	1.0767	8,848,186,015	1.0679	8,775,868,715	5.09
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	7,613,682,751	1.1254	8,568,438,567	1.1474	8,735,939,588	5.07
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	8,997,719,621	0.8951	8,053,858,832	0.8898	8,006,170,918	4.65
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	2,447,192,293	3.0772	7,530,500,124	3.0869	7,554,237,889	4.39
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5,027,202,853	1.0182	5,118,697,944	1.0223	5,139,309,476	2.98
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	1,326,986,681	3.7166	4,931,878,698	3.6326	4,820,411,817	2.80
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	3,126,143,390	1.1558	3,613,196,530	1.1250	3,516,911,313	2.04
日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	2,971,680,001	1.178	3,500,639,041	1.1774	3,498,856,033	2.03
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	771,274,107	2.2917	1,767,528,872	2.2759	1,755,342,740	1.02
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックスマザーファンド	767,067,340	2.2787	1,747,916,347	2.2848	1,752,595,458	1.02



日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	482,336,271	1.7618	849,780,042	1.7632	850,455,313	0.49
----	-----------	---------------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	15.18
親投資信託受益証券	83.87
合計	99.05

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2013年 7月10日)	54,287,050	54,287,050	9,915	9,915
第2期計算期間末	(2014年 7月10日)	9,560,643,872	9,560,643,872	10,451	10,451
第3期計算期間末	(2015年 7月10日)	23,718,308,897	23,718,308,897	11,013	11,013
第4期計算期間末	(2016年 7月11日)	40,713,425,166	40,713,425,166	9,845	9,845
第5期計算期間末	(2017年 7月10日)	57,661,475,690	57,661,475,690	10,759	10,759
第6期計算期間末	(2018年 7月10日)	75,431,956,580	75,431,956,580	11,008	11,008
第7期計算期間末	(2019年 7月10日)	89,663,756,248	89,663,756,248	11,109	11,109
第8期計算期間末	(2020年 7月10日)	143,157,363,596	143,157,363,596	10,980	10,980
第9期計算期間末	(2021年 7月12日)	171,466,226,114	171,466,226,114	12,554	12,554
	2020年 7月末日	144,748,415,921		11,045	
	8月末日	149,977,576,011		11,414	
	9月末日	147,646,464,368		11,262	
	10月末日	147,113,022,433		11,096	
	11月末日	151,603,492,720		11,499	
	12月末日	155,241,924,182		11,712	
	2021年 1月末日	157,800,420,732		11,802	

2月末日	158,194,575,045		11,892
3月末日	163,042,267,124		12,133
4月末日	165,732,996,689		12,344
5月末日	169,267,709,203		12,498
6月末日	169,479,793,450		12,508
7月末日	172,254,659,336		12,552

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	5.4
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	5.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	10.6
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.3
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.3
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.2
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	54,750,331		54,750,331

第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	9,258,266,615	164,756,557	9,148,260,389
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	13,807,316,695	1,419,809,778	21,535,767,306
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	22,822,224,799	3,002,745,419	41,355,246,686
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	15,776,145,748	3,537,868,655	53,593,523,779
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	19,014,211,372	4,083,197,323	68,524,537,828
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	17,123,071,331	4,937,538,036	80,710,071,123
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	60,254,110,229	10,583,069,703	130,381,111,649
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	17,432,745,205	11,230,399,627	136,583,457,227

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	459,412,921,520	99.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,447,755,193	0.74
合計(純資産総額)		462,860,676,713	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,543,300,000	0.77

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

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,785,800	9,127.79	16,300,424,865	9,805.00	17,509,769,000	3.78
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,104,300	10,787.43	11,912,562,545	11,375.00	12,561,412,500	2.71
日本	株式	キーエンス	電気機器	173,000	53,921.96	9,328,500,526	60,740.00	10,508,020,000	2.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,372,600	8,241.70	11,312,568,433	6,837.00	9,384,466,200	2.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,893,400	619.53	7,368,400,465	578.50	6,880,331,900	1.49
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,206,700	5,554.75	6,702,924,007	5,629.00	6,792,514,300	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	100,900	67,622.13	6,823,073,071	56,400.00	5,690,760,000	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,023,400	2,930.29	5,929,166,589	2,802.50	5,670,578,500	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	319,300	18,844.65	6,017,098,951	17,750.00	5,667,575,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,466,600	3,719.01	5,454,305,574	3,682.00	5,400,021,200	1.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,600	5,748.53	4,872,459,771	6,258.00	5,304,280,800	1.15
日本	株式	HOYA	精密機器	344,000	14,361.24	4,940,267,065	15,405.00	5,299,320,000	1.14
日本	株式	日本電産	電気機器	424,300	12,534.65	5,318,454,769	12,240.00	5,193,432,000	1.12
日本	株式	ダイキン工業	機械	224,600	21,597.96	4,850,903,057	22,665.00	5,090,559,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,387,900	3,356.58	4,658,598,373	3,493.00	4,847,934,700	1.05
日本	株式	村田製作所	電気機器	517,900	8,284.71	4,290,655,048	9,040.00	4,681,816,000	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	103,300	48,629.50	5,023,427,586	44,920.00	4,640,236,000	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,387,300	3,711.73	5,149,284,592	3,332.00	4,622,483,600	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,203,200	3,948.33	4,750,636,550	3,695.00	4,445,824,000	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,214,400	3,248.61	3,945,123,685	3,232.00	3,924,940,800	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	154,700	26,302.92	4,069,061,858	24,380.00	3,771,586,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,362,500	1,671.28	3,948,402,022	1,565.50	3,698,493,750	0.80
日本	株式	三井物産	卸売業	1,385,000	2,416.04	3,346,222,677	2,499.50	3,461,807,500	0.75
日本	株式	S M C	機械	51,600	65,517.32	3,380,694,031	64,800.00	3,343,680,000	0.72

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	679,200	4,744.67	3,222,584,653	4,868.00	3,306,345,600	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,057,100	2,985.27	3,155,733,927	3,062.00	3,236,840,200	0.70
日本	株式	第一三共	医薬品	1,385,300	2,526.75	3,500,319,076	2,159.50	2,991,555,350	0.65
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	572,600	5,178.18	2,965,026,787	5,210.00	2,983,246,000	0.64
日本	株式	富士通	電気機器	158,600	17,835.33	2,828,684,149	18,565.00	2,944,409,000	0.64
日本	株式	デンソー	輸送用機器	388,100	7,503.63	2,912,161,593	7,482.00	2,903,764,200	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.34
		食料品	3.35
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.07
		医薬品	5.02
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.80
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.62
		機械	5.47
		電気機器	18.33
		輸送用機器	8.03
		精密機器	2.78
		その他製品	2.29
電気・ガス業	1.20		
陸運業	3.26		

	海運業	0.36
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.44
	卸売業	4.85
	小売業	4.55
	銀行業	4.89
	証券、商品先物取引業	0.75
	保険業	1.88
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.98
	サービス業	5.63
	小計	99.26
合計		99.26

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	186円		3,595,097,300	3,543,300,000	0.77

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

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

#### 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	4,464,435,140	97.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		119,315,629	2.60
合計(純資産総額)		4,583,750,769	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	114,300,000	2.49

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	57,207.76	74,370,100	60,740.00	78,962,000	1.72
日本	株式	HOYA	精密機器	5,000	13,614.90	68,074,500	15,405.00	77,025,000	1.68
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	7,700	7,667.80	59,042,060	9,805.00	75,498,500	1.65
日本	株式	村田製作所	電気機器	8,100	10,128.07	82,037,400	9,040.00	73,224,000	1.60
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	9,300	6,294.43	58,538,199	7,831.00	72,828,300	1.59
日本	株式	富士通	電気機器	3,900	16,934.41	66,044,199	18,565.00	72,403,500	1.58
日本	株式	ニトリホールディングス	小売業	3,400	21,823.61	74,200,300	20,805.00	70,737,000	1.54
日本	株式	東宝	情報・通信業	14,600	3,977.26	58,068,000	4,760.00	69,496,000	1.52
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	14,200	4,109.93	58,361,006	4,800.00	68,160,000	1.49
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	46,400	1,348.71	62,580,144	1,429.50	66,328,800	1.45
日本	株式	日本郵政	サービス業	70,400	834.59	58,755,136	929.10	65,408,640	1.43
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	23,300	2,704.24	63,008,792	2,802.50	65,298,250	1.42
日本	株式	日本マクドナルドホールディングス	小売業	13,200	5,092.71	67,223,800	4,940.00	65,208,000	1.42
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	20,100	3,159.62	63,508,400	3,232.00	64,963,200	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	21,200	2,781.78	58,973,900	3,062.00	64,914,400	1.42
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	69,000	890.11	61,418,200	930.00	64,170,000	1.40
日本	株式	セコム	サービス業	7,700	9,359.49	72,068,100	8,254.00	63,555,800	1.39
日本	株式	KDDI	情報・通信業	18,800	3,248.67	61,074,996	3,332.00	62,641,600	1.37
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	39,900	1,411.66	56,325,234	1,565.50	62,463,450	1.36
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	28,800	2,049.94	59,038,400	2,140.00	61,632,000	1.34
日本	株式	中外製薬	医薬品	14,600	5,595.90	81,700,200	4,020.00	58,692,000	1.28

日本	株式	アステラス製薬	医薬品	33,300	1,685.96	56,142,468	1,739.00	57,908,700	1.26
日本	株式	オービック	情報・通信業	3,000	20,930.00	62,790,000	19,220.00	57,660,000	1.26
日本	株式	キヤノン	電気機器	22,800	2,197.86	50,111,208	2,496.50	56,920,200	1.24
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	3,800	16,025.26	60,896,000	14,950.00	56,810,000	1.24
日本	株式	任天堂	その他製品	1,000	63,920.00	63,920,000	56,400.00	56,400,000	1.23
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	11,500	3,959.32	45,532,180	4,868.00	55,982,000	1.22
日本	株式	S Gホールディングス	陸運業	19,000	2,799.46	53,189,740	2,938.00	55,822,000	1.22
日本	株式	シマノ	輸送用機器	1,900	26,130.52	49,648,000	27,950.00	53,105,000	1.16
日本	株式	ダイキン工業	機械	2,300	23,056.78	53,030,600	22,665.00	52,129,500	1.14

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	1.71
		食料品	5.60
		化学	6.28
		医薬品	7.30
		石油・石炭製品	0.04
		ゴム製品	1.49
		金属製品	0.62
		機械	2.65
		電気機器	14.51
		輸送用機器	2.81
		精密機器	4.02
		その他製品	2.00
		電気・ガス業	3.83
		陸運業	5.74
		情報・通信業	12.71
		卸売業	4.12
		小売業	10.50
		銀行業	3.45
		保険業	1.61
		その他金融業	0.35
不動産業	0.31		
サービス業	5.74		
		小計	97.40
合計			97.40



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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建		6円	117,468,300	114,300,000	2.49

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	538,024,916,850	83.79
地方債証券	日本	34,929,489,093	5.44
特殊債券	日本	38,739,610,956	6.03
社債券	日本	27,438,546,740	4.27
	フランス	1,101,698,000	0.17
	オーストラリア	399,716,000	0.06
	小計	28,939,960,740	4.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,457,677,785	0.23
合計(純資産総額)		642,091,655,424	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	8,240,000,000	100.95	8,318,362,400	100.99	8,322,152,800	0.100	2025/9/20	1.30
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	7,830,000,000	101.05	7,912,234,600	101.50	7,947,763,200	0.100	2028/3/20	1.24

日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,750,000,000	100.74	7,807,350,000	100.75	7,808,512,500	0.100	2024/9/20	1.22
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,950,000,000	100.60	6,991,700,000	100.57	6,989,823,500	0.100	2023/12/20	1.09
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	100.54	6,796,706,800	100.49	6,793,259,200	0.100	2023/9/20	1.06
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	100.98	6,705,404,000	101.18	6,718,883,200	0.100	2026/9/20	1.05
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,520,000,000	100.91	6,579,723,200	100.95	6,582,331,200	0.100	2025/6/20	1.03
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	102.24	6,462,136,800	102.24	6,461,884,000	0.400	2025/9/20	1.01
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	101.01	6,414,706,500	101.30	6,432,804,000	0.100	2027/3/20	1.00
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	100.70	6,344,352,000	100.69	6,343,722,000	0.100	2024/6/20	0.99
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	6,070,000,000	100.66	6,110,062,000	100.64	6,109,212,200	0.100	2024/3/20	0.95
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	5,740,000,000	100.46	5,766,404,000	101.19	5,808,306,000	0.100	2030/9/20	0.90
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	5,700,000,000	100.35	5,720,406,000	100.32	5,718,525,000	0.100	2022/12/20	0.89
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	100.80	5,423,201,400	100.83	5,424,815,400	0.100	2024/12/20	0.84
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	5,220,000,000	100.96	5,270,112,000	101.07	5,275,906,200	0.100	2026/3/20	0.82
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	5,090,000,000	101.05	5,143,906,100	101.42	5,162,379,800	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	4,920,000,000	100.34	4,936,773,600	101.08	4,973,136,000	0.100	2030/12/20	0.77
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	4,860,000,000	102.23	4,968,378,000	102.14	4,964,052,600	0.600	2024/6/20	0.77
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	101.87	4,889,760,000	101.74	4,883,760,000	0.600	2023/12/20	0.76
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	4,820,000,000	100.96	4,866,464,800	101.13	4,874,466,000	0.100	2026/6/20	0.76
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	4,750,000,000	102.13	4,851,175,000	102.12	4,851,032,500	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.85	4,841,232,000	100.89	4,842,912,000	0.100	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	4,730,000,000	100.29	4,744,110,200	100.96	4,775,549,900	0.100	2031/3/20	0.74
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	4,690,000,000	100.89	4,732,116,200	101.57	4,763,914,400	0.100	2029/3/20	0.74
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	4,610,000,000	101.01	4,656,987,900	101.58	4,682,976,300	0.100	2028/9/20	0.73
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	101.02	4,657,252,500	101.56	4,681,962,100	0.100	2028/6/20	0.73
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	102.00	4,651,382,400	101.98	4,650,652,800	0.400	2025/3/20	0.72
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	4,590,000,000	101.20	4,645,447,200	101.05	4,638,470,400	0.800	2022/9/20	0.72
日本	国債証券	第416回利付国債(2年)	4,530,000,000	100.30	4,543,590,000	100.25	4,541,506,200	0.100	2022/9/1	0.71
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	4,400,000,000	100.54	4,423,760,000	101.29	4,456,892,000	0.100	2030/6/20	0.69

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	83.79
地方債証券	5.44
特殊債券	6.03
社債券	4.51
合計	99.77

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	355,563,101,163	65.99
	イギリス	22,607,822,987	4.20
	カナダ	18,496,000,336	3.43
	スイス	17,665,266,660	3.28
	フランス	17,114,297,056	3.18
	ドイツ	15,080,524,735	2.80
	オーストラリア	10,279,020,899	1.91
	オランダ	10,184,161,739	1.89
	アイルランド	9,682,306,636	1.80
	スウェーデン	5,929,756,632	1.10
	デンマーク	4,316,132,381	0.80
	スペイン	3,950,846,492	0.73
	香港	3,691,797,746	0.69
	イタリア	3,076,822,471	0.57
	フィンランド	2,197,718,451	0.41
	ジャージー	1,713,828,768	0.32
	シンガポール	1,509,154,194	0.28
	ベルギー	1,401,987,027	0.26
	バミューダ	1,222,773,158	0.23
	ノルウェー	1,042,169,023	0.19
イスラエル	1,017,532,708	0.19	

	ケイマン	927,673,671	0.17
	ルクセンブルク	554,146,474	0.10
	ニュージーランド	539,785,083	0.10
	キュラソー	398,085,958	0.07
	オーストリア	313,122,780	0.06
	ポルトガル	241,208,304	0.04
	パナマ	175,349,242	0.03
	リベリア	168,805,697	0.03
	マン島	138,286,173	0.03
	パプアニューギニア	58,542,246	0.01
	小計	511,258,026,890	94.88
投資信託受益証券	オーストラリア	228,825,401	0.04
	香港	80,384,013	0.01
	小計	309,209,414	0.06
投資証券	アメリカ	10,033,423,942	1.86
	オーストラリア	701,470,366	0.13
	イギリス	329,628,798	0.06
	フランス	274,934,151	0.05
	シンガポール	231,662,920	0.04
	香港	180,175,875	0.03
	カナダ	78,608,037	0.01
	小計	11,829,904,089	2.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,428,238,919	2.86
合計(純資産総額)		538,825,379,312	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,520,694,370	2.14
	買建	カナダ	895,683,398	0.17
	買建	ドイツ	2,018,822,445	0.37
	買建	イギリス	599,460,792	0.11
	買建	オーストラリア	474,227,728	0.09

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		437,946,550	0.08

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,450,831	13,643.54	19,794,483,694	15,946.12	23,135,130,449	4.29
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	619,180	27,337.46	16,926,810,464	31,368.88	19,422,986,214	3.60
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,986	352,893.93	13,052,135,054	394,155.24	14,578,225,736	2.71
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	207,790	35,992.64	7,478,912,265	39,232.45	8,152,112,198	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,977	258,051.50	6,703,403,984	297,325.56	7,723,626,319	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	25,465	264,041.70	6,723,822,002	298,996.38	7,613,942,992	1.41
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,189	68,455.33	4,530,990,354	74,163.05	4,908,778,216	0.91
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	213,732	17,786.10	3,801,459,377	21,527.92	4,601,206,210	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	263,503	17,982.63	4,738,478,956	16,751.97	4,414,194,351	0.82
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	226,967	18,531.18	4,205,966,899	18,851.98	4,278,779,206	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	146,419	24,887.07	3,643,940,928	27,144.76	3,974,508,732	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,910	45,101.12	3,694,232,805	45,118.63	3,695,667,737	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	118,353	31,690.78	3,750,699,548	30,630.92	3,625,261,559	0.67
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,795	13,428.85	3,341,031,234	13,740.64	3,418,603,773	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	92,922	34,917.45	3,244,599,837	35,850.31	3,331,282,571	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	76,521	39,479.90	3,021,041,750	42,570.80	3,257,560,715	0.60

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	212,538	14,764.72	3,138,065,441	15,271.66	3,245,809,178	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	156,656	19,560.38	3,064,252,221	19,527.54	3,059,106,541	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	36,125	71,859.75	2,595,933,577	83,621.69	3,020,833,804	0.56
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	95,999	28,469.58	2,733,052,152	31,004.28	2,976,380,193	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	670,589	4,641.28	3,112,392,051	4,235.07	2,839,993,502	0.53
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	41,289	55,246.46	2,281,071,261	68,069.93	2,810,539,464	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,854	38,140.25	2,320,987,382	42,007.46	2,556,321,971	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	394,334	6,278.15	2,475,690,605	6,362.46	2,508,935,840	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	365,193	6,390.93	2,333,923,374	6,452.24	2,356,314,964	0.44
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	484,175	4,240.54	2,053,167,183	4,685.07	2,268,397,205	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	355,696	6,053.70	2,153,277,622	6,246.40	2,221,821,095	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	82,450	26,002.83	2,143,933,363	26,719.93	2,203,059,020	0.41
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	364,089	5,792.02	2,108,811,134	6,029.61	2,195,316,241	0.41
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	356,926	6,185.09	2,207,619,469	6,129.25	2,187,688,757	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.00
		素材	4.30
		資本財	6.28
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.87
		耐久消費財・アパレル	2.02
		消費者サービス	1.79
		メディア・娯楽	7.32

	小売	5.53
	食品・生活必需品小売り	1.32
	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	5.06
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.44
	銀行	5.70
	各種金融	4.59
	保険	2.87
	不動産	0.47
	ソフトウェア・サービス	12.08
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.78
	電気通信サービス	1.61
	公益事業	2.81
	半導体・半導体製造装置	4.49
	小計	94.88
投資信託受益証券		0.06
投資証券		2.20
合計		97.14

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	477	アメリカドル	101,816,341.5	11,147,871,230	105,221,430	11,520,694,370	2.14
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	42	カナダドル	10,080,679	885,486,843	10,196,760	895,683,398	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	46	スイスフラン	5,493,792	663,924,763	5,547,600	670,427,460	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	252	ユーロ	10,312,629	1,341,776,159	10,363,500	1,348,394,985	0.25
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,819,474	470,562,668	5,864,800	474,227,728	0.09
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	56	イギリスポンド	3,941,460	602,097,430	3,924,200	599,460,792	0.11	

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,000,000.00	438,457,500	437,946,550	0.08

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

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

## 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	12,124,390,110	60.12
	スイス	1,685,932,122	8.36
	カナダ	1,273,780,854	6.32
	ドイツ	553,445,625	2.74
	デンマーク	496,860,400	2.46
	アイルランド	472,897,626	2.35
	オーストラリア	385,819,276	1.91
	香港	328,067,095	1.63
	フランス	280,813,996	1.39
	オランダ	255,653,783	1.27
	スウェーデン	216,606,618	1.07
	フィンランド	205,490,238	1.02
	シンガポール	196,201,375	0.97
	イギリス	122,607,473	0.61
	イスラエル	114,679,248	0.57
	ルクセンブルク	111,429,880	0.55
	ノルウェー	89,503,835	0.44
	ベルギー	89,182,167	0.44
	バミューダ	88,363,248	0.44
	ケイマン	65,064,069	0.32
イタリア	50,473,930	0.25	
ニュージーランド	42,193,935	0.21	
	小計	19,249,456,903	95.45
投資信託受益証券	香港	57,645,008	0.29
投資証券	アメリカ	441,565,577	2.19



	香港	50,618,325	0.25
	小計	492,183,902	2.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		366,736,619	1.82
合計(純資産総額)		20,166,022,432	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	169,066,793	0.84
	買建	カナダ	42,651,590	0.21

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,118	37,204.31	264,820,338	42,007.45	299,009,100	1.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	4,322	54,646.81	236,183,540	68,069.93	294,198,250	1.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	16,788	15,932.42	267,473,555	17,169.12	288,235,302	1.43
ドイツ	株式	DEUTSCHE TELEKOM	電気通信サービス	124,210	2,169.24	269,441,939	2,300.86	285,790,471	1.42
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	20,346	13,278.35	270,161,399	13,740.64	279,567,163	1.39
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	8,997	31,590.92	284,223,584	30,630.92	275,586,409	1.37
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10,168	21,691.27	220,556,867	26,861.18	273,124,496	1.35
アメリカ	株式	NEXTERA ENERGY INC	公益事業	31,903	8,137.80	259,620,301	8,557.73	273,017,528	1.35
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	14,293	18,376.13	262,650,141	18,851.98	269,451,467	1.34
アメリカ	株式	WASTE MANAGEMENT INC	商業・専門サービス	15,745	15,439.39	243,093,279	16,008.53	252,054,351	1.25

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	40,088	6,384.29	255,933,598	6,129.25	245,709,382	1.22
アメリカ	株式	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	11,178	23,157.81	258,858,082	21,939.60	245,240,918	1.22
アメリカ	株式	NEWMONT CORPORATION	素材	35,173	7,312.62	257,207,005	6,867.21	241,540,476	1.20
アメリカ	株式	REGENERON PHARMACEUTICALS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,530	54,808.29	193,473,296	63,846.90	225,379,570	1.12
アメリカ	株式	PAYCHEX INC	ソフトウェア・サービス	17,755	11,090.05	196,903,874	12,441.34	220,896,146	1.10
カナダ	株式	FRANCO-NEVADA CORP	素材	12,613	15,779.23	199,023,460	17,476.64	220,432,941	1.09
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	21,715	9,680.90	210,220,871	10,093.39	219,178,007	1.09
アメリカ	株式	KROGER CO	食品・生活必需品小売り	47,884	4,149.83	198,710,601	4,458.43	213,487,596	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	706	264,751.23	186,914,373	298,996.38	211,091,449	1.05
アメリカ	株式	DOLLAR GENERAL CORP	小売	8,243	23,957.85	197,484,634	25,511.16	210,288,574	1.04
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	20,670	8,218.88	169,884,278	10,002.53	206,752,316	1.03
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE		6,028	30,710.37	185,122,154	34,140.07	205,796,383	1.02
アメリカ	株式	TARGET (DAYTON HUDSON)	小売	7,150	24,662.63	176,337,854	28,649.15	204,841,447	1.02
カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専門サービス	14,641	13,449.44	196,913,380	13,682.96	200,332,295	0.99
アメリカ	株式	XCEL ENERGY INC	公益事業	26,106	7,738.65	202,025,286	7,531.81	196,625,617	0.98
アメリカ	株式	T-MOBILE US INC	電気通信サービス	12,188	15,317.98	186,695,587	15,835.53	193,003,546	0.96
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	25,078	7,284.04	182,669,401	7,645.68	191,738,531	0.95
アメリカ	株式	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10,778	15,785.71	170,138,440	17,705.62	190,831,258	0.95
アメリカ	株式	REPUBLIC SERVICES INC	商業・専門サービス	14,785	12,101.29	178,917,673	12,643.90	186,940,138	0.93
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	5,337	31,791.45	169,670,988	34,856.14	186,027,227	0.92

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	0.21
		素材	6.01

資本財	1.66
商業・専門サービス	3.77
運輸	1.95
耐久消費財・アパレル	0.74
消費者サービス	1.57
メディア・娯楽	3.45
小売	4.40
食品・生活必需品小売り	2.80
食品・飲料・タバコ	6.69
家庭用品・パーソナル用品	2.42
ヘルスケア機器・サービス	4.36
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	13.66
銀行	1.36
各種金融	3.33
保険	4.35
不動産	0.06
ソフトウェア・サービス	12.95
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.35
電気通信サービス	8.62
公益事業	7.33
半導体・半導体製造装置	0.44
小計	95.45
投資信託受益証券	0.29
投資証券	2.44
合計	98.18

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	7	アメリカドル	1,485,764	162,676,300	1,544,130	169,066,793	0.84
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	2	カナダドル	479,125	42,086,340	485,560	42,651,590	0.21

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	135,764,022,446	44.70
	フランス	30,352,011,059	9.99
	イタリア	28,652,890,818	9.43
	ドイツ	22,672,878,224	7.46
	イギリス	19,731,005,963	6.50
	スペイン	17,775,376,123	5.85
	ベルギー	7,122,778,518	2.35
	オーストラリア	6,107,070,808	2.01
	オランダ	5,902,987,498	1.94
	カナダ	5,878,668,915	1.94
	オーストリア	4,488,584,742	1.48
	アイルランド	2,483,088,862	0.82
	メキシコ	2,142,034,680	0.71
	フィンランド	1,881,677,324	0.62
	ポーランド	1,840,574,348	0.61
	デンマーク	1,499,814,432	0.49
	マレーシア	1,398,471,153	0.46
	イスラエル	1,366,694,469	0.45
	シンガポール	1,304,342,857	0.43
	スウェーデン	881,476,007	0.29
ノルウェー	740,704,477	0.24	
	小計	299,987,153,723	98.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,739,326,653	1.23
合計(純資産総額)		303,726,480,376	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	638,125,678	0.21
	買建	ドイツ	792,702,981	0.26

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,276,495,381	0.42
	売建		4,977,844,980	1.64

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,096.17	1,610,340,008	10,388.71	1,657,000,711	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,509.32	1,581,654,046	10,821.54	1,628,642,800	1.125	2031/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,137.23	1,429,350,043	10,421.22	1,469,392,589	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	10,950.71	1,423,592,401	10,934.88	1,421,535,190	0.250	2024/3/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,534.18	1,239,443,908	10,125.25	1,316,283,655	1.375	2040/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,812.94	1,269,891,536	11,898.48	1,279,086,986	2.375	2027/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	10,829.24	1,245,363,211	10,866.88	1,249,691,488	0.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	11,977.17	1,196,520,235	12,168.78	1,215,661,824	2.625	2029/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	10,946.86	1,204,154,771	10,984.92	1,208,341,905	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,590.54	1,184,553,491	11,646.57	1,190,279,564	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,303.18	1,148,804,585	10,600.00	1,181,900,070	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,642.29	1,181,692,848	11,600.80	1,177,481,976	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,243.46	1,124,346,821	11,209.46	1,120,946,642	2.000	2022/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,974.23	1,113,884,756	10,968.03	1,113,255,291	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,137.61	1,113,761,361	11,111.95	1,111,195,189	1.500	2022/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,165.36	1,085,150,599	12,326.17	1,099,495,158	2.875	2028/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	22,454.25	1,059,840,775	23,260.28	1,097,885,459	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	10,890.96	1,089,096,482	10,923.33	1,092,333,828	0.250	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	10,920.34	1,092,034,439	10,908.79	1,090,879,670	0.125	2024/1/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,796.31	1,079,631,280	10,811.70	1,081,170,983	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,576.04	1,057,604,969	10,722.74	1,072,274,921	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	9,470,000	11,128.85	1,053,902,885	11,309.11	1,070,973,617	1.625	2031/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	9,900,000	10,014.05	991,391,750	10,816.41	1,070,825,033	1.875	2051/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,148.51	1,059,109,391	11,123.71	1,056,752,784	1.500	2022/9/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,737.24	1,050,483,203	11,803.53	1,056,416,408	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,365.52	1,038,704,257	12,540.02	1,053,362,231	3.125	2028/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	15,934.83	1,016,642,276	16,229.53	1,035,444,082	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,312.54	1,018,128,697	11,292.43	1,016,319,543	1.375	2025/1/31	0.33

アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,726.55	1,002,620,036	11,829.62	1,011,432,909	2.250	2027/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,496.49	997,167,349	10,622.66	1,009,153,502	0.375	2027/7/31	0.33

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.77
合計	98.77

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	17	アメリカドル	2,114,610.1	231,528,659	2,113,445.27	231,401,122	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	13	アメリカドル	1,748,833.33	191,479,761	1,744,843.75	191,042,942	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	12	アメリカドル	1,986,002.35	217,447,398	1,969,875	215,681,614	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	8	ユーロ	898,126.8	116,855,278	898,800	116,942,868	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	11	ユーロ	1,484,623.1	193,164,311	1,488,520	193,671,337	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	21	ユーロ	3,691,174.1	480,258,662	3,705,240	482,088,776	0.16

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,260,000.00	577,622,591	575,830,610	0.19
	カナダドル	買建	721,749.00	62,459,990	63,386,545	0.02
	ユーロ	買建	4,040,000.00	523,741,775	525,711,060	0.17
	イギリスポンド	買建	730,000.00	110,609,764	111,498,813	0.04
	スウェーデンクローナ	買建	1,835.00	23,435	23,488	0.00

シンガポールドル	買建	140.42	11,358	11,355	0.00
イスラエルシェケル	買建	990.60	33,507	33,510	0.00
アメリカドル	売建	20,750,290.38	2,276,910,688	2,271,868,367	0.75
カナダドル	売建	1,122,443.72	98,341,784	98,591,078	0.03
メキシコペソ	売建	6,658,443.33	36,644,742	36,666,715	0.01
ユーロ	売建	15,650,130.82	2,033,455,927	2,036,299,556	0.67
イギリスポンド	売建	2,148,278.78	327,780,079	328,159,895	0.11
スウェーデンクローナ	売建	2,114,550.00	27,000,266	27,066,240	0.01
ポーランドズロチ	売建	1,001,140.25	28,271,900	28,496,756	0.01
オーストラリアドル	売建	1,184,595.00	95,798,197	95,786,351	0.03
シンガポールドル	売建	166,042.27	13,431,308	13,427,406	0.00
マレーシアリングギット	売建	841,671.80	21,831,872	21,742,402	0.01
イスラエルシェケル	売建	583,546.60	19,699,249	19,740,214	0.01

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

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

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	20,720,227,815	21.22
	台湾	13,279,285,920	13.60
	韓国	12,722,851,245	13.03
	中国	10,459,040,629	10.71
	インド	10,038,220,930	10.28
	ブラジル	4,909,387,120	5.03
	南アフリカ	3,365,812,715	3.45
	サウジアラビア	2,895,189,676	2.96
	ロシア	2,719,566,169	2.78
	メキシコ	1,736,811,433	1.78
	タイ	1,507,837,638	1.54
	マレーシア	1,178,398,036	1.21
	インドネシア	1,105,766,404	1.13
	香港	1,029,669,362	1.05
	アラブ首長国連邦	718,855,549	0.74
	ポーランド	629,454,072	0.64
	カタール	620,262,834	0.64
	バミューダ	594,672,774	0.61
	フィリピン	566,586,971	0.58

	クウェート	536,094,247	0.55
	チリ	408,847,453	0.42
	アメリカ	380,782,083	0.39
	トルコ	252,120,655	0.26
	ルクセンブルク	233,876,640	0.24
	ハンガリー	233,702,198	0.24
	オランダ	229,255,164	0.23
	ギリシャ	159,177,765	0.16
	キプロス	134,960,750	0.14
	コロンビア	132,782,853	0.14
	ジャージー	106,325,721	0.11
	チェコ	92,408,216	0.09
	エジプト	57,432,529	0.06
	マン島	44,759,011	0.05
	英ヴァージン諸島	44,066,116	0.05
	パキスタン	30,812,139	0.03
	シンガポール	19,718,110	0.02
	ペルー	16,219,575	0.02
	アルゼンチン	7,438,551	0.01
	小計	93,918,677,068	96.16
投資信託受益証券	ブラジル	229,325,777	0.23
	メキシコ	36,073,950	0.04
	小計	265,399,727	0.27
投資証券	南アフリカ	52,958,545	0.05
	メキシコ	36,570,582	0.04
	小計	89,529,127	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,390,874,123	3.47
合計(純資産総額)		97,664,480,045	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,298,514,353	3.38

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

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



資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,384,900,952	1.42
	売建		1,204,358,100	1.23

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,615,389	1,833.53	4,795,412,224	2,286.52	5,980,154,949	6.12
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,607,788	3,892.48	6,258,285,786	2,779.95	4,469,581,505	4.58
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	611,000	8,677.33	5,301,852,602	6,932.28	4,235,623,080	4.34
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	506,823	5,890.13	2,985,254,246	7,560.30	3,831,733,927	3.92
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	383,000	4,639.72	1,777,015,467	3,218.15	1,232,553,748	1.26
ブラジル	株式	VALE SA	素材	420,578	1,492.95	627,902,928	2,490.12	1,047,293,477	1.07
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	46,279	25,097.25	1,161,476,016	21,475.07	993,844,778	1.02
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	302,723	3,040.65	920,477,231	3,038.81	919,917,680	0.94
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	362,651	1,731.32	627,866,971	2,393.15	867,881,867	0.89
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,122,620	82.82	838,440,961	76.22	771,615,942	0.79
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	91,706	9,192.34	842,992,822	7,875.61	722,241,213	0.74
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	182,172	3,228.15	588,079,807	3,573.90	651,065,240	0.67
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	137,294	4,908.64	673,926,856	4,666.46	640,677,481	0.66
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	672,000	1,167.55	784,595,903	951.77	639,595,824	0.65
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	58,155	8,523.67	495,694,607	10,909.80	634,459,419	0.65
ケイマン	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	356,000	1,201.25	427,645,544	1,755.61	624,998,584	0.64
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	88,687	5,422.08	480,868,285	6,947.81	616,181,312	0.63
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	159,804	2,766.93	442,166,661	3,659.22	584,758,952	0.60

台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,319,248	328.75	433,707,686	435.34	574,324,063	0.59
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	543,013	712.13	386,699,759	1,017.50	552,515,728	0.57
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	13,066	29,415.83	384,347,269	42,060.15	549,557,920	0.56
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	631,765	516.74	326,459,977	857.74	541,893,055	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	28,591	15,931.04	455,484,490	18,291.39	522,969,400	0.54
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,405,800	370.00	520,150,780	364.93	513,020,000	0.53
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	268,967	1,369.41	368,327,180	1,818.08	489,003,913	0.50
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	42,826	9,687.14	414,861,833	11,047.54	473,121,991	0.48
韓国	株式	KAKAO CORP	メディア・娯楽	33,015	7,844.68	258,992,303	14,211.45	469,191,022	0.48
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	46,519	12,692.11	590,424,404	10,084.02	469,098,945	0.48
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	98,522	4,081.38	402,106,507	4,729.78	465,987,779	0.48
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,892	52,801.11	311,104,179	73,210.50	431,356,266	0.44

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.91
		素材	8.91
		資本財	2.71
		商業・専門サービス	0.28
		運輸	1.63
		自動車・自動車部品	3.62
		耐久消費財・アパレル	1.69
		消費者サービス	0.87
		メディア・娯楽	7.84
		小売	9.62
		食品・生活必需品小売り	1.13
		食品・飲料・タバコ	3.23
		家庭用品・パーソナル用品	0.99
		ヘルスケア機器・サービス	1.22
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.54
		銀行	12.84
		各種金融	2.23
保険	2.51		

	不動産	1.63
	ソフトウェア・サービス	2.55
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.74
	電気通信サービス	2.55
	公益事業	1.92
	半導体・半導体製造装置	9.01
	小計	96.16
投資信託受益証券		0.27
投資証券		0.09
合計		96.53

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	467	アメリカドル	31,048,939	3,399,548,331	30,126,170	3,298,514,353	3.38

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,100,000.00	120,703,000	120,435,810	0.12
	メキシコペソ	買建	7,000,000.00	38,549,000	38,553,900	0.04
	ユーロ	買建	200,000.00	26,018,760	26,022,580	0.03
	イギリスポンド	買建	20,000.00	3,054,940	3,055,122	0.00
	ハンガリーフォリント	買建	15,000,000.00	5,462,250	5,456,400	0.01
	ポーランドズロチ	買建	350,000.00	9,969,155	9,962,540	0.01
	香港ドル	買建	70,000,000.00	986,027,000	986,230,000	1.01
	南アフリカランド	買建	26,000,000.00	195,319,800	195,184,600	0.20
	アメリカドル	売建	11,000,000.00	1,204,289,900	1,204,358,100	1.23

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	中国	7,570,027,430	10.19
	インドネシア	7,220,165,991	9.72
	メキシコ	6,769,286,571	9.11
	タイ	6,404,231,028	8.62
	ポーランド	6,338,617,109	8.53
	ブラジル	6,214,740,375	8.36
	マレーシア	5,565,934,272	7.49
	ロシア	5,548,577,271	7.47
	南アフリカ	5,539,081,968	7.46
	コロンビア	3,400,091,679	4.58
	チェコ	3,093,840,736	4.16
	ハンガリー	2,919,786,794	3.93
	ペルー	1,598,041,847	2.15
	チリ	1,548,047,031	2.08
	トルコ	1,370,011,359	1.84
	ウルグアイ	96,319,402	0.13
	ドミニカ共和国	95,986,006	0.13
	フィリピン	84,562,793	0.11
		小計	71,377,349,662
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,921,070,803	3.93
合計(純資産総額)		74,298,420,465	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000	3.67	2,656,375,980	3.38	2,445,832,651	9.850	2027/6/28	3.29
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	1,802.76	1,660,346,756	1,776.54	1,636,195,774	0.000	2024/1/1	2.20
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	123,900,000	884.52	1,095,923,026	854.74	1,059,026,751	10.500	2026/12/21	1.43
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,864.42	954,584,884	1,855.71	950,126,820	0.000	2023/7/1	1.28

ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	39,550,000	2,351.15	929,881,439	2,216.55	876,647,855	10.000	2023/1/1	1.18
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000	2,837.71	773,277,756	2,716.26	740,182,779	3.885	2029/8/15	1.00
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	3,115.85	750,920,196	3,044.85	733,809,137	2.500	2026/7/25	0.99
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,438.84	775,553,771	2,248.97	715,175,000	10.000	2025/1/1	0.96
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000	2,449.16	769,037,987	2,259.51	709,486,790	10.000	2027/1/1	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000	653.06	763,433,151	606.68	709,220,073	8.500	2029/5/31	0.95
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,758.80	717,288,603	2,725.00	708,500,382	3.955	2025/9/15	0.95
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000	406.84	727,030,297	389.48	696,000,992	3.300	2038/6/17	0.94
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000	716.26	681,880,143	713.08	678,854,074	8.000	2030/1/31	0.91
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	21,550,000	3,202.35	690,108,140	3,132.92	675,144,536	2.750	2029/10/25	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	613.76	666,855,417	573.95	623,605,756	7.500	2027/6/3	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000	563.80	655,704,580	535.82	623,166,896	5.750	2026/3/5	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	655.98	657,622,045	613.81	615,348,894	10.000	2024/12/5	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	97,100,000	610.00	592,312,578	629.51	611,262,210	8.750	2048/2/28	0.82
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,685.61	613,663,982	2,650.96	605,745,699	3.480	2023/3/15	0.82
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	21,600,000,000	2.95	638,088,985	2.77	600,312,384	7.250	2034/10/18	0.81
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	3,001.18	597,236,051	2,943.51	585,759,784	2.500	2023/1/25	0.79
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000	1,694.24	576,044,799	1,712.22	582,156,023	2.940	2024/10/17	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000	569.26	590,332,049	556.27	576,852,296	6.500	2022/6/9	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	605.07	592,670,985	576.83	565,009,623	8.000	2023/12/7	0.76
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.5% 06/15/25	70,100,000,000	0.79	559,078,518	0.80	562,855,612	6.500	2025/6/15	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000	3,048.46	547,199,146	2,992.44	537,144,325	2.250	2024/10/25	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000	575.90	533,287,405	560.76	519,264,862	6.750	2023/3/9	0.70
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,652.91	504,140,233	1,695.18	517,030,251	2.850	2027/6/4	0.70
中国	国債証券	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000	1,708.57	502,321,961	1,723.13	506,601,241	3.190	2024/4/11	0.68
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	86,400,000	608.65	525,876,204	579.24	500,470,485	8.000	2024/9/5	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.07
合計	96.07

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	105,248,148,000	96.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,981,592,900	3.65
合計(純資産総額)		109,229,740,900	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,944,646,000	3.61

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,151	578,842.86	5,875,833,871	708,000	7,186,908,000	6.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,957	555,498.16	4,975,597,019	687,000	6,153,459,000	5.63
日本	投資証券	G L P 投資法人	29,008	156,119.11	4,528,703,142	196,500	5,700,072,000	5.22
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	14,190	331,039.03	4,697,443,835	366,000	5,193,540,000	4.75
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	45,191	85,589.79	3,867,888,199	114,500	5,174,369,500	4.74
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	28,964	137,733.58	3,989,315,411	174,100	5,042,632,400	4.62
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	12,779	246,816.89	3,154,073,037	326,000	4,165,954,000	3.81
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	17,846	161,051.56	2,874,126,139	209,000	3,729,814,000	3.41
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,955	307,805.18	2,756,395,386	373,500	3,344,692,500	3.06

日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,163	128,478.5	2,590,511,995	161,100	3,248,259,300	2.97
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	12,715	177,337.27	2,254,843,388	211,900	2,694,308,500	2.47
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	26,344	75,571.56	1,990,857,176	96,600	2,544,830,400	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,886	320,378.56	1,885,748,204	428,000	2,519,208,000	2.31
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,771	638,288.35	1,768,697,017	807,000	2,236,197,000	2.05
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	4,488	405,898.08	1,821,670,583	497,500	2,232,780,000	2.04
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	10,965	162,949.83	1,786,744,885	201,000	2,203,965,000	2.02
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,093	586,638.18	1,814,471,890	671,000	2,075,403,000	1.90
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,329	500,529.84	1,666,263,837	614,000	2,044,006,000	1.87
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,852	291,672.05	1,706,864,836	332,500	1,945,790,000	1.78
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	27,439	57,829.87	1,586,793,802	66,700	1,830,181,300	1.68
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	39,422	38,459.52	1,516,151,197	43,050	1,697,117,100	1.55
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,532	133,003.12	1,400,788,859	161,100	1,696,705,200	1.55
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,140	388,895.83	1,221,132,906	508,000	1,595,120,000	1.46
日本	投資証券	イオンリート投資法人	9,690	126,586.01	1,226,618,436	159,500	1,545,555,000	1.41
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,874	147,160.08	1,158,738,469	193,800	1,525,981,200	1.40
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,894	634,033.36	1,200,859,183	790,000	1,496,260,000	1.37
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,117	176,207.32	1,077,860,176	237,300	1,451,564,100	1.33
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,033	302,663.13	1,220,640,403	350,500	1,413,566,500	1.29
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	11,715	100,631.26	1,178,895,210	120,400	1,410,486,000	1.29
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	8,090	122,443.53	990,568,157	159,100	1,287,119,000	1.18

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.35
合計	96.35

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,836	円	3,807,313,200	3,944,646,000	3.61

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

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	68,689,501,526	72.33
	オーストラリア	6,003,808,490	6.32
	イギリス	5,076,119,765	5.34
	シンガポール	3,359,367,740	3.54
	フランス	2,062,385,572	2.17
	カナダ	1,780,991,178	1.88
	香港	1,366,141,601	1.44
	ベルギー	1,284,660,725	1.35
	スペイン	394,791,265	0.42
	ニュージーランド	391,985,333	0.41
	ドイツ	263,988,116	0.28
	ガーンジー	240,793,803	0.25
	オランダ	181,185,094	0.19
	韓国	161,635,280	0.17
	アイルランド	114,602,840	0.12
	イスラエル	61,936,924	0.07
イタリア	18,069,273	0.02	
	小計	91,451,964,525	96.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,520,816,148	3.71
合計(純資産総額)		94,972,780,673	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		19,707,678	0.02
	売建		3,131,524,090	3.30

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

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

### 投資資産



## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	398,739	10,965.42	4,372,342,001	14,002.67	5,583,413,065	5.88
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	48,266	81,371.87	3,927,494,827	86,100.74	4,155,738,616	4.38
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	81,967	24,467.73	2,005,546,449	34,140.07	2,798,359,683	2.95
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	151,595	15,142.46	2,295,522,284	16,477.15	2,497,853,569	2.63
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	176,855	8,763.57	1,549,882,870	13,786.98	2,438,296,489	2.57
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	224,691	7,340.20	1,649,279,035	9,605.55	2,158,282,365	2.27
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	75,099	18,165.48	1,364,209,825	25,173.94	1,890,537,780	1.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	185,046	6,544.21	1,210,981,234	9,248.62	1,711,420,192	1.80
オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	904,193	1,615.58	1,460,798,659	1,819.35	1,645,043,535	1.73
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73,754	17,269.85	1,273,721,085	21,870.62	1,613,046,261	1.70
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	200,847	6,759.91	1,357,708,166	7,688.38	1,544,189,624	1.63
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	71,850	11,798.64	847,732,456	19,022.79	1,366,787,648	1.44
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	305,031	3,053.67	931,465,875	4,449.67	1,357,288,388	1.43
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	201,564	5,161.35	1,040,344,085	6,529.98	1,316,209,614	1.39
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	61,496	13,878.95	853,500,057	21,132.66	1,299,574,361	1.37
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	60,066	15,039.54	903,365,394	21,419.52	1,286,585,411	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	34,915	27,992.21	977,348,131	36,197.39	1,263,832,012	1.33
香港	投資証券	LINK REIT	1,116,400	891.89	995,713,811	1,056.75	1,179,755,700	1.24
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	289,412	3,193.82	924,330,789	4,066.45	1,176,881,916	1.24
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	643,447	1,388.58	893,483,040	1,825.48	1,174,600,916	1.24
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	201,331	4,247.11	855,076,333	5,574.13	1,122,246,355	1.18
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	76,195	9,791.69	746,077,873	12,964.71	987,846,147	1.04
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	288,170	2,617.90	754,401,943	3,393.09	977,788,215	1.03
アメリカ	投資証券	UDR INC	159,237	4,215.36	671,242,076	6,086.54	969,203,819	1.02
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	52,356	10,926.00	572,042,028	16,286.63	852,703,193	0.90
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	95,394	7,339.11	700,107,508	8,809.56	840,379,682	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,869	6,438.01	585,015,713	9,119.42	828,672,767	0.87
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	154,632	2,978.12	460,513,889	4,756.24	735,467,770	0.77
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	314,946	2,117.53	666,909,682	2,280.67	718,290,004	0.76
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	74,571	5,670.19	422,832,022	9,488.92	707,598,425	0.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.29
合計	96.29

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	180,000.00	19,751,400	19,707,678	0.02
	アメリカドル	売建	21,950,000.00	2,403,086,000	2,403,219,895	2.53
	カナダドル	売建	700,000.00	61,479,600	61,484,640	0.06
	ユーロ	売建	1,150,000.00	149,609,250	149,630,985	0.16
	イギリスポンド	売建	1,050,000.00	160,383,300	160,392,540	0.17
	オーストラリアドル	売建	2,570,000.00	207,812,770	207,810,200	0.22
	香港ドル	売建	3,400,000.00	47,892,400	47,901,580	0.05
	シンガポールドル	売建	1,250,000.00	101,085,000	101,084,250	0.11

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

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

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	36,219,808,447	98.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		642,877,342	1.74
合計(純資産総額)		36,862,685,789	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		34,857,658,643	94.56

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益 証券	ISHARES GOLD TRUST	9,497,695	3,769.76	35,804,070,600	3,813.53	36,219,808,447	98.26

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.26
合計	98.26

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	318,380,722.00	35,067,639,740	34,857,658,643	94.56

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

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

## 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	18,867,492,000	99.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		156,126,682	0.82
合計(純資産総額)		19,023,618,682	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルラ ンド	社債券	STAR HEL IOS 0% 1 0 / 18 / 21	21,240,000,000	91.02	19,332,949,000	88.83	18,867,492,000	0.000	2021/10/18	99.18

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	99.18
合計	99.18

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2013年3月29日

作成基準日：2021年7月30日

**分散投資コア戦略ファンドA****基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 11,262円

純資産総額 807.61億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

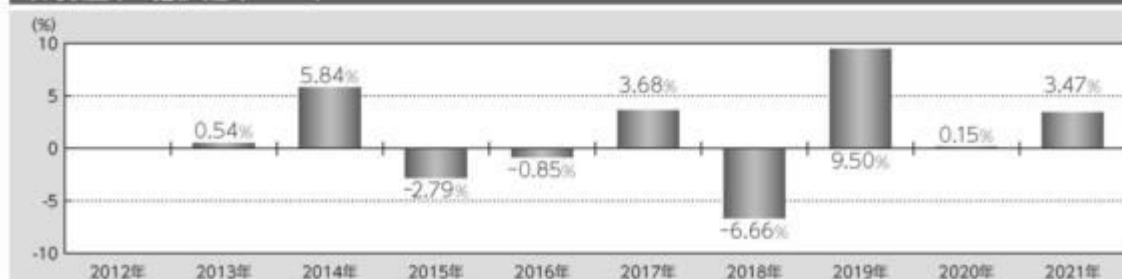
決算期	分配金
2017年7月	0円
2018年7月	0円
2019年7月	0円
2020年7月	0円
2021年7月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
国内債券インデックス マザーファンド	48.2%
外国株式インデックス マザーファンド	9.1%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	6.1%
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	5.0%
国内株式インデックス マザーファンド	4.6%
外国債券インデックス マザーファンド	4.5%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	4.0%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	2.8%
FOFs 用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	2.5%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

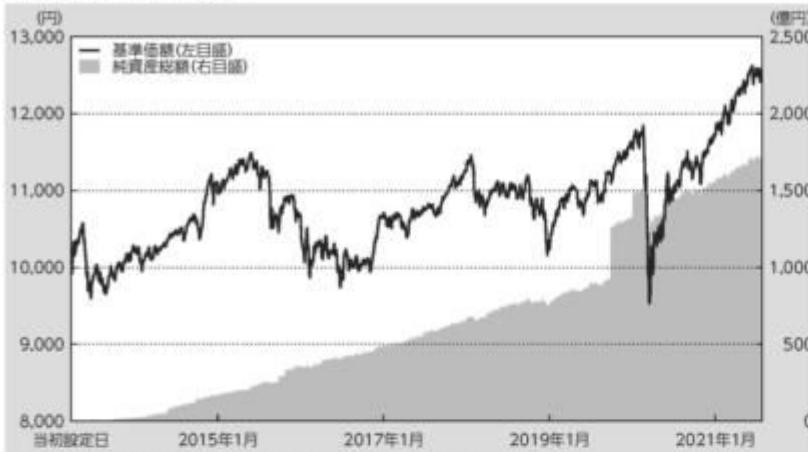
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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

当初設定日：2013年3月29日  
作成基準日：2021年7月30日

## 分散投資コア戦略ファンドS

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	12,552円
純資産総額	1,722.55億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年7月	0円
2018年7月	0円
2019年7月	0円
2020年7月	0円
2021年7月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

### 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内債券インデックス マザーファンド	23.4%
外国株式インデックス マザーファンド	21.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	8.9%
国内株式インデックス マザーファンド	7.6%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	6.4%
FOFs 用ビクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	5.1%
FOFs 用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	5.1%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	4.6%
外国債券インデックス マザーファンド	4.4%
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	3.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

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

#### <一部解約の受付>

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

#### <一部解約単位>

1口以上1口単位とします。

#### <解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### <一部解約代金の支払い>

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



益者に支払われます。

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

#### < 一部解約の制限 >

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

#### < その他 >

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

#### < お問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3 【資産管理等の概要】

## （１）【資産の評価】

### < 基準価額の算出方法 >

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

### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

#### イ．内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

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

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

#### ハ．外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

#### ニ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

#### ホ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

##### （イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

##### （ロ）外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

##### （ハ）公社債等（仕組債を含みます。）

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

##### （ニ）株価指数先物取引

原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。

##### （ホ）債券先物取引

原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。

#### ヘ．外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値

によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （２）【保管】

該当事項はありません。

#### （３）【信託期間】

無期限とします。（2013年 3月29日設定）

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

#### （４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年3月29日から2013年7月10日までとします。

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

#### （５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監

監督官庁に届け出ます。

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【分散投資コア戦略ファンドA】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2020年7月11日から2021年7月12日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,123,987,678	1,114,065,007
投資信託受益証券	14,744,342,622	14,319,904,876
親投資信託受益証券	54,186,198,764	65,461,331,316
流動資産合計	70,054,529,064	80,895,301,199
資産合計	70,054,529,064	80,895,301,199
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	74,434,868	52,193,497
未払受託者報酬	18,435,865	21,401,889
未払委託者報酬	350,281,418	406,635,814
未払利息	603	1,700
その他未払費用	925,719	958,417
流動負債合計	444,078,473	481,191,317
負債合計	444,078,473	481,191,317
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,927,087,140	71,401,600,740
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,683,363,451	9,012,509,142
(分配準備積立金)	1,670,486,402	6,329,338,397
元本等合計	69,610,450,591	80,414,109,882
純資産合計	69,610,450,591	80,414,109,882
負債純資産合計	70,054,529,064	80,895,301,199



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第8期		第9期	
	自	2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	自	2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
営業収益				
受取配当金		14,330,292		43,757,441
受取利息		4,192		2,939
有価証券売買等損益		159,361,592		6,705,618,587
その他収益		2,454		-
営業収益合計		145,024,654		6,749,378,967
営業費用				
支払利息		567,806		504,002
受託者報酬		36,536,972		41,527,168
委託者報酬		694,202,435		789,016,051
その他費用		1,847,656		1,908,149
営業費用合計		733,154,869		832,955,370
営業利益又は営業損失 ( )		878,179,523		5,916,423,597
経常利益又は経常損失 ( )		878,179,523		5,916,423,597
当期純利益又は当期純損失 ( )		878,179,523		5,916,423,597
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 ( )		56,917,522		232,572,390
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		3,249,425,140		2,683,363,451
剰余金増加額又は欠損金減少額		496,053,377		834,856,459
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		496,053,377		834,856,459
剰余金減少額又は欠損金増加額		240,853,065		189,561,975
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		240,853,065		189,561,975
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		2,683,363,451		9,012,509,142

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
3. その他	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第9期計算期間は2020年 7月11日から2021年 7月12日までとなっております。

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,927,087,140口	71,401,600,740口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0401円 (1万口当たり純資産額) (10,401円)	1口当たり純資産額 1.1262円 (1万口当たり純資産額) (11,262円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日																								
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>160,569,902円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,331,882,584円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	160,569,902円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	2,331,882,584円	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>681,382,091円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>4,082,181,964円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,709,230,297円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	681,382,091円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,082,181,964円	収益調整金額	C	2,709,230,297円
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	160,569,902円																							
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																							
収益調整金額	C	2,331,882,584円																							
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	681,382,091円																							
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,082,181,964円																							
収益調整金額	C	2,709,230,297円																							

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日			第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日		
分配準備積立金額	D	1,509,916,500円	分配準備積立金額	D	1,565,774,342円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,002,368,986円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,038,568,694円
当ファンドの期末残存口数	F	66,927,087,140口	当ファンドの期末残存口数	F	71,401,600,740口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	598円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,265円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2021年 7月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第9期 (2021年 7月12日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	第8期	第9期
	自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	60,956,592,774円	66,927,087,140円
期中追加設定元本額	10,458,038,852円	8,942,057,064円
期中一部解約元本額	4,487,544,486円	4,467,543,464円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	第8期	第9期
	(2020年 7月10日現在)	(2021年 7月12日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	12,942,309	771,204,715
親投資信託受益証券	106,470,866	4,336,500,166

合計	93,528,557	5,107,704,881
----	------------	---------------

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	2,762,660,495	3,254,414,063	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	4,009,641,839	4,082,617,320	
	FOFs用ピクテマルチストラテジーリンクファンド(適格機関投資家専用)	4,626,462,532	4,981,312,208	
	FOFs用MAN AHLダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	1,778,533,220	2,001,561,285	
投資信託受益証券合計		13,177,298,086	14,319,904,876	
親投資信託受益証券	J-REITインデックスマザーファンド	410,633,592	941,049,002	
	グローバルREITインデックスマザーファンド	345,347,104	786,942,445	
	新興国株式インデックスマザーファンド	266,983,353	992,270,329	
	国内株式インデックスマザーファンド	2,004,794,091	3,781,843,573	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,876,550,513	7,290,211,087	
	国内債券インデックスマザーファンド	27,289,857,382	38,563,297,466	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,164,439,715	3,583,213,890	
	新興国債券インデックスマザーファンド	224,890,391	396,211,890	
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	3,137,168,962	3,966,636,435	
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	948,216,705	1,095,948,867	
	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	1,549,734,376	2,249,904,367	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	2,026,367,965	1,813,801,965	
親投資信託受益証券合計		41,244,984,149	65,461,331,316	
合計			79,781,236,192	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【分散投資コア戦略ファンドS】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2020年7月11日から2021年7月12日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,130,198,771	2,648,918,734
投資信託受益証券	24,000,586,111	26,035,961,567
親投資信託受益証券	117,939,941,294	143,931,416,850
流動資産合計	144,070,726,176	172,616,297,151
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	149,636,121	244,208,892
未払受託者報酬	38,129,953	45,233,071
未払委託者報酬	724,469,024	859,428,294
未払利息	1,143	4,042
その他未払費用	1,126,339	1,196,738
流動負債合計	913,362,580	1,150,071,037
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	130,381,111,649	136,583,457,227
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	12,776,251,947	34,882,768,887
(分配準備積立金)	3,697,416,615	20,563,834,888
元本等合計	143,157,363,596	171,466,226,114
純資産合計	143,157,363,596	171,466,226,114
負債純資産合計	144,070,726,176	172,616,297,151

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日		自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	
営業収益				
受取配当金		8,936,667		52,860,248
受取利息		7,619		7,356
有価証券売買等損益		1,252,796,222		22,645,644,567
その他収益		5,173		-
営業収益合計		1,243,846,763		22,698,512,171
営業費用				
支払利息		1,018,444		1,122,753
受託者報酬		68,822,487		86,764,433
委託者報酬		1,307,627,055		1,648,524,134
その他費用		2,174,288		2,360,527
営業費用合計		1,379,642,274		1,738,771,847
営業利益又は営業損失（ ）		2,623,489,037		20,959,740,324
経常利益又は経常損失（ ）		2,623,489,037		20,959,740,324
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,623,489,037		20,959,740,324
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（ ）		280,571,491		944,909,202
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,953,685,125		12,776,251,947
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,393,666,645		3,231,342,205
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,393,666,645		3,231,342,205
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,228,182,277		1,139,656,387
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,228,182,277		1,139,656,387
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,776,251,947		34,882,768,887



## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
3. その他	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第9期計算期間は2020年 7月11日から2021年 7月12日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	130,381,111,649口	136,583,457,227口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0980円 (10,980円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2554円 (12,554円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日																								
分配金の計算過程	分配金の計算過程																								
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>757,182,943円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,078,835,332円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	757,182,943円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	9,078,835,332円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,781,811,259円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>15,383,662,849円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>14,318,933,999円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,781,811,259円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	15,383,662,849円	収益調整金額	C	14,318,933,999円
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	757,182,943円																							
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																							
収益調整金額	C	9,078,835,332円																							
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	1,781,811,259円																							
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	15,383,662,849円																							
収益調整金額	C	14,318,933,999円																							

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日			第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日		
分配準備積立金額	D	2,940,233,672円	分配準備積立金額	D	3,398,360,780円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,776,251,947円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	34,882,768,887円
当ファンドの期末残存口数	F	130,381,111,649口	当ファンドの期末残存口数	F	136,583,457,227口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	979円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,553円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2021年 7月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第9期 (2021年 7月12日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	80,710,071,123円	130,381,111,649円
期中追加設定元本額	60,254,110,229円	17,432,745,205円
期中一部解約元本額	10,583,069,703円	11,230,399,627円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	12,572,069	1,761,857,531
親投資信託受益証券	296,502,407	17,124,998,757

合計	283,930,338	18,886,856,288
----	-------------	----------------

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	2,971,680,001	3,500,639,041	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5,027,202,853	5,118,697,944	
	FOFs用ピクテマルチストラテジーリンクファンド(適格機関投資家専用)	8,217,875,003	8,848,186,015	
	FOFs用MAN AHLダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	7,613,682,751	8,568,438,567	
投資信託受益証券合計		23,830,440,608	26,035,961,567	
親投資信託受益証券	J-REITインデックスマザーファンド	823,636,982	1,887,528,871	
	グローバルREITインデックスマザーファンド	767,067,340	1,747,916,347	
	新興国株式インデックスマザーファンド	1,326,986,681	4,931,878,698	
	国内株式インデックスマザーファンド	7,145,826,516	13,479,887,139	
	外国株式インデックスマザーファンド	9,350,780,542	36,326,847,327	
	国内債券インデックスマザーファンド	27,893,146,983	39,415,806,001	
	外国債券インデックスマザーファンド	2,447,192,293	7,530,500,124	
	新興国債券インデックスマザーファンド	482,336,271	849,780,042	
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	12,026,495,095	15,206,300,398	
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	3,126,143,390	3,613,196,530	
	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	7,499,598,114	10,887,916,541	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	8,997,719,621	8,053,858,832	
親投資信託受益証券合計		81,886,929,828	143,931,416,850	
合計			169,967,378,417	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,036,524,443
株式	470,454,256,330
派生商品評価勘定	12,344,400
未収入金	45,360,000
未収配当金	577,542,549
差入委託証拠金	148,229,200
流動資産合計	474,274,256,922
資産合計	474,274,256,922
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,783,650
前受金	9,593,200
未払金	22,430,051
未払解約金	580,835,014
未払利息	4,633
流動負債合計	615,646,548
負債合計	615,646,548
純資産の部	
元本等	
元本	251,095,419,520
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	222,563,190,854
元本等合計	473,658,610,374
純資産合計	473,658,610,374
負債純資産合計	474,274,256,922

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2021年 7月12日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	251,095,419,520口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8864円 (1万口当たり純資産額) (18,864円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2021年 7月12日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	217,285,082,423円
期中追加設定元本額	82,161,229,057円
期中一部解約元本額	48,350,891,960円
期末元本額	251,095,419,520円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	424,283,019円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,876,273,577円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,736,963円
S M T T O P I X インデックス・オープン	10,649,883,524円
世界経済インデックスファンド	2,822,073,484円
日本株式インデックス・オープン	3,539,191,471円
D C マイセレクション 2 5	6,087,143,675円
D C マイセレクション 5 0	18,004,570,102円
D C マイセレクション 7 5	17,667,305,362円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,812,599,819円
D C マイセレクション S 2 5	2,953,579,919円
D C マイセレクション S 5 0	8,433,783,508円
D C マイセレクション S 7 5	6,024,260,455円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,695,131,908円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	252,406,297円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	683,382,112円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	481,050,238円
D C 世界経済インデックスファンド	3,246,862,263円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,547,256,898円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,195,294円



区分	2021年 7月12日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	26,725,162円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,457,639円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	197,410,242円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	48,505,703円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	169,859,479円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,037,864円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	96,601,348円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,147,888,465円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	480,637,604円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,052,300,259円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	224,991,134円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	28,726,222円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	551,680,127円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	317,581,585円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	398,555,983円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	41,816,544円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	646,457,353円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,796,671,426円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,961,744,624円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,492,806,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,088,522,067円
分散投資コア戦略ファンドA	2,004,794,091円
分散投資コア戦略ファンドS	7,145,826,516円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	418,281,188円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	392,521,843円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,042,957,008円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,246,216円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,357,359円
SMT インデックスバランス・オープン	59,761,332円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	24,692,828,613円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	604,397,930円
SMT 世界経済インデックス・オープン	35,074,403円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	118,270,617円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	21,455,096円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,106,757円
グローバル経済コア	235,284,349円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,575,482円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	62,537,046円
DCターゲット・イヤーフンド2055	18,037,076円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,178,861,159円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	134,932,760円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	4,291,324円

区分	2021年 7月12日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2,896,942円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,352,118円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,188,065円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,618,131,726円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,180,760,727円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	167,958,933円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	27,254,880円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,638,172,549円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	7,226,127,298	
合計	7,226,127,298	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,130,711,800	-	3,140,305,000	9,593,200
	合計	3,130,711,800	-	3,140,305,000	9,593,200

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

	評価額

銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	7,700	2,912.00	22,422,400	
日本水産	221,300	537.00	118,838,100	
マルハニチロ	37,300	2,379.00	88,736,700	
雪国まいたけ	19,600	1,682.00	32,967,200	
カネコ種苗	7,200	1,467.00	10,562,400	
サカタのタネ	28,400	3,755.00	106,642,000	
ホクト	20,000	1,937.00	38,740,000	
ホクリヨウ	3,700	823.00	3,045,100	
住石ホールディングス	41,700	128.00	5,337,600	
日鉄鉱業	5,500	5,910.00	32,505,000	
三井松島ホールディングス	10,000	1,015.00	10,150,000	
I N P E X	876,600	813.00	712,675,800	
石油資源開発	31,100	1,912.00	59,463,200	
K & O エナジーグループ	11,600	1,319.00	15,300,400	
ヒノキヤグループ	5,900	2,383.00	14,059,700	
ショーボンドホールディングス	34,000	4,740.00	161,160,000	
ミライト・ホールディングス	82,600	2,073.00	171,229,800	
タマホーム	14,400	2,336.00	33,638,400	
サンヨーホームズ	2,800	721.00	2,018,800	
日本アクア	9,500	536.00	5,092,000	
ファーストコーポレーション	7,300	786.00	5,737,800	
ベステラ	4,600	1,470.00	6,762,000	
Robot Home	44,700	232.00	10,370,400	
キャンディル	4,100	582.00	2,386,200	
スペースバリューホールディングス	29,100	740.00	21,534,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,180.00	5,428,000	
第一カッター興業	5,900	1,350.00	7,965,000	
安藤・間	152,800	860.00	131,408,000	
東急建設	69,800	813.00	56,747,400	
コムシスホールディングス	84,500	3,085.00	260,682,500	
ピーアールホールディングス	31,900	477.00	15,216,300	
高松コンストラクショングループ	14,800	2,049.00	30,325,200	
東建コーポレーション	7,300	10,340.00	75,482,000	
ソネック	2,500	1,016.00	2,540,000	
ヤマウラ	10,400	911.00	9,474,400	
オリエンタル白石	80,100	281.00	22,508,100	
大成建設	171,300	3,790.00	649,227,000	
大林組	550,500	914.00	503,157,000	
清水建設	515,600	891.00	459,399,600	
飛鳥建設	15,800	1,089.00	17,206,200	
長谷工コーポレーション	180,300	1,506.00	271,531,800	

松井建設	21,700	798.00	17,316,600
銭高組	2,400	4,065.00	9,756,000
鹿島建設	403,300	1,439.00	580,348,700
不動テトラ	13,500	1,850.00	24,975,000
大末建設	6,900	987.00	6,810,300
鉄建建設	11,100	1,894.00	21,023,400
西松建設	39,400	3,660.00	144,204,000
三井住友建設	133,000	492.00	65,436,000
大豊建設	12,100	4,275.00	51,727,500
前田建設工業	137,900	973.00	134,176,700
佐田建設	12,700	482.00	6,121,400
ナカノフドー建設	13,200	422.00	5,570,400
奥村組	30,300	2,979.00	90,263,700
東鉄工業	23,600	2,363.00	55,766,800
イチケン	4,000	1,868.00	7,472,000
富士ピー・エス	7,100	550.00	3,905,000
浅沼組	6,600	4,685.00	30,921,000
戸田建設	228,600	774.00	176,936,400
熊谷組	25,500	2,854.00	72,777,000
北野建設	3,400	2,333.00	7,932,200
植木組	4,900	1,456.00	7,134,400
矢作建設工業	24,300	731.00	17,763,300
ピーエス三菱	18,100	619.00	11,203,900
日本ハウスホールディングス	37,600	404.00	15,190,400
大東建託	60,100	13,060.00	784,906,000
新日本建設	23,400	859.00	20,100,600
N I P P O	45,500	3,140.00	142,870,000
東亜道路工業	3,400	4,635.00	15,759,000
前田道路	34,000	2,205.00	74,970,000
日本道路	5,300	8,000.00	42,400,000
東亜建設工業	14,700	2,497.00	36,705,900
日本国土開発	53,500	585.00	31,297,500
若築建設	9,900	1,672.00	16,552,800
東洋建設	61,700	580.00	35,786,000
五洋建設	233,800	772.00	180,493,600
世紀東急工業	26,400	873.00	23,047,200
福田組	6,400	4,940.00	31,616,000
住友林業	140,800	2,037.00	286,809,600
日本基礎技術	16,800	572.00	9,609,600
巴コーポレーション	24,400	381.00	9,296,400
大和ハウス工業	508,300	3,381.00	1,718,562,300
ライト工業	31,500	1,905.00	60,007,500

積水ハウス	597,000	2,293.00	1,368,921,000
日特建設	14,200	770.00	10,934,000
北陸電気工事	9,500	1,295.00	12,302,500
ユアテック	31,500	737.00	23,215,500
日本リーテック	11,500	1,685.00	19,377,500
四電工	3,000	3,005.00	9,015,000
中電工	25,300	2,301.00	58,215,300
関電工	89,500	895.00	80,102,500
きんでん	111,800	1,836.00	205,264,800
東京エネシス	18,300	959.00	17,549,700
トーエネック	5,500	3,785.00	20,817,500
住友電設	15,500	2,307.00	35,758,500
日本電設工業	30,200	1,936.00	58,467,200
協和エクシオ	83,500	2,747.00	229,374,500
新日本空調	14,600	2,112.00	30,835,200
九電工	38,600	3,645.00	140,697,000
三機工業	39,000	1,448.00	56,472,000
日揮ホールディングス	183,600	1,028.00	188,740,800
中外炉工業	6,000	1,933.00	11,598,000
ヤマト	17,600	816.00	14,361,600
太平電業	12,200	2,677.00	32,659,400
高砂熱学工業	49,800	1,918.00	95,516,400
三晃金属工業	2,200	2,375.00	5,225,000
朝日工業社	4,100	3,210.00	13,161,000
明星工業	35,600	745.00	26,522,000
大気社	26,800	3,415.00	91,522,000
ダイダン	12,200	2,618.00	31,939,600
日比谷総合設備	17,700	1,838.00	32,532,600
フィル・カンパニー	3,100	2,695.00	8,354,500
テスホールディングス	10,000	2,084.00	20,840,000
東洋エンジニアリング	23,100	722.00	16,678,200
レイズネクスト	29,500	1,181.00	34,839,500
ニッポン	51,500	1,582.00	81,473,000
日清製粉グループ本社	199,000	1,674.00	333,126,000
日東富士製粉	1,300	6,930.00	9,009,000
昭和産業	14,800	3,045.00	45,066,000
鳥越製粉	15,600	791.00	12,339,600
中部飼料	21,500	1,153.00	24,789,500
フィード・ワン	23,700	745.00	17,656,500
東洋精糖	3,000	1,198.00	3,594,000
日本甜菜製糖	9,200	1,659.00	15,262,800
D M三井製糖ホールディングス	13,900	1,864.00	25,909,600

塩水港精糖	21,000	222.00	4,662,000
日新製糖	8,300	1,703.00	14,134,900
森永製菓	41,300	3,675.00	151,777,500
中村屋	4,200	3,840.00	16,128,000
江崎グリコ	48,500	4,215.00	204,427,500
名糖産業	7,800	1,591.00	12,409,800
井村屋グループ	10,000	2,335.00	23,350,000
不二家	11,200	2,222.00	24,886,400
山崎製パン	132,000	1,551.00	204,732,000
第一屋製パン	3,400	939.00	3,192,600
モロゾフ	2,800	5,350.00	14,980,000
亀田製菓	10,000	4,595.00	45,950,000
寿スピリッツ	17,000	7,700.00	130,900,000
カルビー	80,300	2,578.00	207,013,400
森永乳業	32,600	5,980.00	194,948,000
六甲バター	11,700	1,533.00	17,936,100
ヤクルト本社	121,200	6,460.00	782,952,000
明治ホールディングス	116,500	6,800.00	792,200,000
雪印メグミルク	42,400	2,092.00	88,700,800
プリマハム	24,800	2,976.00	73,804,800
日本ハム	67,300	4,325.00	291,072,500
林兼産業	5,800	582.00	3,375,600
丸大食品	17,300	1,729.00	29,911,700
S Foods	15,800	3,355.00	53,009,000
柿安本店	6,100	2,509.00	15,304,900
伊藤ハム米久ホールディングス	113,400	731.00	82,895,400
サッポロホールディングス	60,100	2,344.00	140,874,400
アサヒグループホールディングス	384,900	5,106.00	1,965,299,400
キリンホールディングス	747,100	2,111.50	1,577,501,650
宝ホールディングス	130,600	1,368.00	178,660,800
オエノンホールディングス	50,000	378.00	18,900,000
養命酒製造	5,400	1,823.00	9,844,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	134,900	1,749.00	235,940,100
サントリー食品インターナショナル	117,900	4,155.00	489,874,500
ダイドーグループホールディングス	9,900	5,000.00	49,500,000
伊藤園	53,500	6,650.00	355,775,000
キーコーヒー	17,300	2,136.00	36,952,800
ユニカフェ	5,300	996.00	5,278,800
ジャパンフーズ	2,500	1,225.00	3,062,500
日清オイリオグループ	22,200	3,060.00	67,932,000
不二製油グループ本社	42,900	2,540.00	108,966,000
かどや製油	1,900	4,080.00	7,752,000

J - オイルミルズ	16,400	1,863.00	30,553,200
キッコーマン	126,800	7,110.00	901,548,000
味の素	419,000	2,879.50	1,206,510,500
ブルドックソース	8,000	2,355.00	18,840,000
キューピー	98,100	2,486.00	243,876,600
ハウス食品グループ本社	65,900	3,450.00	227,355,000
カゴメ	72,000	2,899.00	208,728,000
焼津水産化学工業	8,500	964.00	8,194,000
アリアケジャパン	16,100	7,030.00	113,183,000
ピエトロ	2,300	1,721.00	3,958,300
エバラ食品工業	3,900	2,634.00	10,272,600
やまみ	1,900	1,921.00	3,649,900
ニチレイ	83,900	2,951.00	247,588,900
東洋水産	90,600	4,235.00	383,691,000
イトアンドホールディングス	6,100	1,955.00	11,925,500
大冷	2,000	2,004.00	4,008,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,900	742.00	7,345,800
日清食品ホールディングス	69,100	7,920.00	547,272,000
永谷園ホールディングス	8,600	2,169.00	18,653,400
一正蒲鉾	6,800	932.00	6,337,600
フジッコ	19,100	1,930.00	36,863,000
ロック・フィールド	19,000	1,523.00	28,937,000
日本たばこ産業	944,600	2,120.00	2,002,552,000
ケンコーマヨネーズ	10,800	1,548.00	16,718,400
わらべや日洋ホールディングス	11,500	2,380.00	27,370,000
なとり	9,800	1,941.00	19,021,800
イフジ産業	2,700	954.00	2,575,800
ピククルスコーポレーション	4,200	3,425.00	14,385,000
ファーマフーズ	16,600	2,960.00	49,136,000
北の達人コーポレーション	61,500	478.00	29,397,000
ユーグレナ	89,700	1,073.00	96,248,100
紀文食品	10,300	1,331.00	13,709,300
ミヨシ油脂	6,200	1,278.00	7,923,600
理研ビタミン	16,600	1,597.00	26,510,200
片倉工業	23,400	1,490.00	34,866,000
ゲンゼ	12,700	4,670.00	59,309,000
東洋紡	68,300	1,319.00	90,087,700
ユニチカ	51,700	336.00	17,371,200
富士紡ホールディングス	8,400	3,870.00	32,508,000
倉敷紡績	15,900	1,958.00	31,132,200
シキボウ	9,700	942.00	9,137,400
日本毛織	57,100	981.00	56,015,100

トーア紡コーポレーション	6,800	444.00	3,019,200
帝国繊維	19,600	2,115.00	41,454,000
帝人	162,100	1,649.00	267,302,900
東レ	1,245,400	723.00	900,424,200
サカイオーベックス	4,700	3,100.00	14,570,000
住江織物	3,800	2,039.00	7,748,200
日本フェルト	10,800	442.00	4,773,600
イチカワ	2,600	1,346.00	3,499,600
日東製網	1,800	1,524.00	2,743,200
アツギ	13,600	622.00	8,459,200
ダイニック	6,500	754.00	4,901,000
セーレン	42,500	2,163.00	91,927,500
ソトー	7,100	804.00	5,708,400
東海染工	2,400	1,138.00	2,731,200
小松マテーレ	28,500	929.00	26,476,500
ワコールホールディングス	43,000	2,544.00	109,392,000
ホギメディカル	23,200	3,455.00	80,156,000
T S Iホールディングス	52,800	379.00	20,011,200
マツオカコーポレーション	5,600	1,658.00	9,284,800
ワールド	22,600	1,463.00	33,063,800
三陽商会	8,900	1,061.00	9,442,900
ナイガイ	6,900	343.00	2,366,700
オンワードホールディングス	103,900	352.00	36,572,800
ルックホールディングス	6,000	1,440.00	8,640,000
ゴールドウイン	28,500	6,300.00	179,550,000
デサント	29,400	2,982.00	87,670,800
キング	9,600	483.00	4,636,800
ヤマトインターナショナル	15,700	341.00	5,353,700
特種東海製紙	10,600	4,525.00	47,965,000
王子ホールディングス	773,900	642.00	496,843,800
日本製紙	76,000	1,253.00	95,228,000
三菱製紙	24,400	352.00	8,588,800
北越コーポレーション	123,000	600.00	73,800,000
中越パルプ工業	6,500	1,271.00	8,261,500
巴川製紙所	5,700	797.00	4,542,900
大王製紙	82,900	1,838.00	152,370,200
阿波製紙	4,400	402.00	1,768,800
レンゴー	177,300	916.00	162,406,800
トーモク	10,500	1,937.00	20,338,500
ザ・パック	13,000	2,754.00	35,802,000
クラレ	270,700	1,018.00	275,572,600
旭化成	1,139,400	1,210.50	1,379,243,700



共和レザー	9,300	716.00	6,658,800
昭和電工	130,500	3,265.00	426,082,500
住友化学	1,353,200	571.00	772,677,200
住友精化	8,400	3,680.00	30,912,000
日産化学	94,200	5,350.00	503,970,000
ラサ工業	5,600	1,846.00	10,337,600
クレハ	14,700	6,650.00	97,755,000
多木化学	6,700	5,210.00	34,907,000
テイカ	12,600	1,310.00	16,506,000
石原産業	30,800	1,115.00	34,342,000
片倉コープアグリ	4,400	1,214.00	5,341,600
日本曹達	24,000	3,240.00	77,760,000
東ソー	265,700	1,995.00	530,071,500
トクヤマ	51,100	2,266.00	115,792,600
セントラル硝子	32,800	2,157.00	70,749,600
東亜合成	104,900	1,153.00	120,949,700
大阪ソーダ	17,500	2,424.00	42,420,000
関東電化工業	40,800	1,007.00	41,085,600
デンカ	62,700	3,700.00	231,990,000
信越化学工業	317,900	18,310.00	5,820,749,000
日本カーバイド工業	6,300	1,291.00	8,133,300
堺化学工業	12,000	1,871.00	22,452,000
第一稀元素化学工業	17,300	1,793.00	31,018,900
エア・ウォーター	175,300	1,659.00	290,822,700
日本酸素ホールディングス	141,600	2,359.00	334,034,400
日本化学工業	4,900	3,135.00	15,361,500
東邦アセチレン	2,600	1,187.00	3,086,200
日本パーカライジング	86,700	1,136.00	98,491,200
高压ガス工業	27,300	676.00	18,454,800
チタン工業	2,100	1,858.00	3,901,800
四国化成工業	22,800	1,319.00	30,073,200
戸田工業	3,700	2,649.00	9,801,300
ステラ ケミファ	9,400	2,839.00	26,686,600
保土谷化学工業	5,000	3,955.00	19,775,000
日本触媒	31,100	5,280.00	164,208,000
大日精化工業	14,200	2,325.00	33,015,000
カネカ	44,500	4,530.00	201,585,000
三菱瓦斯化学	172,200	2,341.00	403,120,200
三井化学	148,400	3,680.00	546,112,000
J S R	172,500	3,565.00	614,962,500
東京応化工業	29,500	7,170.00	211,515,000
大阪有機化学工業	15,900	3,730.00	59,307,000

三菱ケミカルホールディングス	1,149,200	942.30	1,082,891,160
KHネオケム	28,300	2,556.00	72,334,800
ダイセル	231,100	928.00	214,460,800
住友ベークライト	27,000	4,895.00	132,165,000
積水化学工業	359,800	1,918.00	690,096,400
日本ゼオン	155,000	1,482.00	229,710,000
アイカ工業	47,900	3,915.00	187,528,500
宇部興産	86,800	2,237.00	194,171,600
積水樹脂	28,100	2,148.00	60,358,800
タキロンシーアイ	37,200	602.00	22,394,400
旭有機材	9,700	1,356.00	13,153,200
ニチバン	9,000	1,775.00	15,975,000
リケンテクノス	41,900	589.00	24,679,100
大倉工業	8,100	2,442.00	19,780,200
積水化成成品工業	23,000	610.00	14,030,000
群栄化学工業	3,900	2,491.00	9,714,900
タイガースポリマー	9,000	479.00	4,311,000
ミライアル	5,500	1,283.00	7,056,500
ダイキアクシス	6,600	841.00	5,550,600
ダイキョーニシカワ	36,200	700.00	25,340,000
竹本容器	6,100	993.00	6,057,300
森六ホールディングス	9,200	2,294.00	21,104,800
恵和	3,400	3,485.00	11,849,000
日本化薬	106,400	1,093.00	116,295,200
カーリットホールディングス	17,000	746.00	12,682,000
日本精化	12,400	1,607.00	19,926,800
扶桑化学工業	13,500	4,255.00	57,442,500
トリケミカル研究所	15,900	3,140.00	49,926,000
ADEKA	79,100	2,123.00	167,929,300
日油	64,700	5,780.00	373,966,000
新日本理化	28,400	269.00	7,639,600
ハリマ化成グループ	12,800	885.00	11,328,000
花王	420,300	6,802.00	2,858,880,600
第一工業製薬	5,800	3,220.00	18,676,000
石原ケミカル	4,300	2,154.00	9,262,200
日華化学	5,800	1,329.00	7,708,200
ニイタカ	3,600	2,091.00	7,527,600
三洋化成工業	10,300	5,370.00	55,311,000
有機合成薬品工業	13,200	386.00	5,095,200
大日本塗料	19,400	857.00	16,625,800
日本ペイントホールディングス	709,200	1,381.00	979,405,200
関西ペイント	193,100	2,783.00	537,397,300

神東塗料	13,500	193.00	2,605,500	
中国塗料	41,400	872.00	36,100,800	
日本特殊塗料	12,900	1,110.00	14,319,000	
藤倉化成	23,200	515.00	11,948,000	
太陽ホールディングス	12,600	5,120.00	64,512,000	
D I C	72,600	2,763.00	200,593,800	
サカタインクス	37,500	1,020.00	38,250,000	
東洋インキＳＣホールディングス	36,300	1,965.00	71,329,500	
T & K T O K A	12,000	853.00	10,236,000	
富士フィルムホールディングス	308,500	8,190.00	2,526,615,000	
資生堂	348,800	8,000.00	2,790,400,000	
ライオン	228,200	1,973.00	450,238,600	
高砂香料工業	11,000	2,708.00	29,788,000	
マンダム	36,800	1,989.00	73,195,200	
ミルボン	23,500	6,180.00	145,230,000	
ファンケル	63,900	3,570.00	228,123,000	
コーセー	33,000	17,580.00	580,140,000	
コタ	11,100	1,414.00	15,695,400	
シーボン	2,300	1,978.00	4,549,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	74,900	2,878.00	215,562,200	
ノエビアホールディングス	14,900	5,660.00	84,334,000	
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,036.00	4,040,400	
新日本製薬	4,800	2,085.00	10,008,000	
エステー	11,300	1,721.00	19,447,300	
アグロ カネショウ	6,600	1,409.00	9,299,400	
コニシ	28,800	1,615.00	46,512,000	
長谷川香料	30,300	2,514.00	76,174,200	
星光P M C	10,100	935.00	9,443,500	
小林製薬	49,200	9,390.00	461,988,000	
荒川化学工業	14,600	1,190.00	17,374,000	
メック	12,000	3,320.00	39,840,000	
日本高純度化学	4,800	2,901.00	13,924,800	
タカラバイオ	45,900	2,913.00	133,706,700	
J C U	19,700	3,725.00	73,382,500	
新田ゼラチン	11,000	635.00	6,985,000	
O A T アグリオ	3,300	1,401.00	4,623,300	
デクセリアルズ	49,100	2,379.00	116,808,900	
アース製薬	13,200	6,470.00	85,404,000	
北興化学工業	16,300	1,075.00	17,522,500	
大成ラミック	5,400	2,748.00	14,839,200	
クミアイ化学工業	72,600	854.00	62,000,400	
日本農薬	31,300	513.00	16,056,900	

アキレス	12,100	1,388.00	16,794,800
有沢製作所	24,400	891.00	21,740,400
日東電工	106,100	8,290.00	879,569,000
レック	20,800	1,146.00	23,836,800
三光合成	18,400	443.00	8,151,200
きもと	26,900	280.00	7,532,000
藤森工業	15,800	4,190.00	66,202,000
前澤化成工業	11,100	1,262.00	14,008,200
未来工業	6,300	1,700.00	10,710,000
ウェーブロックホールディングス	6,100	697.00	4,251,700
J S P	10,300	1,648.00	16,974,400
エフピコ	32,300	4,110.00	132,753,000
天馬	13,200	2,629.00	34,702,800
信越ポリマー	27,000	1,046.00	28,242,000
東リ	43,700	241.00	10,531,700
ニフコ	64,400	3,945.00	254,058,000
バルカー	14,300	2,168.00	31,002,400
ユニ・チャーム	372,200	4,482.00	1,668,200,400
ショーエイコーポレーション	3,900	964.00	3,759,600
協和キリン	176,600	3,990.00	704,634,000
武田薬品工業	1,460,400	3,698.00	5,400,559,200
アステラス製薬	1,521,900	1,918.50	2,919,765,150
大日本住友製薬	130,100	2,215.00	288,171,500
塩野義製薬	220,700	5,824.00	1,285,356,800
わかもと製薬	20,900	329.00	6,876,100
日本新薬	49,800	8,770.00	436,746,000
バイオフェルミン製薬	3,000	2,993.00	8,979,000
中外製薬	549,000	4,238.00	2,326,662,000
科研製薬	30,000	4,795.00	143,850,000
エーザイ	193,900	10,530.00	2,041,767,000
ロート製薬	83,700	3,020.00	252,774,000
小野薬品工業	403,100	2,524.50	1,017,625,950
久光製薬	51,100	5,390.00	275,429,000
持田製薬	24,400	3,725.00	90,890,000
参天製薬	305,500	1,541.00	470,775,500
扶桑薬品工業	5,700	2,237.00	12,750,900
日本ケミファ	2,100	2,249.00	4,722,900
ツムラ	58,600	3,470.00	203,342,000
日医工	49,700	862.00	42,841,400
キッセイ薬品工業	31,100	2,219.00	69,010,900
生化学工業	31,000	1,111.00	34,441,000
栄研化学	30,800	2,170.00	66,836,000

日水製薬	6,500	1,006.00	6,539,000
鳥居薬品	11,000	2,444.00	26,884,000
JCRファーマ	49,500	3,660.00	181,170,000
東和薬品	25,300	2,549.00	64,489,700
富士製薬工業	10,800	1,144.00	12,355,200
ゼリア新薬工業	31,800	2,083.00	66,239,400
第一三共	1,379,400	2,309.00	3,185,034,600
キョーリン製薬ホールディングス	38,700	1,804.00	69,814,800
大幸薬品	21,600	965.00	20,844,000
ダイト	11,200	3,465.00	38,808,000
大塚ホールディングス	364,800	4,390.00	1,601,472,000
大正製薬ホールディングス	41,800	6,020.00	251,636,000
ペプチドリーム	92,100	4,910.00	452,211,000
あすか製薬ホールディングス	20,000	965.00	19,300,000
サワイグループホールディングス	38,400	4,730.00	181,632,000
日本コークス工業	148,300	101.00	14,978,300
ニチレキ	20,700	1,351.00	27,965,700
ユシロ化学工業	9,800	1,195.00	11,711,000
ビーピー・カストロール	6,300	1,343.00	8,460,900
富士石油	42,600	261.00	11,118,600
MORESCO	6,300	1,091.00	6,873,300
出光興産	194,800	2,622.00	510,765,600
ENEOSホールディングス	2,640,500	470.50	1,242,355,250
コスモエネルギーホールディングス	55,400	2,542.00	140,826,800
横浜ゴム	101,600	2,285.00	232,156,000
TOYO TIRE	92,400	2,225.00	205,590,000
ブリヂストン	466,700	4,960.00	2,314,832,000
住友ゴム工業	157,700	1,500.00	236,550,000
藤倉コンポジット	15,300	488.00	7,466,400
オカモト	10,600	4,165.00	44,149,000
フコク	7,700	930.00	7,161,000
ニッタ	18,100	2,700.00	48,870,000
住友理工	34,000	724.00	24,616,000
三ツ星ベルト	21,300	1,827.00	38,915,100
バンドー化学	30,900	919.00	28,397,100
日東紡績	26,200	3,210.00	84,102,000
AGC	161,200	4,665.00	751,998,000
日本板硝子	89,100	606.00	53,994,600
石塚硝子	3,000	1,877.00	5,631,000
日本山村硝子	7,400	920.00	6,808,000
日本電気硝子	65,100	2,509.00	163,335,900
オハラ	7,000	1,444.00	10,108,000

住友大阪セメント	31,600	3,000.00	94,800,000
太平洋セメント	99,800	2,487.00	248,202,600
日本ヒューム	16,100	733.00	11,801,300
日本コンクリート工業	38,100	318.00	12,115,800
三谷セキサン	8,200	4,345.00	35,629,000
アジアパイルホールディングス	27,200	455.00	12,376,000
東海カーボン	171,700	1,498.00	257,206,600
日本カーボン	9,700	4,095.00	39,721,500
東洋炭素	10,300	2,781.00	28,644,300
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	4,295.00	41,661,500
TOTO	125,400	5,790.00	726,066,000
日本碍子	193,200	1,848.00	357,033,600
日本特殊陶業	133,600	1,618.00	216,164,800
MARUWA	6,100	11,050.00	67,405,000
品川リフラクトリーズ	4,100	3,965.00	16,256,500
黒崎播磨	3,000	4,795.00	14,385,000
ヨータイ	12,600	1,330.00	16,758,000
イソライト工業	7,900	682.00	5,387,800
東京窯業	22,700	319.00	7,241,300
ニッカトー	8,100	687.00	5,564,700
フジミインコーポレーテッド	14,100	4,845.00	68,314,500
クニミネ工業	5,600	1,184.00	6,630,400
エーアンドエーマテリアル	3,400	1,013.00	3,444,200
ニチアス	44,400	2,816.00	125,030,400
ニチハ	24,400	2,900.00	70,760,000
日本製鉄	828,700	1,828.50	1,515,277,950
神戸製鋼所	317,800	704.00	223,731,200
中山製鋼所	24,300	396.00	9,622,800
合同製鐵	9,400	1,634.00	15,359,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	502,300	1,292.00	648,971,600
東京製鐵	67,700	1,070.00	72,439,000
共英製鋼	19,600	1,402.00	27,479,200
大和工業	36,900	3,600.00	132,840,000
東京鐵鋼	6,700	1,581.00	10,592,700
大阪製鐵	9,300	1,114.00	10,360,200
淀川製鋼所	22,800	2,332.00	53,169,600
丸一鋼管	56,400	2,660.00	150,024,000
モリ工業	5,200	2,328.00	12,105,600
大同特殊鋼	28,400	5,330.00	151,372,000
日本高周波鋼業	6,600	385.00	2,541,000
日本冶金工業	13,600	2,280.00	31,008,000
山陽特殊製鋼	20,800	1,577.00	32,801,600

愛知製鋼	9,800	3,060.00	29,988,000
日立金属	163,700	2,130.00	348,681,000
日本金属	4,400	952.00	4,188,800
大太平洋金属	11,800	1,681.00	19,835,800
新日本電工	112,300	300.00	33,690,000
栗本鐵工所	7,900	1,690.00	13,351,000
虹技	2,500	1,111.00	2,777,500
三菱製鋼	12,900	1,097.00	14,151,300
日亜鋼業	25,700	291.00	7,478,700
日本精線	2,500	4,530.00	11,325,000
エンビプロ・ホールディングス	7,400	1,240.00	9,176,000
シンニッタン	21,300	250.00	5,325,000
新家工業	4,300	1,587.00	6,824,100
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,146.00	30,139,800
日本軽金属ホールディングス	47,400	1,877.00	88,969,800
三井金属鉱業	46,900	3,050.00	143,045,000
東邦亜鉛	9,700	1,875.00	18,187,500
三菱マテリアル	114,700	2,246.00	257,616,200
住友金属鉱山	221,900	4,405.00	977,469,500
D O W Aホールディングス	43,900	4,280.00	187,892,000
古河機械金属	28,800	1,257.00	36,201,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,200	780.00	14,196,000
東邦チタニウム	31,200	1,021.00	31,855,200
U A C J	26,400	2,872.00	75,820,800
C Kサンエツ	3,700	3,035.00	11,229,500
古河電気工業	54,000	2,766.00	149,364,000
住友電気工業	605,800	1,595.50	966,553,900
フジクラ	209,900	560.00	117,544,000
昭和電線ホールディングス	16,900	1,824.00	30,825,600
東京特殊電線	2,300	2,597.00	5,973,100
タツタ電線	30,800	557.00	17,155,600
カナレ電気	3,000	1,677.00	5,031,000
平河ヒューテック	9,700	1,205.00	11,688,500
リョービ	21,400	1,521.00	32,549,400
アーレスティ	21,600	485.00	10,476,000
アサヒホールディングス	65,200	2,265.00	147,678,000
稲葉製作所	9,800	1,536.00	15,052,800
宮地エンジニアリンググループ	5,700	2,456.00	13,999,200
トーカロ	44,800	1,416.00	63,436,800
アルファC o	6,100	1,135.00	6,923,500
S U M C O	221,400	2,713.00	600,658,200
川田テクノロジーズ	3,500	3,725.00	13,037,500

RS Technologies	5,600	6,250.00	35,000,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	3,270.00	6,213,000
信和	9,200	706.00	6,495,200
東洋製罐グループホールディングス	110,600	1,427.00	157,826,200
ホッカンホールディングス	8,800	1,413.00	12,434,400
コロナ	9,600	930.00	8,928,000
横河ブリッジホールディングス	29,800	2,079.00	61,954,200
駒井ハルテック	3,500	1,699.00	5,946,500
高田機工	1,600	2,734.00	4,374,400
三和ホールディングス	163,600	1,348.00	220,532,800
文化シャッター	51,100	1,171.00	59,838,100
三協立山	22,400	865.00	19,376,000
アルインコ	11,500	1,023.00	11,764,500
東洋シャッター	3,800	639.00	2,428,200
LIXIL	239,000	2,954.00	706,006,000
日本フィルコン	12,100	519.00	6,279,900
ノーリツ	36,000	1,859.00	66,924,000
長府製作所	17,600	2,048.00	36,044,800
リンナイ	33,800	10,530.00	355,914,000
ダイニチ工業	8,300	758.00	6,291,400
日東精工	21,800	595.00	12,971,000
三洋工業	2,100	1,897.00	3,983,700
岡部	35,200	658.00	23,161,600
ジーテクト	21,500	1,544.00	33,196,000
東プレ	32,400	1,566.00	50,738,400
高周波熱錬	33,400	577.00	19,271,800
東京製綱	12,400	1,117.00	13,850,800
サンコール	14,800	455.00	6,734,000
モリテック スチール	13,500	476.00	6,426,000
パイオラックス	25,700	1,515.00	38,935,500
エイチワン	17,000	747.00	12,699,000
日本発條	172,900	863.00	149,212,700
中央発條	8,400	1,406.00	11,810,400
アドバネクス	2,500	1,283.00	3,207,500
立川ブラインド工業	7,600	1,332.00	10,123,200
三益半導体工業	13,500	2,584.00	34,884,000
日本ドライケミカル	4,400	1,800.00	7,920,000
日本製鋼所	52,800	2,809.00	148,315,200
三浦工業	75,200	4,965.00	373,368,000
タクマ	58,900	1,714.00	100,954,600
ツガミ	36,100	1,658.00	59,853,800
オークマ	20,300	5,480.00	111,244,000



芝浦機械	18,100	2,569.00	46,498,900
アマダ	254,600	1,141.00	290,498,600
アイダエンジニアリング	45,700	966.00	44,146,200
滝澤鉄工所	5,100	1,123.00	5,727,300
F U J I	69,300	2,577.00	178,586,100
牧野フライス製作所	20,400	4,400.00	89,760,000
オーエスジー	85,700	2,067.00	177,141,900
ダイジェット工業	2,100	1,313.00	2,757,300
旭ダイヤモンド工業	46,000	523.00	24,058,000
D M G 森精機	110,000	1,848.00	203,280,000
ソディック	41,800	1,032.00	43,137,600
ディスコ	23,600	33,250.00	784,700,000
日東工器	8,400	1,878.00	15,775,200
日進工具	13,700	1,468.00	20,111,600
パンチ工業	14,600	630.00	9,198,000
富士ダイス	8,900	669.00	5,954,100
豊和工業	9,900	820.00	8,118,000
O K K	6,700	440.00	2,948,000
東洋機械金属	12,600	509.00	6,413,400
津田駒工業	3,300	881.00	2,907,300
エンシュウ	4,400	862.00	3,792,800
島精機製作所	25,500	1,915.00	48,832,500
オプトラン	21,800	2,412.00	52,581,600
N C ホールディングス	5,300	1,235.00	6,545,500
イワキポンプ	11,100	913.00	10,134,300
フリー	17,000	1,376.00	23,392,000
ヤマシンフィルタ	35,100	727.00	25,517,700
日阪製作所	21,500	832.00	17,888,000
やまびこ	33,700	1,238.00	41,720,600
平田機工	8,200	6,510.00	53,382,000
ペガサスミシン製造	17,800	478.00	8,508,400
マルマエ	7,200	2,142.00	15,422,400
タツモ	7,400	1,727.00	12,779,800
ナプテスコ	102,300	4,215.00	431,194,500
三井海洋開発	18,500	1,978.00	36,593,000
レオン自動機	17,100	1,387.00	23,717,700
S M C	51,400	67,860.00	3,488,004,000
ホソカワミクロン	6,100	6,190.00	37,759,000
ユニオンツール	6,500	4,080.00	26,520,000
オイレス工業	24,400	1,607.00	39,210,800
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,830.00	28,497,000
サトーホールディングス	22,900	2,725.00	62,402,500

技研製作所	15,300	4,860.00	74,358,000
日本エアージェット	5,800	1,260.00	7,308,000
カワタ	4,800	882.00	4,233,600
日精樹脂工業	13,500	1,374.00	18,549,000
オカダアイヨン	5,600	1,339.00	7,498,400
ワイエイシイホールディングス	6,900	1,105.00	7,624,500
小松製作所	795,400	2,731.50	2,172,635,100
住友重機械工業	100,500	3,115.00	313,057,500
日立建機	82,100	3,305.00	271,340,500
日工	26,500	692.00	18,338,000
巴工業	6,900	2,290.00	15,801,000
井関農機	17,700	1,480.00	26,196,000
TOWA	16,400	2,258.00	37,031,200
丸山製作所	3,700	1,774.00	6,563,800
北川鉄工所	8,000	1,672.00	13,376,000
ローツェ	7,700	9,600.00	73,920,000
タカキタ	6,300	612.00	3,855,600
クボタ	922,200	2,272.50	2,095,699,500
荏原実業	8,900	2,843.00	25,302,700
三菱化工機	5,700	2,532.00	14,432,400
月島機械	32,500	1,194.00	38,805,000
帝国電機製作所	12,300	1,245.00	15,313,500
新東工業	41,900	803.00	33,645,700
澁谷工業	15,400	3,180.00	48,972,000
アイチ コーポレーション	30,100	855.00	25,735,500
小森コーポレーション	44,800	824.00	36,915,200
鶴見製作所	13,600	1,715.00	23,324,000
住友精密工業	2,600	2,910.00	7,566,000
日本ギア工業	7,300	322.00	2,350,600
酒井重工業	3,200	2,653.00	8,489,600
荏原製作所	72,900	5,450.00	397,305,000
石井鐵工所	2,600	3,050.00	7,930,000
西島製作所	17,800	875.00	15,575,000
北越工業	18,200	1,085.00	19,747,000
ダイキン工業	223,600	22,025.00	4,924,790,000
オルガノ	5,700	6,100.00	34,770,000
トーヨーカネツ	6,700	2,435.00	16,314,500
栗田工業	95,000	5,550.00	527,250,000
椿本チエイン	25,100	3,270.00	82,077,000
大同工業	8,500	1,123.00	9,545,500
木村化工機	14,900	863.00	12,858,700
アネスト岩田	29,700	1,050.00	31,185,000

ダイフク	96,600	10,000.00	966,000,000
サムコ	4,400	3,240.00	14,256,000
加藤製作所	9,800	993.00	9,731,400
油研工業	3,100	1,756.00	5,443,600
タダノ	84,900	1,151.00	97,719,900
フジテック	60,500	2,474.00	149,677,000
C K D	40,800	2,306.00	94,084,800
キトー	14,800	1,682.00	24,893,600
平和	49,000	2,018.00	98,882,000
理想科学工業	12,900	1,759.00	22,691,100
S A N K Y O	41,800	2,878.00	120,300,400
日本金銭機械	19,600	618.00	12,112,800
マースグループホールディングス	11,200	1,624.00	18,188,800
フクシマガリレイ	12,000	4,485.00	53,820,000
オーイズミ	7,600	386.00	2,933,600
ダイコク電機	8,200	921.00	7,552,200
竹内製作所	29,400	2,904.00	85,377,600
アマノ	46,000	2,866.00	131,836,000
J U K I	24,400	797.00	19,446,800
蛇の目マシン工業	16,100	753.00	12,123,300
マックス	23,600	1,837.00	43,353,200
グローリー	45,100	2,374.00	107,067,400
新晃工業	16,400	1,934.00	31,717,600
大和冷機工業	28,300	1,066.00	30,167,800
セガサミーホールディングス	159,700	1,494.00	238,591,800
日本ピストンリング	6,500	1,284.00	8,346,000
リケン	8,200	2,603.00	21,344,600
T P R	23,700	1,499.00	35,526,300
ツバキ・ナカシマ	33,900	1,698.00	57,562,200
ホシザキ	55,300	9,420.00	520,926,000
大豊工業	14,400	941.00	13,550,400
日本精工	360,600	917.00	330,670,200
N T N	406,200	292.00	118,610,400
ジェイテクト	168,500	1,147.00	193,269,500
不二越	16,300	4,320.00	70,416,000
日本トムソン	48,200	662.00	31,908,400
T H K	109,500	3,425.00	375,037,500
ユースン精機	11,800	829.00	9,782,200
前澤給装工業	12,300	1,063.00	13,074,900
イーグル工業	21,800	1,124.00	24,503,200
前澤工業	10,700	692.00	7,404,400
日本ピラー工業	17,800	2,293.00	40,815,400

キッツ	54,300	774.00	42,028,200
マキタ	228,900	5,500.00	1,258,950,000
日立造船	139,500	792.00	110,484,000
三菱重工業	275,800	3,236.00	892,488,800
I H I	118,100	2,551.00	301,273,100
スター精密	27,100	1,698.00	46,015,800
日清紡ホールディングス	107,400	944.00	101,385,600
イビデン	84,600	6,070.00	513,522,000
コニカミノルタ	357,900	612.00	219,034,800
ブラザー工業	214,800	2,246.00	482,440,800
ミネベアミツミ	302,900	3,125.00	946,562,500
日立製作所	843,900	6,729.00	5,678,603,100
東芝	347,400	4,935.00	1,714,419,000
三菱電機	1,755,300	1,484.50	2,605,742,850
富士電機	105,800	5,230.00	553,334,000
東洋電機製造	7,000	1,157.00	8,099,000
安川電機	189,000	5,760.00	1,088,640,000
シンフォニアテクノロジー	22,800	1,282.00	29,229,600
明電舎	29,800	2,241.00	66,781,800
オリジン	4,900	1,344.00	6,585,600
山洋電気	8,600	7,760.00	66,736,000
デンヨー	15,000	2,005.00	30,075,000
東芝テック	18,900	4,650.00	87,885,000
芝浦メカトロニクス	3,200	7,880.00	25,216,000
マブチモーター	48,800	4,225.00	206,180,000
日本電産	422,500	13,115.00	5,541,087,500
トレックス・セミコンダクター	9,800	3,000.00	29,400,000
東光高岳	9,700	1,353.00	13,124,100
ダイヘン	19,200	4,800.00	92,160,000
ヤーマン	29,400	1,350.00	39,690,000
JVCケンウッド	156,400	235.00	36,754,000
ミマキエンジニアリング	17,100	788.00	13,474,800
I - P E X	8,600	2,384.00	20,502,400
日新電機	41,200	1,364.00	56,196,800
大崎電気工業	35,100	629.00	22,077,900
オムロン	146,100	9,370.00	1,368,957,000
日東工業	25,800	1,882.00	48,555,600
I D E C	23,600	2,253.00	53,170,800
正興電機製作所	6,100	1,741.00	10,620,100
不二電機工業	3,700	1,290.00	4,773,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	63,500	2,803.00	177,990,500
サクサホールディングス	4,200	1,338.00	5,619,600

メルコホールディングス	6,300	5,650.00	35,595,000
テクノメディカ	4,600	1,611.00	7,410,600
日本電気	223,100	5,660.00	1,262,746,000
富士通	157,900	21,165.00	3,341,953,500
沖電気工業	71,400	1,024.00	73,113,600
岩崎通信機	7,700	942.00	7,253,400
電気興業	8,500	2,253.00	19,150,500
サンケン電気	20,500	5,490.00	112,545,000
ナカヨ	3,500	1,430.00	5,005,000
アイホン	10,000	2,041.00	20,410,000
ルネサスエレクトロニクス	841,700	1,213.00	1,020,982,100
セイコーエプソン	217,800	1,957.00	426,234,600
ワコム	128,600	710.00	91,306,000
アルバック	32,300	5,600.00	180,880,000
アクセル	8,500	882.00	7,497,000
E I Z O	14,900	4,935.00	73,531,500
日本信号	41,100	926.00	38,058,600
京三製作所	38,000	424.00	16,112,000
能美防災	23,700	2,126.00	50,386,200
ホーチキ	13,600	1,178.00	16,020,800
星和電機	10,700	515.00	5,510,500
エレコム	40,700	2,086.00	84,900,200
パナソニック	1,872,000	1,327.50	2,485,080,000
シャープ	233,500	1,785.00	416,797,500
アンリツ	105,600	2,048.00	216,268,800
富士通ゼネラル	53,600	2,924.00	156,726,400
ソニーグループ	1,099,600	11,485.00	12,628,906,000
T D K	84,800	13,500.00	1,144,800,000
帝国通信工業	8,700	1,123.00	9,770,100
タムラ製作所	63,300	956.00	60,514,800
アルプスアルパイン	144,300	1,151.00	166,089,300
池上通信機	5,600	835.00	4,676,000
鈴木	9,000	950.00	8,550,000
日本トリム	4,100	3,800.00	15,580,000
ローランド ディー . ジー .	10,700	2,708.00	28,975,600
フォスター電機	17,800	949.00	16,892,200
S M K	4,500	2,450.00	11,025,000
ヨコオ	14,200	2,554.00	36,266,800
ホシデン	48,600	1,025.00	49,815,000
ヒロセ電機	27,100	16,580.00	449,318,000
日本航空電子工業	40,300	1,844.00	74,313,200
T O A	20,800	857.00	17,825,600

マクセルホールディングス	35,700	1,282.00	45,767,400
古野電気	23,700	1,031.00	24,434,700
ユニデンホールディングス	4,500	2,592.00	11,664,000
スマダコーポレーション	15,800	1,224.00	19,339,200
アイコム	7,300	2,404.00	17,549,200
リオン	7,800	2,762.00	21,543,600
本多通信工業	15,800	486.00	7,678,800
横河電機	175,700	1,668.00	293,067,600
新電元工業	6,800	4,490.00	30,532,000
アズビル	118,700	4,580.00	543,646,000
東亜ディーケーケー	10,000	813.00	8,130,000
日本光電工業	72,900	3,335.00	243,121,500
チノー	5,600	1,492.00	8,355,200
共和電業	18,700	385.00	7,199,500
日本電子材料	7,300	1,796.00	13,110,800
堀場製作所	34,800	7,170.00	249,516,000
アドバンテスト	130,500	9,680.00	1,263,240,000
小野測器	9,200	581.00	5,345,200
エスペック	16,000	2,236.00	35,776,000
キーエンス	172,300	58,470.00	10,074,381,000
日置電機	8,600	7,120.00	61,232,000
シスメックス	137,100	13,100.00	1,796,010,000
日本マイクロニクス	31,300	1,444.00	45,197,200
メガチップス	17,900	3,325.00	59,517,500
O B A R A G R O U P	8,200	3,930.00	32,226,000
澤藤電機	2,400	2,146.00	5,150,400
原田工業	8,300	911.00	7,561,300
コーセル	22,400	1,024.00	22,937,600
イリソ電子工業	14,900	5,320.00	79,268,000
オブテックスグループ	29,400	1,810.00	53,214,000
千代田インテグレ	8,000	1,771.00	14,168,000
アイ・オー・データ機器	7,500	1,010.00	7,575,000
レーザーテック	77,100	22,230.00	1,713,933,000
スタンレー電気	123,200	3,120.00	384,384,000
岩崎電気	7,000	1,993.00	13,951,000
ウシオ電機	90,500	2,087.00	188,873,500
岡谷電機産業	15,400	375.00	5,775,000
ヘリオス テクノ ホールディング	19,300	341.00	6,581,300
エノモト	5,500	1,732.00	9,526,000
日本セラミック	18,200	2,919.00	53,125,800
遠藤照明	10,300	729.00	7,508,700
古河電池	13,200	1,508.00	19,905,600

双信電機	10,500	543.00	5,701,500
山一電機	12,100	1,630.00	19,723,000
図研	11,700	3,405.00	39,838,500
日本電子	32,100	6,630.00	212,823,000
カシオ計算機	141,200	1,898.00	267,997,600
ファナック	154,000	27,535.00	4,240,390,000
日本シイエムケイ	40,300	422.00	17,006,600
エンプラス	8,200	3,495.00	28,659,000
大真空	6,200	3,740.00	23,188,000
ローム	73,100	10,220.00	747,082,000
浜松ホトニクス	126,100	6,660.00	839,826,000
三井ハイテック	17,400	6,160.00	107,184,000
新光電気工業	59,200	3,990.00	236,208,000
京セラ	267,700	6,833.00	1,829,194,100
太陽誘電	78,200	5,500.00	430,100,000
村田製作所	515,700	9,113.00	4,699,574,100
双葉電子工業	31,400	791.00	24,837,400
北陸電気工業	7,600	1,030.00	7,828,000
ニチコン	56,100	1,182.00	66,310,200
日本ケミコン	17,700	2,636.00	46,657,200
K O A	24,900	1,635.00	40,711,500
市光工業	27,800	693.00	19,265,400
小糸製作所	105,300	6,580.00	692,874,000
ミツバ	32,300	794.00	25,646,200
S C R E E Nホールディングス	30,500	10,310.00	314,455,000
キャノン電子	16,700	1,694.00	28,289,800
キャノン	872,300	2,505.00	2,185,111,500
リコー	446,600	1,226.00	547,531,600
象印マホービン	48,100	1,610.00	77,441,000
M U T O Hホールディングス	2,900	1,600.00	4,640,000
東京エレクトロン	102,800	46,710.00	4,801,788,000
トヨタ紡織	51,200	2,238.00	114,585,600
芦森工業	3,400	1,188.00	4,039,200
ユニプレス	28,900	967.00	27,946,300
豊田自動織機	142,100	9,420.00	1,338,582,000
モリタホールディングス	28,200	1,624.00	45,796,800
三櫻工業	24,300	1,186.00	28,819,800
デンソー	386,500	7,519.00	2,906,093,500
東海理化電機製作所	46,300	1,754.00	81,210,200
三井E & Sホールディングス	67,900	530.00	35,987,000
川崎重工業	136,600	2,391.00	326,610,600
名村造船所	52,700	187.00	9,854,900

日本車輛製造	6,400	2,107.00	13,484,800
三菱ロジスネクスト	23,200	1,023.00	23,733,600
近畿車輛	3,000	1,188.00	3,564,000
日産自動車	2,070,100	586.00	1,213,078,600
いすゞ自動車	466,000	1,494.00	696,204,000
トヨタ自動車	1,778,200	9,815.00	17,453,033,000
日野自動車	219,200	967.00	211,966,400
三菱自動車工業	649,700	309.00	200,757,300
エフテック	12,300	839.00	10,319,700
レシップホールディングス	7,000	569.00	3,983,000
G M B	3,200	1,238.00	3,961,600
ファルテック	3,200	727.00	2,326,400
武蔵精密工業	39,200	2,366.00	92,747,200
日産車体	25,700	733.00	18,838,100
新明和工業	49,600	961.00	47,665,600
極東開発工業	30,300	1,571.00	47,601,300
トピー工業	14,500	1,282.00	18,589,000
ティラド	5,500	2,668.00	14,674,000
曙ブレーキ工業	96,300	172.00	16,563,600
タチエス	27,000	1,395.00	37,665,000
N O K	85,000	1,356.00	115,260,000
フタバ産業	44,100	531.00	23,417,100
K Y B	19,700	3,745.00	73,776,500
大同メタル工業	36,400	597.00	21,730,800
プレス工業	87,200	358.00	31,217,600
ミクニ	22,600	310.00	7,006,000
太平洋工業	36,800	1,192.00	43,865,600
河西工業	23,900	397.00	9,488,300
アイシン	128,500	4,735.00	608,447,500
マツダ	550,900	1,061.00	584,504,900
今仙電機製作所	15,500	702.00	10,881,000
本田技研工業	1,382,000	3,565.00	4,926,830,000
スズキ	347,900	4,730.00	1,645,567,000
S U B A R U	503,000	2,149.00	1,080,947,000
安永	8,500	1,155.00	9,817,500
ヤマハ発動機	248,000	2,837.00	703,576,000
T B K	21,100	414.00	8,735,400
エクセディ	23,900	1,638.00	39,148,200
豊田合成	56,700	2,645.00	149,971,500
愛三工業	27,600	874.00	24,122,400
盟和産業	2,800	1,002.00	2,805,600
日本プラスト	14,900	705.00	10,504,500



ヨロズ	15,100	1,206.00	18,210,600
エフ・シー・シー	28,700	1,569.00	45,030,300
シマノ	65,700	28,460.00	1,869,822,000
テイ・エス テック	81,600	1,652.00	134,803,200
ジャムコ	10,300	1,101.00	11,340,300
テルモ	538,100	4,412.00	2,374,097,200
クリエートメディック	5,800	985.00	5,713,000
日機装	56,700	1,145.00	64,921,500
日本エム・ディ・エム	10,100	2,252.00	22,745,200
島津製作所	225,900	4,400.00	993,960,000
JMS	14,900	813.00	12,113,700
長野計器	12,800	1,052.00	13,465,600
ブイ・テクノロジー	8,200	5,150.00	42,230,000
東京計器	11,200	1,068.00	11,961,600
愛知時計電機	2,300	4,305.00	9,901,500
インターアクション	8,800	2,473.00	21,762,400
オーバル	15,800	289.00	4,566,200
東京精密	29,600	4,950.00	146,520,000
マニー	69,900	2,591.00	181,110,900
ニコン	268,100	1,096.00	293,837,600
トプコン	88,400	1,627.00	143,826,800
オリンパス	971,200	2,226.00	2,161,891,200
理研計器	15,500	2,743.00	42,516,500
タムロン	14,200	2,457.00	34,889,400
HOYA	342,500	15,030.00	5,147,775,000
シード	6,900	774.00	5,340,600
ノーリツ鋼機	15,800	2,554.00	40,353,200
エー・アンド・デイ	14,800	991.00	14,666,800
朝日インテック	186,000	2,835.00	527,310,000
シチズン時計	222,800	417.00	92,907,600
リズム	5,500	777.00	4,273,500
大研医器	14,000	551.00	7,714,000
メニコン	27,000	7,840.00	211,680,000
シンシア	1,900	608.00	1,155,200
松風	8,100	2,050.00	16,605,000
セイコーホールディングス	24,800	2,403.00	59,594,400
ニプロ	130,800	1,363.00	178,280,400
中本パックス	4,500	1,760.00	7,920,000
スノーピーク	10,400	3,605.00	37,492,000
パラマウントベッドホールディングス	33,700	2,008.00	67,669,600
トランザクション	9,600	1,300.00	12,480,000
粧美堂	5,100	419.00	2,136,900

ニホンフラッシュ	15,000	1,258.00	18,870,000
前田工織	19,300	3,610.00	69,673,000
永大産業	22,900	299.00	6,847,100
アートネイチャー	16,900	692.00	11,694,800
バンダイナムコホールディングス	145,200	7,411.00	1,076,077,200
アイフィスジャパン	4,500	682.00	3,069,000
共立印刷	29,300	140.00	4,102,000
SHOEI	16,500	4,255.00	70,207,500
フランスベッドホールディングス	22,600	935.00	21,131,000
パイロットコーポレーション	29,600	3,835.00	113,516,000
萩原工業	9,700	1,451.00	14,074,700
トッパン・フォームズ	31,300	1,082.00	33,866,600
フジシールインターナショナル	36,100	2,250.00	81,225,000
タカラトミー	78,700	957.00	75,315,900
廣済堂	12,200	861.00	10,504,200
エステールホールディングス	4,700	649.00	3,050,300
タカノ	6,000	657.00	3,942,000
プロネクサス	14,100	1,044.00	14,720,400
ホクシン	10,800	158.00	1,706,400
ウッドワン	5,900	1,213.00	7,156,700
大建工業	11,800	2,104.00	24,827,200
凸版印刷	266,800	1,810.00	482,908,000
大日本印刷	207,500	2,448.00	507,960,000
共同印刷	5,400	2,740.00	14,796,000
NISSHA	36,000	1,609.00	57,924,000
光村印刷	1,500	1,642.00	2,463,000
TAKARA & COMPANY	8,600	1,819.00	15,643,400
アシックス	155,200	2,590.00	401,968,000
ツツミ	4,400	2,390.00	10,516,000
ローランド	13,700	5,440.00	74,528,000
小松ウオール工業	5,300	2,057.00	10,902,100
ヤマハ	104,400	6,050.00	631,620,000
河合楽器製作所	4,900	4,075.00	19,967,500
クリナップ	16,300	550.00	8,965,000
ピジョン	112,700	3,265.00	367,965,500
オリバー	3,700	3,780.00	13,986,000
兼松サステック	1,100	1,800.00	1,980,000
キングジム	14,300	892.00	12,755,600
リンテック	37,600	2,407.00	90,503,200
イトーキ	34,800	357.00	12,423,600
任天堂	100,500	63,720.00	6,403,860,000
三菱鉛筆	28,900	1,461.00	42,222,900

タカラスタANDARD	36,300	1,600.00	58,080,000	
コクヨ	84,200	1,807.00	152,149,400	
ナカバヤシ	17,300	600.00	10,380,000	
グローブライド	8,500	4,900.00	41,650,000	
オカムラ	60,300	1,516.00	91,414,800	
美津濃	17,400	2,610.00	45,414,000	
東京電力ホールディングス	1,488,800	329.00	489,815,200	
中部電力	537,000	1,336.00	717,432,000	
関西電力	665,000	1,047.00	696,255,000	
中国電力	253,200	1,017.00	257,504,400	
北陸電力	160,500	610.00	97,905,000	
東北電力	411,100	861.00	353,957,100	
四国電力	145,900	754.00	110,008,600	
九州電力	387,600	842.00	326,359,200	
北海道電力	164,300	514.00	84,450,200	
沖縄電力	34,100	1,421.00	48,456,100	
電源開発	139,700	1,624.00	226,872,800	
エフオン	10,600	980.00	10,388,000	
イーレックス	25,800	2,937.00	75,774,600	
レノバ	29,800	4,885.00	145,573,000	
東京瓦斯	337,600	2,058.50	694,949,600	
大阪瓦斯	317,900	2,024.00	643,429,600	
東邦瓦斯	86,300	5,560.00	479,828,000	
北海道瓦斯	9,400	1,585.00	14,899,000	
広島ガス	36,200	377.00	13,647,400	
西部ガスホールディングス	19,800	2,515.00	49,797,000	
静岡ガス	49,800	1,064.00	52,987,200	
メタウォーター	19,700	2,048.00	40,345,600	
SBSホールディングス	13,000	3,305.00	42,965,000	
東武鉄道	182,900	2,925.00	534,982,500	
相鉄ホールディングス	60,200	2,211.00	133,102,200	
東急	442,700	1,582.00	700,351,400	
京浜急行電鉄	225,400	1,391.00	313,531,400	
小田急電鉄	281,100	2,842.00	798,886,200	
京王電鉄	98,100	6,560.00	643,536,000	
京成電鉄	131,500	3,645.00	479,317,500	
富士急行	23,900	5,170.00	123,563,000	
新京成電鉄	4,500	2,114.00	9,513,000	
東日本旅客鉄道	308,900	8,099.00	2,501,781,100	
西日本旅客鉄道	156,400	6,516.00	1,019,102,400	
東海旅客鉄道	145,900	17,185.00	2,507,291,500	
西武ホールディングス	211,500	1,350.00	285,525,000	

鴻池運輸	27,900	1,222.00	34,093,800
西日本鉄道	48,700	2,757.00	134,265,900
ハマキョウレックス	13,500	3,220.00	43,470,000
サカイ引越センター	8,100	5,780.00	46,818,000
近鉄グループホールディングス	166,200	4,000.00	664,800,000
阪急阪神ホールディングス	221,700	3,505.00	777,058,500
南海電気鉄道	78,800	2,407.00	189,671,600
京阪ホールディングス	74,000	3,365.00	249,010,000
神戸電鉄	4,000	3,530.00	14,120,000
名古屋鉄道	136,700	2,050.00	280,235,000
山陽電気鉄道	11,900	1,938.00	23,062,200
アルプス物流	11,600	948.00	10,996,800
日本通運	57,500	8,240.00	473,800,000
ヤマトホールディングス	232,900	3,370.00	784,873,000
山九	42,600	5,000.00	213,000,000
丸運	9,500	273.00	2,593,500
丸全昭和運輸	13,500	3,285.00	44,347,500
センコーグループホールディングス	91,700	1,082.00	99,219,400
トナミホールディングス	4,000	5,180.00	20,720,000
ニッコンホールディングス	55,800	2,418.00	134,924,400
日本石油輸送	1,800	2,588.00	4,658,400
福山通運	21,300	4,130.00	87,969,000
セイノーホールディングス	124,500	1,402.00	174,549,000
エスライン	4,500	910.00	4,095,000
神奈川中央交通	4,100	3,560.00	14,596,000
日立物流	36,500	4,500.00	164,250,000
丸和運輸機関	35,100	1,533.00	53,808,300
C & F ロジホールディングス	16,800	1,605.00	26,964,000
九州旅客鉄道	128,600	2,593.00	333,459,800
S Gホールディングス	314,100	3,015.00	947,011,500
日本郵船	139,300	5,270.00	734,111,000
商船三井	99,000	4,980.00	493,020,000
川崎汽船	51,200	3,550.00	181,760,000
N S ユナイテッド海運	8,600	2,278.00	19,590,800
飯野海運	81,300	428.00	34,796,400
共栄タンカー	5,000	864.00	4,320,000
乾汽船	11,400	1,224.00	13,953,600
日本航空	405,000	2,471.00	1,000,755,000
A N Aホールディングス	448,700	2,724.00	1,222,258,800
パスコ	3,200	1,530.00	4,896,000
トランコム	5,100	8,500.00	43,350,000
日新	13,300	1,505.00	20,016,500

三菱倉庫	57,500	3,330.00	191,475,000
三井倉庫ホールディングス	17,600	2,595.00	45,672,000
住友倉庫	58,700	1,589.00	93,274,300
澁澤倉庫	9,100	2,137.00	19,446,700
東陽倉庫	27,900	316.00	8,816,400
日本トランスシティ	36,600	557.00	20,386,200
ケイヒン	3,200	1,367.00	4,374,400
中央倉庫	10,100	1,017.00	10,271,700
川西倉庫	3,000	1,158.00	3,474,000
安田倉庫	13,600	954.00	12,974,400
ファイブホールディングス	2,900	799.00	2,317,100
東洋埠頭	5,100	1,481.00	7,553,100
宇徳	11,800	532.00	6,277,600
上組	91,400	2,312.00	211,316,800
サンリツ	4,300	762.00	3,276,600
キムラユニティー	4,400	1,305.00	5,742,000
キューソー流通システム	4,100	1,690.00	6,929,000
近鉄エクスプレス	31,400	2,546.00	79,944,400
東海運	9,500	310.00	2,945,000
エーアイティー	10,400	1,098.00	11,419,200
内外トランスライン	5,800	1,937.00	11,234,600
日本コンセプト	5,300	1,832.00	9,709,600
NEC ネットズエスアイ	57,200	1,796.00	102,731,200
クロスキャット	4,900	974.00	4,772,600
システナ	61,600	2,207.00	135,951,200
デジタルアーツ	10,100	8,370.00	84,537,000
日鉄ソリューションズ	25,000	3,505.00	87,625,000
キューブシステム	9,400	1,024.00	9,625,600
WOW WORLD	2,900	1,963.00	5,692,700
コア	7,600	1,446.00	10,989,600
ラクーンホールディングス	12,400	2,357.00	29,226,800
ソリトンシステムズ	8,900	1,584.00	14,097,600
ソフトクリエイイトホールディングス	6,900	2,744.00	18,933,600
T I S	172,400	2,913.00	502,201,200
J N S ホールディングス	8,500	600.00	5,100,000
グリー	106,300	607.00	64,524,100
G M O ペパボ	1,600	4,620.00	7,392,000
コーエーテクモホールディングス	45,900	5,130.00	235,467,000
三菱総合研究所	7,500	4,170.00	31,275,000
電算	2,100	2,321.00	4,874,100
A G S	9,200	883.00	8,123,600
ファインデックス	14,900	1,208.00	17,999,200

ブレインパッド	4,500	4,800.00	21,600,000
K L a b	31,600	638.00	20,160,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	23,300	1,071.00	24,954,300
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,325.00	9,642,500
ネクソン	436,400	2,325.00	1,014,630,000
アイスタイル	53,300	494.00	26,330,200
エムアップホールディングス	4,600	3,470.00	15,962,000
エイチーム	12,100	1,522.00	18,416,200
エニグモ	16,600	1,440.00	23,904,000
テクノスジャパン	14,000	611.00	8,554,000
コロプラ	57,100	815.00	46,536,500
ブロードリーフ	86,100	521.00	44,858,100
クロス・マーケティンググループ	8,200	667.00	5,469,400
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,551.00	12,563,100
システム情報	13,300	929.00	12,355,700
メディアドゥ	6,800	4,730.00	32,164,000
じげん	43,500	455.00	19,792,500
ブイキューブ	9,600	2,458.00	23,596,800
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	644.00	2,318,400
サイバーリンクス	5,900	1,532.00	9,038,800
フィックスターズ	18,800	840.00	15,792,000
C A R T A H O L D I N G S	7,200	1,957.00	14,090,400
オブティム	12,200	2,133.00	26,022,600
セレス	5,800	3,240.00	18,792,000
S H I F T	8,700	20,680.00	179,916,000
ティーガイア	18,500	2,007.00	37,129,500
セック	2,700	2,665.00	7,195,500
日本アジアグループ	16,600	960.00	15,936,000
テクマトリックス	26,900	1,889.00	50,814,100
プロシップ	5,300	1,423.00	7,541,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,700	2,077.00	86,610,900
G M O ペイメントゲートウェイ	33,400	14,090.00	470,606,000
ザッパラス	7,500	516.00	3,870,000
システムリサーチ	5,200	2,248.00	11,689,600
インターネットイニシアティブ	46,000	3,675.00	169,050,000
さくらインターネット	19,100	617.00	11,784,700
ヴィンクス	5,200	949.00	4,934,800
G M O グローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,695.00	18,310,500
S R A ホールディングス	9,300	2,742.00	25,500,600
システムインテグレータ	5,400	654.00	3,531,600
朝日ネット	14,500	689.00	9,990,500
e B A S E	21,000	844.00	17,724,000

アバント	18,700	1,672.00	31,266,400
アドソル日進	6,300	2,239.00	14,105,700
ODKソリューションズ	4,100	794.00	3,255,400
フリービット	10,700	784.00	8,388,800
コムチュア	16,000	2,441.00	39,056,000
サイバーコム	3,300	1,460.00	4,818,000
アステリア	12,900	834.00	10,758,600
アイル	9,800	1,390.00	13,622,000
マークラインズ	7,300	2,951.00	21,542,300
メディカル・データ・ビジョン	19,800	2,071.00	41,005,800
gumi	24,300	769.00	18,686,700
ショーケース	4,300	712.00	3,061,600
モバイルファクトリー	4,200	1,141.00	4,792,200
テラスカイ	5,700	2,410.00	13,737,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,916.00	14,944,800
PCIホールディングス	8,000	1,164.00	9,312,000
パイプドHD	3,800	2,280.00	8,664,000
アイビーシー	3,200	950.00	3,040,000
ネオジャパン	3,500	1,471.00	5,148,500
PR TIMES	3,800	3,310.00	12,578,000
ラクス	52,000	3,415.00	177,580,000
ランドコンピュータ	3,000	1,108.00	3,324,000
ダブルスタンダード	2,300	5,560.00	12,788,000
オープンドア	10,400	2,336.00	24,294,400
マイネット	5,600	695.00	3,892,000
アカツキ	7,000	3,415.00	23,905,000
ベネフィットジャパン	1,500	1,982.00	2,973,000
Ubicomホールディングス	4,600	3,715.00	17,089,000
カナミックネットワーク	19,000	627.00	11,913,000
ノムラシステムコーポレーション	8,900	298.00	2,652,200
チェンジ	31,800	2,754.00	87,577,200
シンクロ・フード	11,300	369.00	4,169,700
オークネット	9,400	1,414.00	13,291,600
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	999.00	3,796,200
セグエグループ	4,800	1,082.00	5,193,600
エイトレッド	3,400	2,286.00	7,772,400
マクロミル	35,700	842.00	30,059,400
ビーグリー	3,600	1,536.00	5,529,600
オロ	5,500	3,860.00	21,230,000
ユーザーローカル	5,400	2,004.00	10,821,600
テモナ	4,100	1,109.00	4,546,900
ニーズウェル	4,100	631.00	2,587,100

サインポスト	4,100	789.00	3,234,900
電算システムホールディングス	6,600	3,000.00	19,800,000
ソルクシーズ	7,000	958.00	6,706,000
フェイス	5,800	714.00	4,141,200
プロトコーポレーション	20,900	1,368.00	28,591,200
ハイマックス	5,200	1,109.00	5,766,800
野村総合研究所	299,300	3,640.00	1,089,452,000
サイバネットシステム	12,800	687.00	8,793,600
C Eホールディングス	9,800	566.00	5,546,800
日本システム技術	3,300	1,507.00	4,973,100
インタージホールディングス	21,700	1,580.00	34,286,000
東邦システムサイエンス	4,900	956.00	4,684,400
ソースネクスト	83,000	314.00	26,062,000
インフォコム	15,800	2,887.00	45,614,600
HEROZ	5,100	2,158.00	11,005,800
ラクスル	18,800	5,820.00	109,416,000
I P S	4,200	2,985.00	12,537,000
F I G	20,100	280.00	5,628,000
システムサポート	5,400	1,345.00	7,263,000
イーソル	9,700	1,056.00	10,243,200
アルテリア・ネットワークス	19,300	1,927.00	37,191,100
E d u L a b	1,700	5,370.00	9,129,000
東海ソフト	2,900	1,515.00	4,393,500
ウイングアーク1 s t	9,200	2,140.00	19,688,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	2,161.00	8,860,100
サーバーワークス	1,800	4,010.00	7,218,000
東名	2,000	1,063.00	2,126,000
ヴィッツ	1,800	2,038.00	3,668,400
トピラシステムズ	2,600	1,310.00	3,406,000
S a n s a n	15,300	8,720.00	133,416,000
L i n k - U	3,400	1,644.00	5,589,600
ギフトィ	10,500	3,695.00	38,797,500
ベース	2,000	5,380.00	10,760,000
フォーカスシステムズ	11,900	986.00	11,733,400
クレスコ	11,500	1,910.00	21,965,000
フジ・メディア・ホールディングス	179,000	1,243.00	222,497,000
オービック	54,300	20,800.00	1,129,440,000
ジャストシステム	24,600	6,510.00	160,146,000
T D C ソフト	15,500	1,032.00	15,996,000
Zホールディングス	2,367,000	559.70	1,324,809,900
トレンドマイクロ	92,100	5,820.00	536,022,000
I Dホールディングス	10,300	927.00	9,548,100



日本オラクル	35,000	8,230.00	288,050,000
アルファシステムズ	4,700	3,750.00	17,625,000
フューチャー	21,000	1,954.00	41,034,000
C A C H o l d i n g s	11,500	1,460.00	16,790,000
S B テクノロジー	6,300	3,030.00	19,089,000
トーセ	5,200	802.00	4,170,400
オービックビジネスコンサルタント	17,300	6,510.00	112,623,000
伊藤忠テクノソリューションズ	78,600	3,460.00	271,956,000
アイティフォー	23,000	786.00	18,078,000
東計電算	2,600	4,545.00	11,817,000
エクスネット	3,100	1,031.00	3,196,100
大塚商会	93,300	5,830.00	543,939,000
サイボウズ	20,300	2,537.00	51,501,100
電通国際情報サービス	21,400	4,735.00	101,329,000
A C C E S S	22,000	887.00	19,514,000
デジタルガレージ	28,500	4,990.00	142,215,000
E M システムズ	28,900	839.00	24,247,100
ウェザーニューズ	5,200	5,610.00	29,172,000
C I J	12,100	846.00	10,236,600
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,185.00	5,733,000
日本エンタープライズ	19,400	213.00	4,132,200
WOWOW	8,400	2,468.00	20,731,200
スカラ	15,900	775.00	12,322,500
インテリジェント ウェイブ	10,700	597.00	6,387,900
I M A G I C A G R O U P	15,500	439.00	6,804,500
ネットワンシステムズ	70,400	3,815.00	268,576,000
システムソフト	37,900	256.00	9,702,400
アルゴグラフィックス	13,500	3,545.00	47,857,500
マーベラス	27,600	767.00	21,169,200
エイベックス	29,900	1,746.00	52,205,400
日本ユニシス	59,900	3,480.00	208,452,000
兼松エレクトロニクス	9,500	3,695.00	35,102,500
都築電気	7,900	1,619.00	12,790,100
T B S ホールディングス	114,500	1,735.00	198,657,500
日本テレビホールディングス	144,100	1,277.00	184,015,700
朝日放送グループホールディングス	17,700	706.00	12,496,200
テレビ朝日ホールディングス	53,500	1,743.00	93,250,500
スカパー J S A T ホールディングス	114,400	412.00	47,132,800
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,148.00	26,850,000
日本BS放送	6,200	1,099.00	6,813,800
ビジョン	21,700	1,083.00	23,501,100
スマートバリュー	5,100	677.00	3,452,700

ワイヤレスゲート	8,000	434.00	3,472,000
コネクシオ	10,000	1,564.00	15,640,000
クロップス	3,600	887.00	3,193,200
日本電信電話	2,014,700	2,882.00	5,806,365,400
K D D I	1,381,400	3,492.00	4,823,848,800
ソフトバンク	1,565,500	1,470.00	2,301,285,000
光通信	20,300	20,610.00	418,383,000
エムティーアイ	17,300	689.00	11,919,700
G M Oインターネット	61,100	2,997.00	183,116,700
ファイバーゲート	5,800	1,481.00	8,589,800
アйдママーケティングコミュニケーション	5,400	402.00	2,170,800
K A D O K A W A	44,700	4,300.00	192,210,000
学研ホールディングス	24,600	1,334.00	32,816,400
ゼンリン	31,600	1,151.00	36,371,600
昭文社ホールディングス	7,800	490.00	3,822,000
インプレスホールディングス	14,300	246.00	3,517,800
アイネット	9,100	1,460.00	13,286,000
松竹	11,400	12,690.00	144,666,000
東宝	101,700	4,640.00	471,888,000
東映	5,700	20,290.00	115,653,000
エヌ・ティ・ティ・データ	458,800	1,754.00	804,735,200
ピー・シー・エー	2,600	3,885.00	10,101,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,762.00	10,748,200
D T S	35,900	2,722.00	97,719,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,500	5,280.00	388,080,000
シーイーシー	18,700	1,637.00	30,611,900
カブコン	147,800	3,095.00	457,441,000
アイ・エス・ビー	8,200	1,532.00	12,562,400
ジャステック	11,300	1,243.00	14,045,900
S C S K	39,800	6,830.00	271,834,000
日本システムウエア	5,900	2,324.00	13,711,600
アイネス	17,200	1,408.00	24,217,600
T K C	29,300	3,360.00	98,448,000
富士ソフト	18,400	5,680.00	104,512,000
N S D	55,600	1,853.00	103,026,800
コナミホールディングス	62,600	6,300.00	394,380,000
福井コンピュータホールディングス	8,000	4,305.00	34,440,000
J B C Cホールディングス	11,900	1,476.00	17,564,400
ミロク情報サービス	17,300	1,725.00	29,842,500
ソフトバンクグループ	1,366,800	7,540.00	10,305,672,000
ハウスイ	1,400	940.00	1,316,000
高千穂交易	6,700	1,148.00	7,691,600

オルパヘルスケアホールディングス	2,800	1,691.00	4,734,800
伊藤忠食品	4,200	5,320.00	22,344,000
エレマテック	13,900	1,253.00	17,416,700
JALUX	4,900	1,801.00	8,824,900
あらた	13,800	4,310.00	59,478,000
トーメンデバイス	2,200	4,105.00	9,031,000
東京エレクトロン デバイス	5,700	5,410.00	30,837,000
フィールズ	15,100	536.00	8,093,600
双日	954,800	338.00	322,722,400
アルフレッサ ホールディングス	179,300	1,716.00	307,678,800
横浜冷凍	48,500	900.00	43,650,000
ラサ商事	9,200	902.00	8,298,400
アルコニックス	18,400	1,475.00	27,140,000
神戸物産	119,300	3,845.00	458,708,500
ハイパー	3,600	544.00	1,958,400
あい ホールディングス	24,700	2,167.00	53,524,900
ディーブイエックス	5,300	1,000.00	5,300,000
ダイワボウホールディングス	78,800	2,015.00	158,782,000
マクニカ・富士エレホールディングス	41,200	2,617.00	107,820,400
ラクト・ジャパン	7,600	2,755.00	20,938,000
グリムス	5,100	1,971.00	10,052,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,100	754.00	22,695,400
八洲電機	13,400	970.00	12,998,000
メディアスホールディングス	9,800	1,046.00	10,250,800
レスターホールディングス	18,000	1,950.00	35,100,000
ジューテックホールディングス	4,000	1,038.00	4,152,000
大光	6,700	685.00	4,589,500
OCHIホールディングス	5,000	1,282.00	6,410,000
TOKAIホールディングス	83,800	913.00	76,509,400
黒谷	4,700	905.00	4,253,500
Cominix	3,100	730.00	2,263,000
三洋貿易	17,400	1,264.00	21,993,600
ビューティガレージ	2,800	4,470.00	12,516,000
ウイン・パートナーズ	12,500	1,015.00	12,687,500
ミタチ産業	4,800	808.00	3,878,400
シップヘルスケアホールディングス	61,000	2,709.00	165,249,000
明治電機工業	6,000	1,407.00	8,442,000
デリカフーズホールディングス	6,800	652.00	4,433,600
スターティアホールディングス	3,400	2,017.00	6,857,800
コメダホールディングス	37,700	2,084.00	78,566,800
ピーバンドットコム	2,400	787.00	1,888,800
アセンテック	4,500	1,205.00	5,422,500

富士興産	5,300	1,089.00	5,771,700
協栄産業	1,900	1,435.00	2,726,500
小野建	15,500	1,305.00	20,227,500
南陽	3,500	2,006.00	7,021,000
佐島電機	10,800	818.00	8,834,400
エコートレーディング	3,700	661.00	2,445,700
伯東	10,600	1,523.00	16,143,800
コンドーテック	13,400	1,011.00	13,547,400
中山福	10,000	435.00	4,350,000
ナガイレーベン	22,900	2,572.00	58,898,800
三菱食品	19,000	2,826.00	53,694,000
松田産業	12,600	2,201.00	27,732,600
第一興商	34,000	4,350.00	147,900,000
メディバルホールディングス	173,300	2,163.00	374,847,900
S P K	7,400	1,377.00	10,189,800
萩原電気ホールディングス	6,400	2,267.00	14,508,800
アズワン	12,400	15,050.00	186,620,000
スズデン	6,000	1,472.00	8,832,000
尾家産業	5,100	1,235.00	6,298,500
シモジマ	10,600	1,079.00	11,437,400
ドウシシャ	16,300	1,722.00	28,068,600
小津産業	3,800	1,950.00	7,410,000
高速	9,200	1,468.00	13,505,600
たけびし	6,100	1,559.00	9,509,900
リックス	3,900	1,517.00	5,916,300
丸文	15,400	642.00	9,886,800
ハピネット	14,400	1,493.00	21,499,200
橋本総業ホールディングス	3,500	2,766.00	9,681,000
日本ライフライン	55,900	1,400.00	78,260,000
タカショー	11,300	870.00	9,831,000
マルカ	5,600	2,510.00	14,056,000
I D O M	58,300	691.00	40,285,300
進和	10,200	2,247.00	22,919,400
エスケイジャパン	4,300	482.00	2,072,600
ダイトロン	7,300	1,980.00	14,454,000
シークス	22,000	1,438.00	31,636,000
田中商事	5,400	669.00	3,612,600
オーハシテクニカ	8,900	1,543.00	13,732,700
白銅	6,200	2,188.00	13,565,600
ダイコー通産	2,100	1,298.00	2,725,800
伊藤忠商事	1,209,200	3,245.00	3,923,854,000
丸紅	1,704,800	966.20	1,647,177,760

高島	2,800	1,844.00	5,163,200
長瀬産業	94,900	1,681.00	159,526,900
蝶理	11,100	1,774.00	19,691,400
豊田通商	173,700	5,240.00	910,188,000
三共生興	26,200	570.00	14,934,000
兼松	69,100	1,464.00	101,162,400
ツカモトコーポレーション	2,900	1,426.00	4,135,400
三井物産	1,379,100	2,562.50	3,533,943,750
日本紙パルプ商事	9,000	3,680.00	33,120,000
カメイ	22,600	1,185.00	26,781,000
東都水産	2,000	5,070.00	10,140,000
OUGホールディングス	2,700	2,872.00	7,754,400
スターゼン	12,800	2,168.00	27,750,400
山善	67,600	1,018.00	68,816,800
椿本興業	3,200	3,420.00	10,944,000
住友商事	1,091,000	1,495.50	1,631,590,500
内田洋行	7,400	4,950.00	36,630,000
三菱商事	1,052,500	3,104.00	3,266,960,000
第一実業	7,900	4,410.00	34,839,000
キャノンマーケティングジャパン	42,900	2,596.00	111,368,400
西華産業	9,100	1,653.00	15,042,300
佐藤商事	14,300	1,129.00	16,144,700
菱洋エレクトロ	13,200	2,604.00	34,372,800
東京産業	15,700	630.00	9,891,000
ユアサ商事	17,700	3,080.00	54,516,000
神鋼商事	3,900	2,391.00	9,324,900
トルク	10,500	235.00	2,467,500
阪和興業	34,600	3,120.00	107,952,000
正栄食品工業	11,200	3,915.00	43,848,000
カナデン	14,100	1,066.00	15,030,600
菱電商事	12,500	1,653.00	20,662,500
フルサト工業	8,800	1,966.00	17,300,800
岩谷産業	41,500	6,380.00	264,770,000
ナイス	6,800	1,992.00	13,545,600
ニチモウ	2,700	2,080.00	5,616,000
極東貿易	5,000	2,635.00	13,175,000
アステナホールディングス	25,300	608.00	15,382,400
三愛石油	42,600	1,392.00	59,299,200
稲畑産業	41,600	1,683.00	70,012,800
G S I クレオス	8,500	963.00	8,185,500
明和産業	16,000	473.00	7,568,000
クワザワホールディングス	6,200	619.00	3,837,800

ヤマエ久野	12,600	1,196.00	15,069,600
ワキタ	34,100	1,022.00	34,850,200
東邦ホールディングス	55,500	1,892.00	105,006,000
サンゲツ	46,500	1,611.00	74,911,500
ミツウロコグループホールディングス	25,500	1,316.00	33,558,000
シナネンホールディングス	6,400	3,150.00	20,160,000
伊藤忠エネクス	38,300	993.00	38,031,900
サンリオ	48,600	2,012.00	97,783,200
サンワテクノス	11,400	1,290.00	14,706,000
リョーサン	19,100	2,158.00	41,217,800
新光商事	23,400	781.00	18,275,400
トーホー	7,800	1,585.00	12,363,000
三信電気	9,300	2,154.00	20,032,200
東陽テクニカ	17,100	1,115.00	19,066,500
モスフードサービス	24,400	3,170.00	77,348,000
加賀電子	15,700	2,944.00	46,220,800
ソーダニッカ	16,500	555.00	9,157,500
立花エレテック	12,800	1,470.00	18,816,000
フォーバル	6,100	959.00	5,849,900
PALTAC	27,700	5,350.00	148,195,000
三谷産業	22,800	385.00	8,778,000
西本Wismettacホールディングス	3,900	2,749.00	10,721,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,999.00	3,198,400
コア商事ホールディングス	13,000	665.00	8,645,000
国際紙パルプ商事	37,000	259.00	9,583,000
ヤマタネ	7,400	1,538.00	11,381,200
丸紅建材リース	1,700	1,895.00	3,221,500
日鉄物産	12,300	4,470.00	54,981,000
泉州電業	4,900	3,850.00	18,865,000
トラスコ中山	39,600	2,824.00	111,830,400
オートバックスセブン	63,500	1,545.00	98,107,500
モリト	12,700	615.00	7,810,500
加藤産業	25,000	3,380.00	84,500,000
北恵	4,400	972.00	4,276,800
イノテック	9,700	1,367.00	13,259,900
イエローハット	32,700	2,054.00	67,165,800
JKホールディングス	15,700	815.00	12,795,500
日伝	14,400	2,192.00	31,564,800
北沢産業	11,900	251.00	2,986,900
杉本商事	8,700	2,291.00	19,931,700
因幡電機産業	46,100	2,637.00	121,565,700
東テク	5,700	2,818.00	16,062,600

ミスミグループ本社	216,900	3,985.00	864,346,500
アルテック	12,800	318.00	4,070,400
タキヒヨー	5,700	1,893.00	10,790,100
蔵王産業	3,400	1,508.00	5,127,200
スズケン	73,200	3,350.00	245,220,000
ジェコス	12,000	897.00	10,764,000
グローセル	18,800	440.00	8,272,000
ローソン	43,800	5,320.00	233,016,000
サンエー	13,200	4,155.00	54,846,000
カワチ薬品	12,200	2,196.00	26,791,200
エービーシー・マート	27,100	6,410.00	173,711,000
ハードオフコーポレーション	8,100	777.00	6,293,700
アスクル	28,200	1,634.00	46,078,800
ゲオホールディングス	23,400	1,228.00	28,735,200
アダストリア	24,100	1,979.00	47,693,900
くら寿司	20,400	4,175.00	85,170,000
キャンドウ	8,400	1,913.00	16,069,200
アイケイ	5,500	775.00	4,262,500
パルグループホールディングス	15,400	1,704.00	26,241,600
エディオン	73,600	1,093.00	80,444,800
サーラコーポレーション	35,800	613.00	21,945,400
ワッツ	8,800	914.00	8,043,200
ハローズ	7,100	2,785.00	19,773,500
フジオフードグループ本社	14,600	1,305.00	19,053,000
あみやき亭	3,900	2,945.00	11,485,500
大黒天物産	5,600	6,320.00	35,392,000
ハニーズホールディングス	14,100	1,213.00	17,103,300
ファーマライズホールディングス	4,700	736.00	3,459,200
アルペン	13,400	3,050.00	40,870,000
ハブ	6,100	700.00	4,270,000
クオールホールディングス	23,600	1,512.00	35,683,200
ジーンズホールディングス	11,800	8,170.00	96,406,000
ビックカメラ	102,900	1,135.00	116,791,500
D C Mホールディングス	107,100	1,084.00	116,096,400
MonotaRO	246,000	2,639.00	649,194,000
東京一番フーズ	5,100	593.00	3,024,300
きちりホールディングス	4,600	596.00	2,741,600
アーランドサービスホールディングス	14,600	2,223.00	32,455,800
J．フロント リテイリング	206,800	1,025.00	211,970,000
ドトール・日レスホールディングス	27,600	1,759.00	48,548,400
マツモトキヨシホールディングス	71,500	4,850.00	346,775,000
ブロンコビリー	9,200	2,402.00	22,098,400

Z O Z O	102,000	3,535.00	360,570,000
トレジャー・ファクトリー	5,500	994.00	5,467,000
物語コーポレーション	9,300	7,390.00	68,727,000
ココカラファイン	15,500	8,180.00	126,790,000
三越伊勢丹ホールディングス	303,000	823.00	249,369,000
H a m e e	4,700	1,479.00	6,951,300
マーケットエンタープライズ	1,500	1,135.00	1,702,500
ウエルシアホールディングス	91,500	3,375.00	308,812,500
クリエイティブSDホールディングス	25,600	3,200.00	81,920,000
丸善C H Iホールディングス	20,200	402.00	8,120,400
ミサワ	4,100	699.00	2,865,900
ティーライフ	2,600	1,556.00	4,045,600
チムニー	5,300	1,420.00	7,526,000
シュッピン	12,100	1,070.00	12,947,000
オイシックス・ラ・大地	22,900	4,250.00	97,325,000
ネクステージ	30,700	2,170.00	66,619,000
ジョイフル本田	50,900	1,376.00	70,038,400
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,866.00	12,315,600
ホットランド	13,200	1,331.00	17,569,200
すかいらーくホールディングス	220,600	1,514.00	333,988,400
S F Pホールディングス	8,400	1,501.00	12,608,400
綿半ホールディングス	13,300	1,238.00	16,465,400
ヨシックスホールディングス	3,600	2,350.00	8,460,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,600	1,019.00	51,561,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,200	1,762.00	16,210,400
B E E N O S	8,800	3,530.00	31,064,000
あさひ	13,200	1,359.00	17,938,800
日本調剤	10,700	1,670.00	17,869,000
コスモス薬品	17,500	16,220.00	283,850,000
トーエル	8,900	827.00	7,360,300
オンリー	3,800	474.00	1,801,200
セブン&アイ・ホールディングス	676,300	5,088.00	3,441,014,400
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	92,900	983.00	91,320,700
ツルハホールディングス	37,700	12,550.00	473,135,000
サンマルクホールディングス	13,900	1,603.00	22,281,700
フェリシモ	4,100	1,693.00	6,941,300
トリドールホールディングス	43,000	1,904.00	81,872,000
T O K Y O B A S E	16,200	686.00	11,113,200
ウイルプラスホールディングス	3,100	1,038.00	3,217,800
J Mホールディングス	11,800	2,134.00	25,181,200
サツドラホールディングス	2,800	2,011.00	5,630,800



アレンザホールディングス	13,500	1,258.00	16,983,000
串カツ田中ホールディングス	4,800	1,863.00	8,942,400
パロックジャパンリミテッド	12,500	819.00	10,237,500
クスリのアオキホールディングス	17,200	7,300.00	125,560,000
力の源ホールディングス	7,900	619.00	4,890,100
FOOD & LIFE COMPANIES	101,300	4,240.00	429,512,000
メディカルシステムネットワーク	15,600	746.00	11,637,600
はるやまホールディングス	8,700	641.00	5,576,700
ノジマ	30,900	2,782.00	85,963,800
カッパ・クリエイト	24,200	1,460.00	35,332,000
ライトオン	12,900	723.00	9,326,700
良品計画	199,100	2,093.00	416,716,300
三城ホールディングス	22,900	269.00	6,160,100
アドヴァングループ	18,000	924.00	16,632,000
アルビス	5,700	2,324.00	13,246,800
コナカ	20,400	350.00	7,140,000
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,653.00	3,967,200
G - 7ホールディングス	8,500	3,455.00	29,367,500
イオン北海道	23,000	1,053.00	24,219,000
コジマ	30,300	684.00	20,725,200
ヒマラヤ	6,400	1,059.00	6,777,600
コーナン商事	24,700	3,785.00	93,489,500
エコス	6,600	1,913.00	12,625,800
ワタミ	22,700	965.00	21,905,500
マルシェ	4,500	501.00	2,254,500
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	345,700	2,409.00	832,791,300
西松屋チェーン	38,200	1,399.00	53,441,800
ゼンショーホールディングス	93,000	2,820.00	262,260,000
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,529.00	16,819,000
ハークスレイ	4,000	976.00	3,904,000
サイゼリヤ	25,800	2,680.00	69,144,000
V Tホールディングス	66,000	459.00	30,294,000
魚力	5,600	2,092.00	11,715,200
フジ・コーポレーション	9,500	1,266.00	12,027,000
ユナイテッドアローズ	20,000	2,121.00	42,420,000
ハイデイ日高	25,200	1,875.00	47,250,000
京都きもの友禅	12,600	261.00	3,288,600
コロワイド	57,400	2,028.00	116,407,200
ピーシーデポコーポレーション	21,000	491.00	10,311,000
壱番屋	12,300	4,965.00	61,069,500
PLANT	5,000	719.00	3,595,000

スギホールディングス	34,600	7,790.00	269,534,000
薬王堂ホールディングス	7,700	2,311.00	17,794,700
スクロール	25,200	856.00	21,571,200
ヨンドシーホールディングス	16,100	1,832.00	29,495,200
木曽路	22,800	2,415.00	55,062,000
S R S ホールディングス	23,000	815.00	18,745,000
リテールパートナーズ	21,300	1,200.00	25,560,000
ケーヨー	32,200	851.00	27,402,200
上新電機	20,000	2,662.00	53,240,000
日本瓦斯	84,800	1,838.00	155,862,400
ロイヤルホールディングス	30,200	2,065.00	62,363,000
いなげや	19,400	1,467.00	28,459,800
チヨダ	18,200	883.00	16,070,600
ライフコーポレーション	17,100	3,390.00	57,969,000
リンガーハット	21,300	2,339.00	49,820,700
MrMaxHD	24,400	646.00	15,762,400
AOKIホールディングス	34,900	673.00	23,487,700
オークワ	27,300	1,095.00	29,893,500
コメリ	26,800	2,616.00	70,108,800
青山商事	39,000	749.00	29,211,000
しまむら	20,200	10,120.00	204,424,000
はせがわ	10,700	276.00	2,953,200
高島屋	126,100	1,264.00	159,390,400
松屋	37,900	1,028.00	38,961,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	82,100	949.00	77,912,900
近鉄百貨店	6,700	3,165.00	21,205,500
丸井グループ	146,300	2,090.00	305,767,000
アクシアル リテイリング	14,500	3,825.00	55,462,500
イオン	665,300	2,929.00	1,948,663,700
イズミ	35,200	4,095.00	144,144,000
平和堂	32,000	2,052.00	65,664,000
フジ	21,000	1,946.00	40,866,000
ヤオコー	19,700	6,230.00	122,731,000
ゼビオホールディングス	21,300	1,005.00	21,406,500
ケーズホールディングス	147,500	1,243.00	183,342,500
Olympicグループ	9,500	760.00	7,220,000
日産東京販売ホールディングス	27,100	242.00	6,558,200
シルバーライフ	3,700	2,059.00	7,618,300
Genky DrugStores	7,700	4,095.00	31,531,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,700	1,119.00	4,140,300
ブックオフグループホールディングス	10,100	972.00	9,817,200
ギフト	2,300	2,416.00	5,556,800

アインホールディングス	25,200	6,650.00	167,580,000
元気寿司	5,000	2,546.00	12,730,000
ヤマダホールディングス	580,200	502.00	291,260,400
アークランドサカモト	27,300	1,474.00	40,240,200
ニトリホールディングス	68,600	19,695.00	1,351,077,000
グルメ杵屋	12,800	969.00	12,403,200
愛眼	13,800	226.00	3,118,800
ケーユーホールディングス	9,500	960.00	9,120,000
吉野家ホールディングス	57,000	2,142.00	122,094,000
松屋フーズホールディングス	8,400	3,610.00	30,324,000
サガミホールディングス	24,900	1,024.00	25,497,600
関西スーパーマーケット	13,500	992.00	13,392,000
王将フードサービス	11,500	5,840.00	67,160,000
プレナス	19,600	2,075.00	40,670,000
ミニストップ	12,900	1,393.00	17,969,700
アークス	33,200	2,218.00	73,637,600
パローホールディングス	35,500	2,206.00	78,313,000
ベルク	8,600	5,180.00	44,548,000
大庄	9,600	1,067.00	10,243,200
ファーストリテイリング	23,100	80,610.00	1,862,091,000
サンドラッグ	65,200	3,485.00	227,222,000
サックスパーホールディングス	15,300	617.00	9,440,100
ヤマザワ	4,300	1,705.00	7,331,500
やまや	3,500	2,315.00	8,102,500
ベルーナ	37,500	932.00	34,950,000
島根銀行	6,000	617.00	3,702,000
じもとホールディングス	11,700	642.00	7,511,400
めぶきフィナンシャルグループ	899,500	237.00	213,181,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	1,524.00	33,070,800
九州フィナンシャルグループ	353,500	394.00	139,279,000
ゆうちょ銀行	490,500	928.00	455,184,000
富山第一銀行	41,300	278.00	11,481,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,054,700	401.00	422,934,700
西日本フィナンシャルホールディングス	113,100	628.00	71,026,800
三十三フィナンシャルグループ	15,000	1,382.00	20,730,000
第四北越フィナンシャルグループ	28,200	2,429.00	68,497,800
ひろぎんホールディングス	255,300	588.00	150,116,400
新生銀行	141,200	1,466.00	206,999,200
あおぞら銀行	103,100	2,485.00	256,203,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,842,500	593.10	7,023,786,750
りそなホールディングス	1,997,900	420.80	840,716,320
三井住友トラスト・ホールディングス	327,200	3,558.00	1,164,177,600

三井住友フィナンシャルグループ	1,198,100	3,769.00	4,515,638,900
千葉銀行	577,700	652.00	376,660,400
群馬銀行	356,300	349.00	124,348,700
武蔵野銀行	25,800	1,695.00	43,731,000
千葉興業銀行	44,100	257.00	11,333,700
筑波銀行	72,000	172.00	12,384,000
七十七銀行	54,300	1,171.00	63,585,300
青森銀行	13,400	2,113.00	28,314,200
秋田銀行	10,400	1,411.00	14,674,400
山形銀行	19,500	860.00	16,770,000
岩手銀行	11,300	1,716.00	19,390,800
東邦銀行	154,800	212.00	32,817,600
東北銀行	8,300	1,010.00	8,383,000
みちのく銀行	11,100	914.00	10,145,400
ふくおかフィナンシャルグループ	156,200	1,876.00	293,031,200
静岡銀行	421,600	831.00	350,349,600
十六銀行	21,700	1,953.00	42,380,100
スルガ銀行	151,800	326.00	49,486,800
八十二銀行	389,900	359.00	139,974,100
山梨中央銀行	20,100	825.00	16,582,500
大垣共立銀行	34,200	1,870.00	63,954,000
福井銀行	14,800	1,396.00	20,660,800
北國銀行	16,100	2,132.00	34,325,200
清水銀行	7,100	1,542.00	10,948,200
富山銀行	3,300	2,257.00	7,448,100
滋賀銀行	34,700	1,934.00	67,109,800
南都銀行	25,200	1,874.00	47,224,800
百五銀行	155,800	310.00	48,298,000
京都銀行	62,000	4,955.00	307,210,000
紀陽銀行	61,300	1,502.00	92,072,600
ほくほくフィナンシャルグループ	115,200	806.00	92,851,200
山陰合同銀行	109,100	547.00	59,677,700
中国銀行	149,000	870.00	129,630,000
鳥取銀行	5,500	1,118.00	6,149,000
伊予銀行	229,400	546.00	125,252,400
百十四銀行	18,400	1,511.00	27,802,400
四国銀行	24,500	702.00	17,199,000
阿波銀行	26,500	2,051.00	54,351,500
大分銀行	10,000	1,703.00	17,030,000
宮崎銀行	10,800	2,004.00	21,643,200
佐賀銀行	9,800	1,372.00	13,445,600
沖縄銀行	15,900	2,548.00	40,513,200

琉球銀行	37,600	716.00	26,921,600
セブン銀行	578,400	234.00	135,345,600
みずほフィナンシャルグループ	2,352,400	1,586.50	3,732,082,600
高知銀行	6,300	807.00	5,084,100
山口フィナンシャルグループ	216,100	633.00	136,791,300
長野銀行	5,700	1,087.00	6,195,900
名古屋銀行	13,900	2,522.00	35,055,800
北洋銀行	261,000	239.00	62,379,000
愛知銀行	5,800	2,831.00	16,419,800
中京銀行	6,200	1,430.00	8,866,000
大光銀行	5,900	1,319.00	7,782,100
愛媛銀行	24,200	766.00	18,537,200
トマト銀行	6,700	1,032.00	6,914,400
京葉銀行	73,800	411.00	30,331,800
栃木銀行	83,600	172.00	14,379,200
北日本銀行	5,400	1,628.00	8,791,200
東和銀行	30,400	497.00	15,108,800
福島銀行	19,800	237.00	4,692,600
大東銀行	8,300	613.00	5,087,900
トモニホールディングス	133,800	297.00	39,738,600
フィデアホールディングス	168,100	122.00	20,508,200
池田泉州ホールディングス	199,100	160.00	31,856,000
F P G	58,600	746.00	43,715,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,800	1,506.00	17,770,800
マーキュリアホールディングス	7,100	737.00	5,232,700
S B I ホールディングス	213,400	2,630.00	561,242,000
ジャフコ グループ	24,800	6,460.00	160,208,000
大和証券グループ本社	1,297,000	575.80	746,812,600
野村ホールディングス	2,643,700	552.20	1,459,851,140
岡三証券グループ	148,100	422.00	62,498,200
丸三証券	51,900	621.00	32,229,900
東洋証券	58,700	158.00	9,274,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,300	393.00	72,822,900
光世証券	4,600	588.00	2,704,800
水戸証券	47,100	300.00	14,130,000
いちよし証券	35,100	592.00	20,779,200
松井証券	85,100	819.00	69,696,900
マネックスグループ	155,600	719.00	111,876,400
極東証券	23,500	835.00	19,622,500
岩井コスモホールディングス	17,900	1,673.00	29,946,700
藍澤証券	31,300	1,060.00	33,178,000
マネーパートナーズグループ	19,600	226.00	4,429,600

スパークス・グループ	81,000	254.00	20,574,000
かんぽ生命保険	214,600	1,980.00	424,908,000
S O M P Oホールディングス	305,200	4,341.00	1,324,873,200
アニコム ホールディングス	48,700	899.00	43,781,300
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	420,400	3,309.00	1,391,103,600
第一生命ホールディングス	852,000	1,962.00	1,671,624,000
東京海上ホールディングス	570,200	5,139.00	2,930,257,800
T & Dホールディングス	517,400	1,407.00	727,981,800
アドバンスクリエイト	8,300	980.00	8,134,000
全国保証	45,100	4,930.00	222,343,000
あんしん保証	6,700	336.00	2,251,200
イントラスト	5,300	677.00	3,588,100
日本モーゲージサービス	9,100	1,012.00	9,209,200
C a s a	5,100	989.00	5,043,900
アルヒ	25,700	1,425.00	36,622,500
プレミアグループ	8,100	3,465.00	28,066,500
クレディセゾン	101,300	1,347.00	136,451,100
芙蓉総合リース	18,200	7,080.00	128,856,000
みずほリース	26,800	3,605.00	96,614,000
東京センチュリー	40,300	6,000.00	241,800,000
日本証券金融	73,600	824.00	60,646,400
アイフル	291,200	371.00	108,035,200
リコーリース	13,700	3,460.00	47,402,000
イオンフィナンシャルサービス	106,100	1,382.00	146,630,200
アコム	348,500	470.00	163,795,000
ジャックス	19,200	2,575.00	49,440,000
オリエントコーポレーション	470,100	148.00	69,574,800
オリックス	1,051,100	1,890.50	1,987,104,550
三菱H C キャピタル	599,200	600.00	359,520,000
九州リースサービス	8,900	649.00	5,776,100
日本取引所グループ	467,800	2,509.50	1,173,944,100
イー・ギャランティ	20,400	2,376.00	48,470,400
アサックス	9,400	684.00	6,429,600
N E C キャピタルソリューション	7,200	2,162.00	15,566,400
いちご	197,200	364.00	71,780,800
日本駐車場開発	199,500	168.00	33,516,000
スター・マイカ・ホールディングス	10,300	1,197.00	12,329,100
S R E ホールディングス	2,800	7,390.00	20,692,000
A Dワークスグループ	35,100	157.00	5,510,700
ヒューリック	368,500	1,275.00	469,837,500
三栄建築設計	7,700	2,044.00	15,738,800
野村不動産ホールディングス	99,900	2,779.00	277,622,100

三重交通グループホールディングス	38,500	472.00	18,172,000
サムティ	25,300	2,297.00	58,114,100
ディア・ライフ	25,700	476.00	12,233,200
日本商業開発	11,900	1,719.00	20,456,100
プレサンスコーポレーション	29,600	1,551.00	45,909,600
ハウスコム	4,300	1,235.00	5,310,500
日本管理センター	10,600	1,300.00	13,780,000
サンセイランディック	6,900	874.00	6,030,600
フージャースホールディングス	28,200	747.00	21,065,400
オープンハウス	55,300	5,320.00	294,196,000
東急不動産ホールディングス	473,200	655.00	309,946,000
飯田グループホールディングス	145,000	2,670.00	387,150,000
イーランド	4,400	1,033.00	4,545,200
ムゲンエステート	13,800	509.00	7,024,200
ハウズドゥ	8,500	1,007.00	8,559,500
シーアールイー	5,500	1,587.00	8,728,500
グッドコムアセット	9,400	1,458.00	13,705,200
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,905.00	14,058,000
テンポイノベーション	6,700	895.00	5,996,500
フェイスネットワーク	2,600	1,365.00	3,549,000
パーク24	93,700	2,067.00	193,677,900
パラカ	5,400	1,700.00	9,180,000
三井不動産	789,700	2,686.00	2,121,134,200
三菱地所	1,138,200	1,781.50	2,027,703,300
平和不動産	30,100	3,805.00	114,530,500
東京建物	172,000	1,648.00	283,456,000
ダイビル	45,000	1,439.00	64,755,000
京阪神ビルディング	31,000	1,432.00	44,392,000
住友不動産	389,600	3,842.00	1,496,843,200
テーオーシー	36,400	677.00	24,642,800
東京楽天地	3,200	4,150.00	13,280,000
スターツコーポレーション	21,200	2,898.00	61,437,600
フジ住宅	22,600	634.00	14,328,400
空港施設	20,100	588.00	11,818,800
明和地所	10,800	630.00	6,804,000
ゴールドクレスト	16,600	1,680.00	27,888,000
エスリード	7,800	1,600.00	12,480,000
日神グループホールディングス	29,100	466.00	13,560,600
日本エスコン	31,400	773.00	24,272,200
タカラレーベン	72,500	346.00	25,085,000
A V A N T I A	10,700	910.00	9,737,000
イオンモール	87,700	1,678.00	147,160,600

毎日コムネット	8,100	731.00	5,921,100
ファースト住建	8,700	1,169.00	10,170,300
カチタス	43,400	3,260.00	141,484,000
トーセイ	25,300	1,199.00	30,334,700
穴吹興産	4,600	1,982.00	9,117,200
サンフロンティア不動産	22,700	1,098.00	24,924,600
エフ・ジェー・ネクスト	18,600	1,037.00	19,288,200
インテリックス	3,900	710.00	2,769,000
ランドビジネス	7,300	330.00	2,409,000
サンネクスタグループ	7,100	985.00	6,993,500
グランディハウス	15,500	431.00	6,680,500
日本空港ビルデング	60,500	5,230.00	316,415,000
明豊ファシリティワークス	8,000	874.00	6,992,000
日本工営	10,400	3,080.00	32,032,000
L I F U L L	52,200	345.00	18,009,000
ミクシィ	42,700	2,807.00	119,858,900
ジェイエイシーリクルートメント	11,700	1,814.00	21,223,800
日本M&Aセンター	275,200	3,110.00	855,872,000
メンバーズ	5,100	3,410.00	17,391,000
中広	3,200	360.00	1,152,000
UTグループ	24,300	3,425.00	83,227,500
アイティメディア	5,800	2,079.00	12,058,200
タケエイ	18,900	1,734.00	32,772,600
E・Jホールディングス	9,100	1,095.00	9,964,500
夢真ビーネックスグループ	44,900	1,314.00	58,998,600
コシダカホールディングス	45,300	628.00	28,448,400
アルトナー	4,400	846.00	3,722,400
パソナグループ	18,300	2,338.00	42,785,400
C D S	4,400	1,550.00	6,820,000
リンクアンドモチベーション	30,800	878.00	27,042,400
G C A	22,300	1,091.00	24,329,300
エス・エム・エス	57,100	3,375.00	192,712,500
サニーサイドアップグループ	6,200	738.00	4,575,600
パーソルホールディングス	167,800	2,290.00	384,262,000
リニカル	9,800	989.00	9,692,200
クックパッド	54,000	253.00	13,662,000
アイ・ケイ・ケイ	8,600	680.00	5,848,000
学情	6,200	1,338.00	8,295,600
スタジオアリス	8,600	2,542.00	21,861,200
シミックホールディングス	9,500	1,571.00	14,924,500
エプコ	4,400	875.00	3,850,000
N J S	4,300	1,930.00	8,299,000



総合警備保障	66,800	5,020.00	335,336,000	
カカクコム	124,000	3,240.00	401,760,000	
アイロムグループ	6,000	2,019.00	12,114,000	
セントケア・ホールディング	12,600	985.00	12,411,000	
サイネックス	3,300	700.00	2,310,000	
ルネサンス	10,700	1,337.00	14,305,900	
ディップ	26,300	3,545.00	93,233,500	
デジタルホールディングス	11,800	2,233.00	26,349,400	
新日本科学	20,800	1,031.00	21,444,800	
キャリアデザインセンター	4,500	1,078.00	4,851,000	
ベネフィット・ワン	61,100	3,435.00	209,878,500	
エムスリー	296,000	7,807.00	2,310,872,000	
ツカダ・グローバルホールディング	13,300	385.00	5,120,500	
アウトソーシング	96,200	2,138.00	205,675,600	
ウェルネット	17,500	525.00	9,187,500	
ワールドホールディングス	5,800	3,190.00	18,502,000	
ディー・エヌ・エー	71,100	2,264.00	160,970,400	
博報堂D Yホールディングス	233,600	1,726.00	403,193,600	
ぐるなび	29,800	544.00	16,211,200	
タカミヤ	20,900	525.00	10,972,500	
ジャパンベストレスキューシステム	11,300	953.00	10,768,900	
ファンコミュニケーションズ	46,900	398.00	18,666,200	
ライク	4,600	2,147.00	9,876,200	
ビジネス・ブレークスルー	7,800	418.00	3,260,400	
エスプール	43,400	1,033.00	44,832,200	
WDBホールディングス	7,800	3,050.00	23,790,000	
手間いらず	2,200	6,390.00	14,058,000	
ティア	10,500	469.00	4,924,500	
C D G	1,700	1,590.00	2,703,000	
アドウェイズ	27,600	824.00	22,742,400	
バリューコマース	11,400	3,115.00	35,511,000	
インフォマート	170,000	938.00	159,460,000	
J Pホールディングス	49,100	273.00	13,404,300	
エコナックホールディングス	34,000	90.00	3,060,000	
レッグス	4,300	2,631.00	11,313,300	
プレステージ・インターナショナル	63,300	734.00	46,462,200	
アミューズ	9,300	2,378.00	22,115,400	
ドリームインキュベータ	5,400	989.00	5,340,600	
クイック	10,700	1,213.00	12,979,100	
T A C	10,500	232.00	2,436,000	
電通グループ	188,700	4,005.00	755,743,500	
イオンファンタジー	6,600	2,154.00	14,216,400	

シーティーエス	19,300	835.00	16,115,500
ネクシィーズグループ	6,200	919.00	5,697,800
H.U.グループホールディングス	47,100	2,832.00	133,387,200
アルプス技研	15,000	1,999.00	29,985,000
ダイオーズ	3,600	1,044.00	3,758,400
日本空調サービス	18,000	725.00	13,050,000
オリエンタルランド	178,400	16,090.00	2,870,456,000
ダスキン	39,000	2,568.00	100,152,000
明光ネットワークジャパン	20,200	588.00	11,877,600
ファルコホールディングス	8,200	1,684.00	13,808,800
ラウンドワン	57,400	1,425.00	81,795,000
リゾートトラスト	77,100	1,868.00	144,022,800
ビー・エム・エル	21,700	3,905.00	84,738,500
りらいあコミュニケーションズ	25,700	1,384.00	35,568,800
リソー教育	86,100	333.00	28,671,300
早稲田アカデミー	7,500	934.00	7,005,000
ユー・エス・エス	187,900	1,889.00	354,943,100
東京個別指導学院	15,300	619.00	9,470,700
サイバーエージェント	413,500	2,329.00	963,041,500
楽天グループ	783,900	1,328.00	1,041,019,200
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,713.00	15,417,000
モーニングスター	25,100	470.00	11,797,000
テー・オー・ダブリュー	30,300	321.00	9,726,300
山田コンサルティンググループ	10,000	1,200.00	12,000,000
セントラルスポーツ	6,400	2,450.00	15,680,000
フルキャストホールディングス	14,400	2,300.00	33,120,000
エン・ジャパン	29,900	3,920.00	117,208,000
リソルホールディングス	1,900	3,985.00	7,571,500
テクノプロ・ホールディングス	100,600	2,735.00	275,141,000
アトラグループ	3,900	331.00	1,290,900
インターワークス	5,600	415.00	2,324,000
アイ・アールジャパンホールディングス	6,800	14,460.00	98,328,000
Keeper 技研	10,900	3,005.00	32,754,500
ファーストロジック	3,700	790.00	2,923,000
三機サービス	3,600	1,077.00	3,877,200
Gunosy	10,800	921.00	9,946,800
デザインワン・ジャパン	5,500	245.00	1,347,500
イー・ガーディアン	6,900	2,814.00	19,416,600
リブセンス	10,700	220.00	2,354,000
ジャパンマテリアル	51,800	1,352.00	70,033,600
ベクトル	21,200	945.00	20,034,000
ウチヤマホールディングス	9,100	372.00	3,385,200

チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,196.00	15,189,200
キャリアリンク	5,600	2,093.00	11,720,800
I B J	14,000	1,155.00	16,170,000
アサンテ	6,200	1,764.00	10,936,800
バリューHR	6,900	1,677.00	11,571,300
M & Aキャピタルパートナーズ	13,900	5,660.00	78,674,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,397.00	9,359,900
E R Iホールディングス	5,200	654.00	3,400,800
アビスト	2,700	2,988.00	8,067,600
シグマクシス	9,300	2,359.00	21,938,700
ウィルグループ	12,600	1,010.00	12,726,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	26,100	250.00	6,525,000
メドピア	13,000	4,445.00	57,785,000
レアジョブ	3,300	1,700.00	5,610,000
リクルートホールディングス	1,201,500	5,709.00	6,859,363,500
エラン	23,400	1,273.00	29,788,200
土木管理総合試験所	9,000	399.00	3,591,000
ネットマーケティング	8,900	401.00	3,568,900
日本郵政	1,269,400	921.50	1,169,752,100
ベルシステム24ホールディングス	28,300	1,792.00	50,713,600
鎌倉新書	17,200	1,007.00	17,320,400
S M N	4,000	797.00	3,188,000
グローバルキッズCOMPANY	3,400	986.00	3,352,400
エアトリ	10,600	2,783.00	29,499,800
アトラエ	11,800	2,311.00	27,269,800
ストライク	6,400	3,780.00	24,192,000
ソラスト	41,400	1,411.00	58,415,400
セラク	5,400	2,176.00	11,750,400
インソース	16,400	2,557.00	41,934,800
ベйкаレント・コンサルティング	11,000	35,750.00	393,250,000
Orchestra Holdings	3,800	2,995.00	11,381,000
アイモバイル	5,000	1,573.00	7,865,000
キャリアインデックス	7,200	935.00	6,732,000
MS - Japan	7,100	1,227.00	8,711,700
船場	3,700	833.00	3,082,100
グレイステクノロジー	17,200	1,574.00	27,072,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,500	2,561.00	124,208,500
フルテック	2,600	1,369.00	3,559,400
GameWith	5,500	589.00	3,239,500
ソウルドアウト	4,200	1,773.00	7,446,600
MS & Consulting	3,200	601.00	1,923,200
ウェルビー	6,400	1,362.00	8,716,800

エル・ティー・エス	1,700	4,080.00	6,936,000	
ミダック	7,400	4,340.00	32,116,000	
日総工産	13,500	834.00	11,259,000	
キュービーネットホールディングス	7,900	1,672.00	13,208,800	
R P Aホールディングス	20,600	779.00	16,047,400	
スプリックス	5,000	1,200.00	6,000,000	
マネジメントソリューションズ	8,300	2,889.00	23,978,700	
プロレド・パートナーズ	3,200	2,797.00	8,950,400	
テノ・ホールディングス	2,100	1,184.00	2,486,400	
フロンティア・マネジメント	4,000	1,140.00	4,560,000	
ピアラ	1,500	1,043.00	1,564,500	
コプロ・ホールディングス	2,400	1,376.00	3,302,400	
ギークス	3,000	1,888.00	5,664,000	
カーブスホールディングス	46,400	982.00	45,564,800	
フォーラムエンジニアリング	12,000	935.00	11,220,000	
ダイレクトマーケティングミックス	9,000	3,930.00	35,370,000	
ポピンズホールディングス	4,500	4,640.00	20,880,000	
L I T A L I C O	6,800	5,440.00	36,992,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,800	1,106.00	9,732,800	
リログループ	91,800	2,474.00	227,113,200	
東祥	10,600	1,961.00	20,786,600	
エイチ・アイ・エス	26,800	2,600.00	69,680,000	
ラックランド	4,900	2,702.00	13,239,800	
共立メンテナンス	27,900	3,875.00	108,112,500	
イチネンホールディングス	17,700	1,237.00	21,894,900	
建設技術研究所	10,900	2,345.00	25,560,500	
スペース	11,200	900.00	10,080,000	
長大	6,800	1,945.00	13,226,000	
燦ホールディングス	7,600	1,239.00	9,416,400	
スバル興業	1,100	8,170.00	8,987,000	
東京テアトル	6,600	1,258.00	8,302,800	
タナベ経営	3,400	1,422.00	4,834,800	
ナガワ	5,400	8,710.00	47,034,000	
東京都競馬	11,000	4,540.00	49,940,000	
カナモト	29,700	2,564.00	76,150,800	
西尾レントオール	15,600	3,075.00	47,970,000	
トランス・コスモス	16,100	3,115.00	50,151,500	
乃村工藝社	72,200	885.00	63,897,000	
藤田観光	6,700	2,308.00	15,463,600	
K N T - C Tホールディングス	8,900	1,318.00	11,730,200	
日本管財	18,100	2,567.00	46,462,700	
トーカイ	16,300	2,426.00	39,543,800	

セコム	165,300	8,521.00	1,408,521,300
セントラル警備保障	8,200	3,070.00	25,174,000
丹青社	32,000	882.00	28,224,000
メイテック	20,300	6,210.00	126,063,000
応用地質	19,100	1,304.00	24,906,400
船井総研ホールディングス	34,500	2,497.00	86,146,500
進学会ホールディングス	7,300	424.00	3,095,200
オオバ	12,200	826.00	10,077,200
いであ	4,300	1,807.00	7,770,100
学究社	5,100	1,363.00	6,951,300
ベネッセホールディングス	61,600	2,753.00	169,584,800
イオンディライト	20,800	3,640.00	75,712,000
ナック	8,300	915.00	7,594,500
ダイセキ	28,200	4,895.00	138,039,000
ステップ	6,300	1,675.00	10,552,500
合計	184,040,800		470,454,256,330

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	104,165,218
株式	4,587,956,440
未収配当金	10,906,269
前払金	435,000
差入委託証拠金	6,000,000
流動資産合計	4,709,462,927
資産合計	4,709,462,927
負債の部	

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	438,300
未払利息	158
流動負債合計	438,458
負債合計	438,458
純資産の部	
元本等	
元本	4,074,360,095
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	634,664,374
元本等合計	4,709,024,469
純資産合計	4,709,024,469
負債純資産合計	4,709,462,927

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,074,360,095口

	2021年 7月12日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1558円 (11,558円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2021年 7月12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>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	6,847,563,625円
期中追加設定元本額	204,212,852円
期中一部解約元本額	2,977,416,382円
期末元本額	4,074,360,095円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	948,216,705円
分散投資コア戦略ファンドS	3,126,143,390円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2021年 7月12日現在



種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	75,516,645
合計	75,516,645

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	117,465,000	-	117,030,000	435,000
	合計	117,465,000	-	117,030,000	435,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大成建設	2,300	3,790.00	8,717,000	
大東建託	2,000	13,060.00	26,120,000	
積水ハウス	20,500	2,293.00	47,006,500	
ヤクルト本社	1,600	6,460.00	10,336,000	
明治ホールディングス	5,200	6,800.00	35,360,000	
麒麟ホールディングス	8,700	2,111.50	18,370,050	
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,155.00	45,289,500	
味の素	16,600	2,879.50	47,799,700	
東洋水産	7,000	4,235.00	29,645,000	
日清食品ホールディングス	1,900	7,920.00	15,048,000	
日本たばこ産業	28,800	2,120.00	61,056,000	
信越化学工業	1,400	18,310.00	25,634,000	
J S R	3,600	3,565.00	12,834,000	
花王	7,100	6,802.00	48,294,200	

日本ペイントホールディングス	5,700	1,381.00	7,871,700
関西ペイント	9,300	2,783.00	25,881,900
富士フイルムホールディングス	9,300	8,190.00	76,167,000
資生堂	800	8,000.00	6,400,000
ライオン	12,400	1,973.00	24,465,200
小林製薬	1,900	9,390.00	17,841,000
日東電工	1,200	8,290.00	9,948,000
ユニ・チャーム	9,600	4,482.00	43,027,200
協和キリン	7,100	3,990.00	28,329,000
武田薬品工業	11,600	3,698.00	42,896,800
アステラス製薬	33,300	1,918.50	63,886,050
塩野義製薬	7,600	5,824.00	44,262,400
中外製薬	14,600	4,238.00	61,874,800
エーザイ	1,500	10,530.00	15,795,000
小野薬品工業	15,200	2,524.50	38,372,400
参天製薬	2,600	1,541.00	4,006,600
第一三共	5,300	2,309.00	12,237,700
大塚ホールディングス	5,300	4,390.00	23,267,000
ペプチドリーム	3,700	4,910.00	18,167,000
出光興産	800	2,622.00	2,097,600
ブリヂストン	14,200	4,960.00	70,432,000
リンナイ	2,800	10,530.00	29,484,000
S M C	500	67,860.00	33,930,000
クボタ	7,500	2,272.50	17,043,750
ダイキン工業	2,300	22,025.00	50,657,500
ホシザキ	1,200	9,420.00	11,304,000
マキタ	1,600	5,500.00	8,800,000
東芝	4,300	4,935.00	21,220,500
三菱電機	22,600	1,484.50	33,549,700
日本電産	1,800	13,115.00	23,607,000
日本電気	9,000	5,660.00	50,940,000
富士通	3,900	21,165.00	82,543,500
ソニーグループ	3,900	11,485.00	44,791,500
ヒロセ電機	2,300	16,580.00	38,134,000
アズビル	4,700	4,580.00	21,526,000
キーエンス	1,300	58,470.00	76,011,000
シスメックス	3,900	13,100.00	51,090,000
ファナック	400	27,535.00	11,014,000
浜松ホトニクス	6,300	6,660.00	41,958,000
京セラ	5,900	6,833.00	40,314,700
村田製作所	8,100	9,113.00	73,815,300
キヤノン	22,800	2,505.00	57,114,000

東京エレクトロン	400	46,710.00	18,684,000
トヨタ自動車	7,700	9,815.00	75,575,500
シマノ	1,900	28,460.00	54,074,000
テルモ	10,700	4,412.00	47,208,400
島津製作所	1,700	4,400.00	7,480,000
オリンパス	12,200	2,226.00	27,157,200
H O Y A	5,000	15,030.00	75,150,000
朝日インテック	9,200	2,835.00	26,082,000
バンダイナムコホールディングス	5,000	7,411.00	37,055,000
任天堂	1,000	63,720.00	63,720,000
中部電力	30,800	1,336.00	41,148,800
東北電力	23,200	861.00	19,975,200
東京瓦斯	21,400	2,058.50	44,051,900
大阪瓦斯	22,500	2,024.00	45,540,000
東邦瓦斯	4,700	5,560.00	26,132,000
東武鉄道	3,800	2,925.00	11,115,000
東急	10,700	1,582.00	16,927,400
小田急電鉄	13,100	2,842.00	37,230,200
京王電鉄	2,500	6,560.00	16,400,000
京成電鉄	700	3,645.00	2,551,500
東日本旅客鉄道	7,100	8,099.00	57,502,900
東海旅客鉄道	2,700	17,185.00	46,399,500
近鉄グループホールディングス	4,300	4,000.00	17,200,000
阪急阪神ホールディングス	3,000	3,505.00	10,515,000
日本通運	500	8,240.00	4,120,000
ヤマトホールディングス	1,600	3,370.00	5,392,000
S Gホールディングス	19,000	3,015.00	57,285,000
T I S	1,000	2,913.00	2,913,000
コーエーテクモホールディングス	6,000	5,130.00	30,780,000
ネクソン	9,600	2,325.00	22,320,000
G M Oペイメントゲートウェイ	500	14,090.00	7,045,000
野村総合研究所	5,400	3,640.00	19,656,000
オービック	3,000	20,800.00	62,400,000
Zホールディングス	64,400	559.70	36,044,680
日本オラクル	2,800	8,230.00	23,044,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,500	3,460.00	25,950,000
大塚商会	3,500	5,830.00	20,405,000
日本電信電話	23,300	2,882.00	67,150,600
K D D I	18,800	3,492.00	65,649,600
ソフトバンク	46,400	1,470.00	68,208,000
光通信	700	20,610.00	14,427,000
東宝	14,600	4,640.00	67,744,000

エヌ・ティ・ティ・データ	17,100	1,754.00	29,993,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,500	5,280.00	7,920,000
カブコン	6,000	3,095.00	18,570,000
コナミホールディングス	1,000	6,300.00	6,300,000
ソフトバンクグループ	300	7,540.00	2,262,000
メディカルホールディングス	3,100	2,163.00	6,705,300
伊藤忠商事	20,100	3,245.00	65,224,500
三井物産	13,800	2,562.50	35,362,500
住友商事	12,300	1,495.50	18,394,650
三菱商事	21,200	3,104.00	65,804,800
ローソン	7,300	5,320.00	38,836,000
エービーシー・マート	7,000	6,410.00	44,870,000
日本マクドナルドホールディングス	13,200	4,935.00	65,142,000
MonotaRO	9,100	2,639.00	24,014,900
ウエルシアホールディングス	5,800	3,375.00	19,575,000
コスモス薬品	1,300	16,220.00	21,086,000
セブン&アイ・ホールディングス	11,500	5,088.00	58,512,000
ツルハホールディングス	1,400	12,550.00	17,570,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	19,800	2,409.00	47,698,200
ヤマダホールディングス	74,300	502.00	37,298,600
ニトリホールディングス	3,400	19,695.00	66,963,000
ファーストリテイリング	500	80,610.00	40,305,000
ゆうちょ銀行	69,000	928.00	64,032,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,100	593.10	4,211,010
三井住友フィナンシャルグループ	7,400	3,769.00	27,890,600
みずほフィナンシャルグループ	39,900	1,586.50	63,301,350
MS&ADインシュアランスグループホール ディングス	7,800	3,309.00	25,810,200
東京海上ホールディングス	9,100	5,139.00	46,764,900
日本取引所グループ	6,400	2,509.50	16,060,800
ヒューリック	3,900	1,275.00	4,972,500
三菱地所	5,400	1,781.50	9,620,100
総合警備保障	2,900	5,020.00	14,558,000
カカクコム	2,800	3,240.00	9,072,000
エムスリー	4,100	7,807.00	32,008,700
オリエンタルランド	3,800	16,090.00	61,142,000
ユー・エス・エス	8,300	1,889.00	15,678,700
サイバーエージェント	4,700	2,329.00	10,946,300
日本郵政	70,400	921.50	64,873,600
セコム	7,700	8,521.00	65,611,700
合 計	1,353,300		4,587,956,440

## (2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	442,138,844
国債証券	533,580,074,950
地方債証券	35,339,271,681
特殊債証券	38,784,778,879
社債証券	28,630,487,400
未収入金	667,176,600
未収利息	957,454,636
前払費用	32,359,260
流動資産合計	638,433,742,250
資産合計	638,433,742,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,330
未払金	400,000,000
未払解約金	268,932,598
未払利息	674
流動負債合計	668,953,602
負債合計	668,953,602
純資産の部	
元本等	
元本	451,320,574,372
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	186,444,214,276
元本等合計	637,764,788,648
純資産合計	637,764,788,648
負債純資産合計	638,433,742,250

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	451,320,574,372口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,448,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4131円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,131円)</p>

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

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2021年 7月12日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	389,699,865,102円
期中追加設定元本額	79,441,906,807円
期中一部解約元本額	17,821,197,537円
期末元本額	451,320,574,372円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,724,002,646円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,063,849円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,688,451,166円
世界経済インデックスファンド	2,570,658,927円
D C マイセレクション 2 5	24,406,733,173円
D C マイセレクション 5 0	27,657,088,880円
D C マイセレクション 7 5	8,034,146,971円
D C 日本債券インデックス・オープン	434,702,091円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,819,132,295円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,685,591,593円
D C マイセレクション S 2 5	11,501,292,292円
D C マイセレクション S 5 0	12,686,861,174円
D C マイセレクション S 7 5	2,666,058,041円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	984,543,696円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,933,389,576円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	694,197,901円
D C 世界経済インデックスファンド	2,969,272,367円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,115,887円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,651,160円



区分	2021年 7月12日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	40,798,833円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,005,829円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,015,770円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	125,022,265円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	190,480,931円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	38,516,323円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	36,132,335円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,450,558,458円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	816,321,030円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,438,962,716円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	360,876,295円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	84,414,571円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,095,773,480円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,261,525,395円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,536,116,467円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	146,833,416円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,236,909,628円
日本債券ファンド・シリーズ1	14,761,258,274円
分散投資コア戦略ファンドA	27,289,857,382円
分散投資コア戦略ファンドS	27,893,146,983円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	134,052,133円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,249,896,125円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	55,719,502円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	33,597,397円
SMT インデックスバランス・オープン	57,822,060円
SMT 世界経済インデックス・オープン	24,414,905円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	43,740,760円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	69,224,731円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,757,016円
グローバル経済コア	194,450,156円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	22,101,633円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	12,458,524円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	6,456,128円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,115,136円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	957,370円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	425,366円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	78,057,141,769円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	45,536,355円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,477,216,850	
地方債証券	69,434,445	
特殊債券	58,208,969	
社債券	69,373,240	
合計	1,674,233,504	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	152,210,000	-	152,190,000	20,000
合計		152,210,000	-	152,190,000	20,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第4 1 5 回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,062,395,600	
	第4 1 6 回利付国債(2年)	4,530,000,000	4,541,325,000	
	第4 1 7 回利付国債(2年)	4,240,000,000	4,251,617,600	
	第4 1 8 回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,043,047,200	
	第4 1 9 回利付国債(2年)	570,000,000	571,778,400	
	第4 2 0 回利付国債(2年)	1,250,000,000	1,254,137,500	
	第4 2 1 回利付国債(2年)	590,000,000	592,065,000	

第422回利付国債(2年)	130,000,000	130,478,400	
第423回利付国債(2年)	370,000,000	370,825,100	
第424回利付国債(2年)	570,000,000	571,333,800	
第425回利付国債(2年)	2,870,000,000	2,876,773,200	
第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,391,169,000	
第134回利付国債(5年)	5,700,000,000	5,718,012,000	
第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,095,136,800	
第136回利付国債(5年)	4,400,000,000	4,418,788,000	
第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,793,326,800	
第138回利付国債(5年)	6,950,000,000	6,989,893,000	
第139回利付国債(5年)	6,070,000,000	6,108,423,100	
第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	6,343,596,000	
第141回利付国債(5年)	7,790,000,000	7,848,580,800	
第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,424,600,200	
第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,842,624,000	
第144回利付国債(5年)	6,520,000,000	6,581,940,000	
第145回利付国債(5年)	8,240,000,000	8,321,576,000	
第146回利付国債(5年)	2,590,000,000	2,616,573,400	
第147回利付国債(5年)	3,560,000,000	3,581,787,200	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	579,612,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,587,503,100	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	774,840,000	
第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,696,608,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,461,973,100	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,696,086,000	
第7回利付国債(40年)	1,040,000,000	1,347,080,800	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,489,038,000	
第9回利付国債(40年)	1,220,000,000	1,105,503,000	
第10回利付国債(40年)	2,370,000,000	2,512,508,100	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,839,547,200	
第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,586,726,100	
第13回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,887,061,200	
第14回利付国債(40年)	640,000,000	633,113,600	
第325回利付国債(10年)	4,590,000,000	4,639,985,100	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,156,628,800	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,232,044,200	
第328回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,592,848,500	
第329回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,267,009,600	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,938,361,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	914,220,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,885,104,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,089,569,800	

第334回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,965,316,200	
第335回利付国債(10年)	2,370,000,000	2,418,182,100	
第336回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,073,215,500	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,842,560,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,651,200,000	
第339回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,851,507,500	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,462,389,600	
第341回利付国債(10年)	3,440,000,000	3,506,013,600	
第342回利付国債(10年)	5,220,000,000	5,275,332,000	
第343回利付国債(10年)	4,820,000,000	4,872,634,400	
第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,716,227,200	
第345回利付国債(10年)	3,340,000,000	3,380,213,600	
第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	6,429,946,500	
第347回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,931,022,000	
第348回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,946,904,800	
第349回利付国債(10年)	4,130,000,000	4,187,572,200	
第350回利付国債(10年)	7,960,000,000	8,075,260,800	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,679,288,300	
第352回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,680,118,100	
第353回利付国債(10年)	4,300,000,000	4,366,048,000	
第354回利付国債(10年)	4,690,000,000	4,760,772,100	
第355回利付国債(10年)	4,270,000,000	4,331,359,900	
第356回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,571,245,800	
第357回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,836,792,000	
第358回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,837,905,600	
第359回利付国債(10年)	4,500,000,000	4,552,380,000	
第360回利付国債(10年)	5,740,000,000	5,800,729,200	
第361回利付国債(10年)	4,920,000,000	4,966,395,600	
第362回利付国債(10年)	4,730,000,000	4,768,880,600	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	135,777,400	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	193,804,800	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	144,816,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	139,911,200	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	60,717,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	435,186,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	223,471,800	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	417,781,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	275,750,400	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,582,400	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	309,069,800	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	235,476,500	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	492,160,000	

第14回利付国債(30年)	800,000,000	1,027,256,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	442,238,000
第16回利付国債(30年)	200,000,000	261,122,000
第17回利付国債(30年)	950,000,000	1,231,561,000
第18回利付国債(30年)	345,000,000	443,870,100
第19回利付国債(30年)	530,000,000	684,155,800
第20回利付国債(30年)	480,000,000	634,512,000
第21回利付国債(30年)	500,000,000	648,710,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	532,004,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	573,439,400
第24回利付国債(30年)	380,000,000	508,462,800
第25回利付国債(30年)	350,000,000	458,696,000
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,515,641,400
第27回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,393,358,600
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,906,548,000
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,250,608,900
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,366,490,000
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,456,708,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,100,867,600
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,359,975,800
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,399,915,000
第35回利付国債(30年)	2,240,000,000	2,920,400,000
第36回利付国債(30年)	2,160,000,000	2,825,625,600
第37回利付国債(30年)	2,190,000,000	2,828,910,600
第38回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,911,405,000
第39回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,945,905,000
第40回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,571,337,300
第41回利付国債(30年)	990,000,000	1,246,014,000
第42回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,889,820,000
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,753,054,100
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,540,213,400
第45回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,572,174,600
第46回利付国債(30年)	1,750,000,000	2,134,142,500
第47回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,752,813,300
第48回利付国債(30年)	1,880,000,000	2,254,834,400
第49回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,727,870,400
第50回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,920,862,500
第51回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,661,686,400
第52回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,888,856,300
第53回利付国債(30年)	880,000,000	889,812,000
第54回利付国債(30年)	2,110,000,000	2,231,219,500
第55回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,627,379,600
第56回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,772,080,800

第57回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,697,020,500	
第58回利付国債(30年)	2,600,000,000	2,738,502,000	
第59回利付国債(30年)	620,000,000	637,329,000	
第60回利付国債(30年)	2,580,000,000	2,777,137,800	
第61回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,701,101,600	
第62回利付国債(30年)	20,000,000	19,432,800	
第63回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,095,306,800	
第64回利付国債(30年)	2,510,000,000	2,363,315,600	
第65回利付国債(30年)	860,000,000	808,391,400	
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	965,408,700	
第67回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,392,826,200	
第68回利付国債(30年)	1,640,000,000	1,617,892,800	
第69回利付国債(30年)	930,000,000	940,323,000	
第70回利付国債(30年)	1,770,000,000	1,787,558,400	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	307,197,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	205,228,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	357,637,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	244,516,800	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	325,683,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	207,434,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	334,185,600	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	230,894,400	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	345,536,400	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	137,091,500	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	201,899,700	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	413,376,600	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	429,836,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	213,738,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	675,095,400	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	386,550,000	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	215,440,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	140,758,800	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	290,347,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	312,927,400	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	183,691,800	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	292,815,000	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	239,461,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	424,986,900	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	656,352,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	318,797,000	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	514,574,800	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	320,331,100	

第86回利付国債(20年)	510,000,000	568,145,100
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	2,030,019,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	470,358,000
第89回利付国債(20年)	350,000,000	390,229,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	706,318,200
第91回利付国債(20年)	450,000,000	506,862,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	986,937,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	459,749,400
第94回利付国債(20年)	610,000,000	687,512,700
第95回利付国債(20年)	610,000,000	698,267,000
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,801,056,600
第97回利付国債(20年)	400,000,000	457,864,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	500,904,800
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,475,334,300
第100回利付国債(20年)	480,000,000	554,856,000
第101回利付国債(20年)	715,000,000	836,135,300
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,481,583,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	467,548,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	184,780,800
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,368,469,600
第106回利付国債(20年)	380,000,000	443,444,800
第107回利付国債(20年)	260,000,000	302,978,000
第108回利付国債(20年)	660,000,000	759,204,600
第109回利付国債(20年)	520,000,000	600,308,800
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,286,912,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,146,646,700
第112回利付国債(20年)	790,000,000	927,562,700
第113回利付国債(20年)	1,720,000,000	2,026,572,800
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,755,667,700
第115回利付国債(20年)	700,000,000	833,819,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,781,652,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,281,981,600
第118回利付国債(20年)	660,000,000	780,054,000
第119回利付国債(20年)	530,000,000	616,909,400
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,799,314,200
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,764,315,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,096,989,400
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,240,634,000
第124回利付国債(20年)	610,000,000	725,143,600
第125回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,204,566,000
第126回利付国債(20年)	730,000,000	870,130,800
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,205,935,800
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,150,274,500

第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,046,586,600	
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,515,259,150	
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,169,040,000	
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,359,450,400	
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,454,265,900	
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,339,456,800	
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,209,982,200	
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,687,959,500	
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,283,529,500	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	716,614,600	
第139回利付国債(20年)	730,000,000	851,683,700	
第140回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,691,084,000	
第141回利付国債(20年)	1,730,000,000	2,046,503,500	
第142回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,218,155,400	
第143回利付国債(20年)	1,800,000,000	2,113,056,000	
第144回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,650,565,400	
第145回利付国債(20年)	2,595,000,000	3,084,754,350	
第146回利付国債(20年)	2,770,000,000	3,299,734,800	
第147回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,941,636,200	
第148回利付国債(20年)	2,230,000,000	2,611,240,800	
第149回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,354,236,600	
第150回利付国債(20年)	3,260,000,000	3,787,011,600	
第151回利付国債(20年)	1,495,000,000	1,699,530,950	
第152回利付国債(20年)	3,290,000,000	3,743,197,500	
第153回利付国債(20年)	2,570,000,000	2,963,338,500	
第154回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,964,858,000	
第155回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,183,294,400	
第156回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,668,458,000	
第157回利付国債(20年)	2,880,000,000	2,869,574,400	
第158回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,526,276,600	
第159回利付国債(20年)	2,930,000,000	3,087,018,700	
第160回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,627,058,600	
第161回利付国債(20年)	1,890,000,000	1,988,317,800	
第162回利付国債(20年)	620,000,000	651,731,600	
第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,741,230,800	
第164回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,714,099,400	
第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,691,496,000	
第166回利付国債(20年)	900,000,000	957,276,000	
第167回利付国債(20年)	2,770,000,000	2,849,997,600	
第168回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,456,365,500	
第169回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,675,736,400	
第170回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,335,810,000	



	第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,274,403,900
	第172回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,772,033,600
	第173回利付国債(20年)	3,150,000,000	3,158,316,000
	第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,482,207,200
	第175回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,211,455,700
	第176回利付国債(20年)	2,810,000,000	2,856,055,900
	国債証券合計	498,090,000,000	533,580,074,950
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,057,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,352,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	133,292,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,011,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	128,020,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,909,000
	第16回東京都公募公債(20年)	300,000,000	343,590,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,123,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,449,000
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	100,362,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,462,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,024,000
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	200,044,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	101,104,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	101,055,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	101,677,000
	第726回東京都公募公債	200,000,000	203,540,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	101,574,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,619,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,021,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,888,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	302,490,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	200,250,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,290,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,971,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,359,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,121,000
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	202,004,000
	第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	101,544,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	272,190,000
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,080,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	234,584,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,864,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,038,000
	第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,000,000

第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,068,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,843,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,936,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,888,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	200,166,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	234,494,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	234,218,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	117,104,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,019,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,758,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,654,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,716,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,434,120	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,142,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,113,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,597,480	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,908,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	500,000,000	504,935,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,052,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,315,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	116,935,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,740,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,157,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	100,246,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	104,424,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	140,959,435	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,237,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	114,372,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,088,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	436,300,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,947,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,040,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	472,636,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	201,634,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,712,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,650,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	103,059,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	302,166,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	121,045,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	104,011,000	

第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,109,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,901,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,139,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,947,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,066,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,079,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,059,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	313,453,400	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	117,635,000	
平成24年度第18回愛知県公募公債(10年)	150,000,000	151,951,500	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,083,000	
平成25年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,022,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,848,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,768,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,704,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,322,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,170,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	311,883,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,982,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	102,918,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,426,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,674,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	199,410,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	116,416,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	233,894,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,112,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,808,485	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,849,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	114,158,000	
第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	115,388,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	231,684,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	107,645,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	235,452,000	

第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	202,038,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,584,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	200,656,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,307,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,757,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,066,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,338,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,229,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,949,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,327,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,255,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,827,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,261,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,692,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,903,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	132,167,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	113,307,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,044,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	102,918,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,244,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	302,268,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	100,636,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	100,058,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	231,684,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,110,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,109,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,771,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,537,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,101,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,337,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,994,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	300,384,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	302,754,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,036,000	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,716,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,092,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,070,000	

第119回共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,164,000	
第121回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,009,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,458,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,544,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,553,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,834,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,715,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,307,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	114,148,160	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,931,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,839,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,748,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,686,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,036,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,232,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,172,594	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,146,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,446,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,358,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,642,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,452,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,816,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,160,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,829,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,207,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,842,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,561,007	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,097,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,841,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	202,052,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,143,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	235,752,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	302,010,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	104,873,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	201,366,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	130,512,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	135,397,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	114,975,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	125,970,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,065,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,110,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	302,265,000	

平成24年度第2回京都市公募公債	122,500,000	123,671,100	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,017,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	101,322,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,660,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	135,015,600	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	232,068,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	118,435,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	117,413,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	99,135,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,528,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	350,226,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,800,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,199,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,045,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,460,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	229,690,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	302,259,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,684,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	108,163,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,147,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,462,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	116,299,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,760,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,521,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,101,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,332,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	116,896,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	116,049,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	203,520,000	
平成30年度第5回福岡市公募公債(5年)	200,000,000	200,104,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債(10年)	100,000,000	101,738,000	
平成30年度第10回福岡市公募公債(5年)	200,000,000	200,072,000	
平成30年度第11回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,040,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	152,611,500	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,558,000	

	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,829,500	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,133,500	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	552,354,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	200,128,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	200,256,000	
	平成24年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	101,147,000	
	平成24年度第2回岡山県公募公債（10年）	150,000,000	151,732,500	
	平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	200,000,000	202,614,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,308,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	114,344,000	
	地方債証券合計	33,551,930,000	35,339,271,681	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,792,140	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	414,686,300	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	312,873,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,379,000	
	第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,952,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	94,733,000	
	第14回道路債券	100,000,000	102,738,000	
	第17回道路債券	100,000,000	102,205,000	
	第21回道路債券	100,000,000	129,653,000	
	第27回道路債券	400,000,000	425,788,000	
	第28回道路債券	200,000,000	263,036,000	
	第33回道路債券	200,000,000	267,166,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,347,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,479,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,149,000	
	第42回道路債券	100,000,000	108,093,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,907,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	143,777,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	233,824,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,103,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,335,000	
	第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,212,000	

第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	910,710,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,735,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,942,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,887,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,572,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,190,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,974,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,550,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,631,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,408,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,927,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,288,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,819,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,321,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,065,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,294,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	621,882,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	305,010,940	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	635,335,040	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,528,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	150,610,720	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,599,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	270,010,272	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,388,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,103,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	422,000,000	430,005,340	
	100,000,000	101,735,000	



第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,498,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,896,180	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,893,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,803,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	230,374,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,747,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,577,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,306,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,219,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,064,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,820,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,624,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,035,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,942,220	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,207,120	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,135,700	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,742,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,448,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,858,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,430,400	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,788,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,384,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,025,960	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	378,582,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	213,624,600	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,176,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	394,938,000	

第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,868,000	
第7回公営企業債券(30年)	200,000,000	264,320,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	42,401,200	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	130,210,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	234,618,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	194,872,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	234,438,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,601,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,093,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,590,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,414,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,330,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,294,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,986,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,143,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,735,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,639,050	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,406,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,712,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,947,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,088,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,663,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,662,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,078,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,698,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,630,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,046,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,129,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,379,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,551,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,804,690	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,698,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,870,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,851,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,304,600	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,037,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,031,120	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,406,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,524,000	

F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,329,000	
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,562,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,819,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,051,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	107,846,000	
第 2 2 回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,948,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	117,205,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,663,000	
第 2 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,692,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,057,960	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,872,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,974,400	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,464,660	
第 8 5 回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,970,000	
第 8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,898,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	212,660,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	169,492,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	92,830,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	199,472,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,488,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	102,627,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,424,400	
第 5 9 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,987,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,367,000	11,609,117	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,774,000	12,058,342	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,017,000	12,346,385	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	163,782,000	163,829,496	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	116,966,000	117,074,778	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,787,000	12,055,861	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,757,000	13,150,553	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	211,821,000	211,469,377	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,200,000	10,241,106	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	21,274,000	21,544,392	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,648,000	13,030,728	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	231,069,000	230,463,599	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	82,484,000	82,506,270	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,251,000	11,471,407	

第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,161,000	13,611,237	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	268,842,000	268,941,471	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,309,000	11,531,674	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	185,272,000	185,460,977	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,259,000	13,727,573	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,161,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,481,000	18,540,873	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,692,000	18,829,418	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,615,000	20,987,657	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,578,000	22,996,106	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,725,000	25,436,758	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,313,000	26,039,223	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,052,000	55,655,559	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,499,000	11,711,961	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,499,000	24,847,607	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,667,000	11,886,456	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,408,000	11,675,061	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,535,000	25,954,104	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,671,000	10,809,296	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,367,000	25,838,279	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,313,000	24,645,104	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,604,000	13,075,137	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,032,000	52,685,196	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,125,000	28,608,466	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,328,000	12,724,715	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,110,000	39,231,578	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,128,000	37,067,065	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,134,000	37,103,260	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,090,000	81,262,881	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,506,000	88,503,978	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,144,000	45,142,430	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,449,000	45,826,963	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,689,000	46,137,331	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,022,000	39,982,034	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,740,000	39,409,240	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,315,000	45,775,725	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	178,354,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,236,000	120,322,517	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,128,000	161,992,414	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,056,000	45,939,394	

第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,434,000	47,410,833
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,213,000	48,096,641
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,344,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,901,000	152,863,711
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,202,000	52,037,385
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	105,462,000	108,638,515
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,725,000	60,699,334
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,380,000	64,313,156
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,999,000	64,228,484
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,084,000	199,780,805
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,146,000	134,189,151
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,605,000	64,917,002
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,802,000	70,371,695
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,813,000	74,362,168
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,155,000	79,913,304
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,944,000	79,534,501
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,303,000	80,257,015
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,606,000	80,914,722
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,434,000	81,636,488
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,981,000	83,190,219
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,671,000	83,987,949
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,466,000	83,558,674
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,788,000	83,881,629
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,230,000	84,378,574
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,276,000	170,243,146
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,351,000	84,442,898
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,524,000	172,170,269
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,657,000	85,779,551
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,310,000	171,294,313
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,600,000	86,748,752
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,318,000	174,239,345

第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,250,000	175,167,877	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,374,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,861,000	89,346,729	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,738,000	89,406,776	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,708,000	88,660,508	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,664,000	180,878,528	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,981,000	90,506,489	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,740,000	90,395,102	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,070,000	182,152,798	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,633,000	91,528,538	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	276,612,000	274,938,497	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,410,000	184,258,603	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,058,000	94,833,978	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,789,000	95,272,423	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,878,000	195,890,453	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,718,000	98,613,096	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,904,000	197,671,054	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,412,000	197,837,951	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,409,000	99,374,392	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,372,000	200,214,156	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,882,000	201,545,029	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,842,000	101,085,032	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,646,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,951,000	
第60回日本学生支援債券	200,000,000	199,978,000	
第62回日本学生支援債券	100,000,000	99,985,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	107,931,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,638,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,354,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,934,000	

	い第833号商工債	100,000,000	99,885,000	
	い第843号商工債	200,000,000	200,246,000	
	第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,117,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,116,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,244,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,140,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,101,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,796,000	
	第236号商工債（3年）	300,000,000	299,961,000	
	第254号商工債（3年）	300,000,000	300,081,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,995,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,901,000	
	第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,606,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,249,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,692,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	503,115,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,035,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,457,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,025,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,680,000	
	第141回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,974,000	
	特殊債券合計	37,216,402,000	38,784,778,879	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,328,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	299,676,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,247,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,622,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,318,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,247,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,977,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,172,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	399,644,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,897,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,697,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,662,000	

第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,506,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,042,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,453,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,272,000	
第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,748,000	
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,425,000	
第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,806,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,863,000	
第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,962,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,192,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,977,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,022,000	
第10回J．フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,536,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,850,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,832,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,097,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	200,942,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,117,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,635,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,779,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,123,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,212,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,676,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,872,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,151,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,701,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	101,026,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,712,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,694,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,404,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,619,000	
	100,000,000	100,213,000	



第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債			
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	100,054,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,812,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,888,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,619,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,037,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,718,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,479,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,200,000	
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,101,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,978,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,131,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	100,027,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,211,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,174,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,326,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,655,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,450,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,302,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,978,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,316,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,921,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,857,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,616,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,714,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,543,000	
第11回JA三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,163,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,117,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,165,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,186,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,888,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,144,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,006,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,807,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,022,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,986,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,950,000	

第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,166,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	201,892,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,778,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,591,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	100,081,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	117,722,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	112,084,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,118,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	101,345,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,326,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	304,101,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,366,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,942,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,702,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,201,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,724,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,362,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,272,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,341,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,721,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,982,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,936,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,007,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,366,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,078,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,215,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,319,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,904,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,478,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,162,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,562,000	

第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,807,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,891,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,543,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,238,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,544,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,184,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,793,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,196,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,189,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,828,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,256,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,708,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,122,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,436,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,628,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,571,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,213,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,539,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,861,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,520,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,263,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	233,522,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,899,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,762,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,253,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,171,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,787,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,096,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,118,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,401,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,423,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,694,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	501,635,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,757,000	

第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,299,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,645,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,587,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,068,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,580,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,790,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	193,966,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,946,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,140,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,664,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,049,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	400,404,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,368,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,878,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,279,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,475,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,129,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,080,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,660,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,758,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,406,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,255,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,425,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,927,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,544,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,673,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,167,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,590,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	202,636,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,272,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,629,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,446,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	202,482,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,389,400	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,846,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,290,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,188,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	203,204,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,374,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,838,000	

第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,565,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,481,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	203,384,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,495,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,900,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,546,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,692,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,143,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,964,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,774,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,808,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,621,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,215,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,670,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,584,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,284,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	206,134,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	404,952,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,838,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	304,491,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,049,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,405,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,194,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,180,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	201,446,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	201,168,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,748,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,548,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,624,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	203,694,000	
社債券合計	28,226,000,000	28,630,487,400	
合計		636,334,612,910	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,020,072,467
コール・ローン	462,251,836
株式	508,808,969,774
投資信託受益証券	308,071,067
投資証券	11,835,425,758
派生商品評価勘定	249,819,571
未収入金	1,503,700
未収配当金	378,733,681
差入委託証拠金	3,500,964,135
流動資産合計	534,565,811,989
資産合計	534,565,811,989
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,787,065
前受金	222,995,129
未払金	647,594
未払解約金	359,433,251
未払利息	705
流動負債合計	609,863,744
負債合計	609,863,744
純資産の部	
元本等	
元本	137,442,391,078
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	396,513,557,167
元本等合計	533,955,948,245
純資産合計	533,955,948,245
負債純資産合計	534,565,811,989

##### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2021年 7月12日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2021年 7月12日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,442,391,078口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.8849円 (1万口当たり純資産額) (38,849円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 7月12日現在
期首	2020年 7月11日
期首元本額	150,285,284,851円
期中追加設定元本額	18,234,274,317円
期中一部解約元本額	31,077,168,090円
期末元本額	137,442,391,078円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,001,406,518円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,331,893円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,876,434,113円
世界経済インデックスファンド	8,547,243,595円
外国株式インデックス・オープン	825,570,999円
D C マイセレクション 2 5	844,802,816円
D C マイセレクション 5 0	4,033,137,357円
D C マイセレクション 7 5	4,496,571,805円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,103,954,181円
D C マイセレクション S 2 5	407,977,046円
D C マイセレクション S 5 0	1,888,439,666円
D C マイセレクション S 7 5	1,487,974,575円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	68,758,692円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	185,340,786円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	130,628,490円
D C 世界経済インデックスファンド	10,066,044,781円
外国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,838,874,226円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,345,507円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	5,085,097円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	30,705,658円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,672,922円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	88,492,989円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	14,696,140円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	47,259,488円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	386,385,088円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	216,808,865円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,565,927,676円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	548,489,178円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	42,014,656円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	208,460,816円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	72,760,304円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,233,470,256円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,381,308,862円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,128,481,876円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,244,951,979円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,587,531,564円

区分	2021年 7月12日現在
分散投資コア戦略ファンドA	1,876,550,513円
分散投資コア戦略ファンドS	9,350,780,542円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,307,478,553円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,152,455,706円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,025,879,041円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	638,825,685円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,983,860円
SMT インデックスバランス・オープン	171,672,657円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	704,178,481円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	26,606,548,980円
SMT 世界経済インデックス・オープン	162,076,375円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	553,432,498円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	101,637,381円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,382,730円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	112,255,264円
グローバル経済コア	682,428,715円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,653,306円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,607,222円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	664,326,699円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	74,667,735円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	12,842,844円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	8,707,619円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,100,299円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,668,613円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	573,562,496円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	868,719,467円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,292,498,999円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	802,652,216円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	125,840,782円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	5,394,645円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	286,317,818円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	441,289,364円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	294,802,711円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	284,799,149円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	282,822,494円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	275,209,159円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	17,098,547,422
投資信託受益証券	13,514,806
投資証券	683,505,358
合計	17,795,567,586

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,058,845,866	-	13,281,840,995	222,995,129
	合計	13,058,845,866	-	13,281,840,995	222,995,129

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2021年 7月12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	418,338,960	-	418,376,337	37,377
	アメリカドル	220,320,000	-	220,334,800	14,800
	ユーロ	52,321,600	-	52,328,760	7,160
	スイスフラン	51,820,160	-	51,820,977	817
	スウェーデンク ローナ	41,107,200	-	41,120,000	12,800
	デンマーククロー ネ	52,770,000	-	52,771,800	1,800
	合計	418,338,960	-	418,376,337	37,377

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	22.73	1,317,885.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	88.01	1,675,182.34	
	CHEVRON CORP	166,092	104.07	17,285,194.44	
	CONOCOPHILLIPS	117,327	60.13	7,054,872.51	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	28.65	1,633,050.00	
	EOG RESOURCES INC	51,325	82.59	4,238,931.75	
	EXXON MOBIL	365,193	61.23	22,360,767.39	
	HALLIBURTON CO	77,539	22.38	1,735,322.82	
	HESS CORP	24,844	84.01	2,087,144.44	
	KINDER MORGAN INC	179,427	18.67	3,349,902.09	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,189	58.68	3,355,850.52	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	30.24	2,392,165.44	
	ONEOK INC	37,709	57.52	2,169,021.68	
	PHILLIPS 66	38,113	82.70	3,151,945.10	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	158.00	2,836,732.00	
	SCHLUMBERGER	122,666	31.19	3,825,952.54	
	VALERO ENERGY CORP	34,683	72.30	2,507,580.90	
	WILLIAMS COS	104,984	26.70	2,803,072.80	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,118	291.67	5,576,147.06	
	ALBEMARLE CORP	10,180	175.51	1,786,691.80	
	AMCOR PLC	132,975	11.51	1,530,542.25	
	AVERY DENNISON CORP	7,457	210.35	1,568,579.95	
	BALL CORP	27,925	84.79	2,367,760.75	
	CELANESE CORP-SERIES A	9,842	153.53	1,511,042.26	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	50.66	966,136.86	
	CORTEVA INC	64,900	43.45	2,819,905.00	
	CROWN HOLDINGS INC	11,212	105.57	1,183,650.84	
	DOW INC	63,659	63.08	4,015,609.72	
	DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	78.48	3,620,988.72	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,641	114.95	1,453,082.95	
ECOLAB INC	22,189	212.76	4,720,931.64		
FMC CORP	12,118	107.66	1,304,623.88		

FREEMPORT-MCMORAN INC	125,342	36.50	4,574,983.00
INT'L PAPER CO	33,803	62.24	2,103,898.72
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	147.70	3,128,876.80
LINDE PLC	45,090	292.71	13,198,293.90
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	102.73	2,329,197.29
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	357.92	1,904,492.32
MOSAIC CO/THE	31,911	31.79	1,014,450.69
NEWMONT CORPORATION	68,576	63.98	4,387,492.48
NUCOR CORP	25,565	97.17	2,484,151.05
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	138.63	1,232,420.70
PPG INDUSTRIES INC	20,538	171.41	3,520,418.58
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	90.52	1,125,163.60
SEALED AIR CORP	14,689	58.40	857,837.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,917	276.22	6,053,913.74
STEEL DYNAMICS INC	18,273	61.50	1,123,789.50
VULCAN MATERIALS CO	11,347	174.93	1,984,930.71
WESTROCK CO	24,734	52.87	1,307,686.58
3 M COMPANY	50,115	201.00	10,073,115.00
ALLEGION PLC	7,601	138.27	1,050,990.27
AMETEK INC	19,666	135.47	2,664,153.02
BOEING CO	47,686	239.59	11,425,088.74
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	48.27	3,408,006.81
CATERPILLAR	47,231	217.42	10,268,964.02
CUMMINS INC	12,914	242.70	3,134,227.80
DEERE&CO	25,864	349.48	9,038,950.72
DOVER CORP	12,202	153.46	1,872,518.92
EATON CORP	34,431	153.56	5,287,224.36
EMERSON ELECTRIC CO	51,393	97.61	5,016,470.73
FASTENAL CO	48,796	53.84	2,627,176.64
FORTIVE CORP	25,722	70.68	1,818,030.96
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	98.49	1,261,656.90
GENERAC HOLDINGS INC	5,800	436.37	2,530,946.00
GENERAL DYNAMICS CORP	21,212	190.22	4,034,946.64
GENERAL ELECTRIC CO	761,269	13.16	10,018,300.04
GRAINGER (WW) INC	3,846	456.83	1,756,968.18
HEICO CORP	3,640	142.20	517,608.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	130.22	839,788.78
HONEYWELL INTL INC	59,921	224.34	13,442,677.14
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	33.95	1,240,872.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	206.22	726,306.84
IDEX CORP	6,916	224.27	1,551,051.32
ILLINOIS TOOL WORKS	27,403	227.38	6,230,894.14

INGERSOLL-RAND INC	31,562	49.38	1,558,531.56
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	63.93	1,284,993.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	63,375	70.06	4,440,052.50
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	223.99	4,051,083.14
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	342.15	1,047,663.30
LOCKHEED MARTIN CORP	21,652	383.11	8,295,097.72
MASCO CORP	23,467	58.45	1,371,646.15
NORDSON CORP	4,880	221.30	1,079,944.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,571	371.82	5,045,969.22
OTIS WORLDWIDE CORP	35,040	83.82	2,937,052.80
OWENS CORNING	8,642	96.35	832,656.70
PACCAR INC	30,155	87.50	2,638,562.50
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	311.57	3,500,177.38
PENTAIR PLC	14,533	69.30	1,007,136.90
PLUG POWER INC	41,884	29.39	1,230,970.76
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	131,986	86.38	11,400,950.68
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	291.20	2,893,945.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,326	481.18	4,487,484.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	57.74	798,428.72
SMITH (A.O.) CORP	12,146	70.75	859,329.50
SNAP-ON INC	4,900	227.65	1,115,485.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	208.53	2,860,614.54
SUNRUN INC	13,917	52.58	731,755.86
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	426.79	1,664,054.21
TEXTRON	18,893	67.70	1,279,056.10
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	190.32	3,928,585.44
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	660.06	2,920,765.50
UNITED RENTALS INC	6,103	317.48	1,937,580.44
WABTEC CORP	15,024	82.85	1,244,738.40
XYLEM INC	15,209	121.05	1,841,049.45
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	88.80	1,009,123.20
CINTAS CORP	8,043	388.32	3,123,257.76
CLARIVATE PLC	27,357	26.34	720,583.38
COPART INC	18,067	138.49	2,502,098.83
COSTAR GROUP INC	34,030	86.28	2,936,108.40
EQUIFAX INC	10,409	248.54	2,587,052.86
IHS MARKIT LTD	32,602	113.52	3,700,979.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	134.65	1,619,300.90
LEIDOS HOLDINGS	11,220	104.84	1,176,304.80
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	112.67	2,254,188.69
ROBERT HALF INTL INC	9,566	88.45	846,112.70
ROLLINS INC	21,849	35.39	773,236.11

TRANSUNION	17,091	113.84	1,945,639.44
VERISK ANALYTICS INC	13,390	181.71	2,433,096.90
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	122.14	2,742,531.56
WASTE MANAGEMENT INC	36,263	143.04	5,187,059.52
AMERCO	1,000	584.00	584,000.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	93.17	1,052,075.64
CSX CORP	197,466	31.83	6,285,342.78
DELTA AIR LINES INC	14,609	42.92	627,018.28
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	128.40	1,832,524.80
FEDEX CORP	21,597	296.40	6,401,350.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	165.78	1,169,080.56
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	273.95	2,182,011.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	49.78	532,646.00
LYFT INC-A	21,288	60.06	1,278,557.28
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,987	263.64	5,796,652.68
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	260.58	2,085,421.74
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	52.84	715,083.72
UBER TECHNOLOGIES INC	103,109	49.07	5,059,558.63
UNION PACIFIC CORP	57,701	221.69	12,791,734.69
UNITED PARCEL SERVICE B	62,170	213.92	13,299,406.40
XPO LOGISTICS INC	8,001	141.10	1,128,941.10
APTIV PLC	23,540	155.61	3,663,059.40
AUTOLIV INC	6,776	96.04	650,767.04
BORGWARNER INC	19,781	47.80	945,531.80
FORD MOTOR COMPANY	334,463	14.48	4,843,024.24
GENERAL MOTORS CO	114,044	58.76	6,701,225.44
LEAR CORP	5,287	174.03	920,096.61
TESLA INC	66,189	656.95	43,482,863.55
DR HORTON INC	29,632	89.57	2,654,138.24
GARMIN LTD	12,854	148.81	1,912,803.74
HASBRO INC	12,468	97.98	1,221,614.64
LENNAR CORP-CL A	24,928	98.93	2,466,127.04
LULULEMON ATHLETICA INC	10,777	377.42	4,067,455.34
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	198.95	1,007,084.90
NEWELL BRANDS INC	31,461	27.03	850,390.83
NIKE B	109,235	161.00	17,586,835.00
NVR INC	297	5,060.84	1,503,069.48
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	117.84	2,561,370.24
PULTE GROUP INC	24,818	53.23	1,321,062.14
VF CORP	28,638	83.07	2,378,958.66
WHIRLPOOL CORP	5,220	225.02	1,174,604.40
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	149.64	698,070.60



ARAMARK	20,955	35.92	752,703.60
BOOKING HOLDINGS INC	3,556	2,194.99	7,805,384.44
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	96.86	1,700,861.60
CARNIVAL CORPORATION	70,520	24.26	1,710,815.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,592.25	3,819,807.75
DARDEN RESTAURANTS INC	12,063	148.58	1,792,320.54
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	477.56	1,552,547.56
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	49.09	769,436.66
EXPEDIA GROUP INC	11,638	167.74	1,952,158.12
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	126.05	2,998,477.40
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	51.33	1,507,562.10
MARRIOTT INTL A	24,361	142.48	3,470,955.28
MCDONALD'S CORP	64,866	235.68	15,287,618.88
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	16.12	284,711.44
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	41.60	1,375,462.40
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	82.33	1,586,252.11
STARBUCKS CORP	102,054	117.47	11,988,283.38
VAIL RESORTS INC	3,574	325.63	1,163,801.62
WYNN RESORTS LTD	9,302	113.87	1,059,218.74
YUM BRANDS INC	25,844	118.58	3,064,581.52
ACTIVISION BLIZZARD INC	66,954	92.38	6,185,210.52
ALPHABET INC-CL A	25,977	2,510.37	65,211,881.49
ALPHABET INC-CL C	25,465	2,591.49	65,992,292.85
ALTICE USA INC- A	22,505	34.80	783,174.00
CABLE ONE INC	445	1,933.00	860,185.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,659	736.47	8,586,503.73
COMCAST CORP-CL A	394,334	58.03	22,883,202.02
DISCOVERY INC - A	12,804	29.30	375,157.20
DISCOVERY INC-C	28,190	27.77	782,836.30
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	41.50	835,478.00
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	140.99	3,516,854.56
FACEBOOK INC-A	207,790	350.42	72,813,771.80
FOX CORP - CLASS A	27,658	36.45	1,008,134.10
FOX CORP- CLASS B	15,092	34.51	520,824.92
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	144.15	968,832.15
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	33.08	1,119,228.72
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	172.67	445,315.93
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	178.64	2,414,498.24
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	48.88	913,713.84
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	46.52	803,121.28
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	46.89	299,345.76
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	83.66	1,163,543.28

MATCH GROUP INC	21,851	162.63	3,553,628.13
NETFLIX INC	38,504	535.98	20,637,373.92
NEWS CORP-CLASS A	33,479	25.52	854,384.08
OMNICOM GROUP	18,031	80.05	1,443,381.55
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	76.99	3,523,601.33
ROKU INC	9,741	431.61	4,204,313.01
SEA LTD-ADR	638	275.70	175,896.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.56	653,034.88
SNAP INC - A	81,742	65.81	5,379,441.02
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	170.37	1,659,063.06
THE WALT DISNEY CO	156,656	177.04	27,734,378.24
TWITTER INC	70,140	68.97	4,837,555.80
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	42.77	2,078,023.22
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	116.59	640,895.23
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	115.29	1,547,998.83
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	213.47	1,320,525.42
AMAZON.COM	36,986	3,719.34	137,563,509.24
AUTOZONE INC	1,986	1,564.53	3,107,156.58
BEST BUY COMPANY INC	19,870	110.86	2,202,788.20
BURLINGTON STORES INC	5,808	329.89	1,916,001.12
CARMAX INC	13,891	134.84	1,873,062.44
CARVANA CO	5,700	323.42	1,843,494.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	85.57	588,550.46
DOLLAR GENERAL CORP	20,962	220.77	4,627,780.74
DOLLAR TREE INC	20,151	99.51	2,005,226.01
EBAY	59,339	69.46	4,121,686.94
ETSY INC	11,000	195.09	2,145,990.00
GENUINE PARTS CO	12,119	129.52	1,569,652.88
HOME DEPOT	92,922	322.09	29,929,246.98
L BRANDS INC	19,806	73.50	1,455,741.00
LKQ CORP	26,705	50.97	1,361,153.85
LOWES COMPANIES	63,738	195.33	12,449,943.54
MERCADOLIBRE INC	3,877	1,554.97	6,028,618.69
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,067	591.65	3,589,540.55
POOL CORP	3,700	476.24	1,762,088.00
ROSS STORES INC	31,643	124.77	3,948,097.11
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,484	248.58	10,809,252.72
TJX COMPANIES INC	103,121	68.36	7,049,351.56
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	186.91	1,856,390.12
ULTA BEAUTY INC	4,520	343.65	1,553,298.00
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	303.90	1,823,400.00
COSTCO WHOLESALE CORP	38,401	412.37	15,835,420.37

KROGER CO	61,306	38.27	2,346,180.62
SYSCO CORP	43,568	76.14	3,317,267.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	47.41	3,001,527.10
WALMART INC	134,198	140.30	18,827,979.40
ALTRIA GROUP INC	161,290	47.40	7,645,146.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	60.32	2,915,808.48
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	973.58	724,343.52
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	74.12	1,943,426.40
BUNGE LIMITED	11,604	77.45	898,729.80
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.64	724,261.16
COCA-COLA CO	355,696	54.46	19,371,204.16
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	19,221	61.39	1,179,977.19
CONAGRA BRANDS INC	41,157	36.12	1,486,590.84
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,911	227.69	3,395,085.59
GENERAL MILLS INC	53,282	59.70	3,180,935.40
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	176.75	2,215,031.00
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.44	1,288,328.08
JM SMUCKER CO	9,145	130.85	1,196,623.25
KELLOGG CO	21,630	64.28	1,390,376.40
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	35.00	2,085,860.00
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	39.95	2,290,653.10
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	80.82	1,044,517.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	87.10	1,836,764.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	53.18	968,035.54
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	121,364	63.02	7,648,359.28
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	90.24	3,091,441.92
PEPSICO INC	118,953	149.48	17,781,094.44
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,448	99.40	13,463,531.20
TYSON FOODS INC	25,074	73.55	1,844,192.70
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	86.98	1,831,363.90
CLOROX COMPANY	10,830	180.88	1,958,930.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,441	82.43	5,806,451.63
ESTEE LAUDER CO-CL A	20,159	317.87	6,407,941.33
KIMBERLY-CLARK CORP	28,913	135.02	3,903,833.26
PROCTER & GAMBLE CO	212,538	137.03	29,124,082.14
ABBOTT LABORATORIES	152,754	119.74	18,290,763.96
ABIOMED INC	3,781	324.77	1,227,955.37
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,653	627.19	4,172,695.07
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	115.13	1,484,716.48
ANTHEM INC	21,058	388.61	8,183,349.38
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	80.43	3,540,850.32
BECTON DICKINSON & CO	25,112	249.80	6,272,977.60

BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,665	43.59	5,390,557.35
CARDINAL HEALTH	24,692	57.18	1,411,888.56
CENTENE CORP	51,303	73.51	3,771,283.53
CERNER CORP	27,382	79.57	2,178,785.74
CIGNA CORP	30,245	234.90	7,104,550.50
CVS HEALTH CORP	113,622	81.32	9,239,741.04
DANAHER CORP	55,620	277.47	15,432,881.40
DAVITA INC	5,784	122.09	706,168.56
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	62.42	1,260,134.96
DEXCOM INC	8,405	440.73	3,704,335.65
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,513	107.51	5,753,182.63
HCA HEALTHCARE INC	23,291	218.79	5,095,837.89
HENRY SCHEIN INC	11,747	76.81	902,287.07
HOLOGIC INC	21,687	69.31	1,503,125.97
HUMANA INC	11,040	455.65	5,030,376.00
IDEXX LABORATORIES INC	7,438	667.03	4,961,369.14
INSULET CORP	5,923	280.69	1,662,526.87
INTUITIVE SURGICAL INC	10,199	950.78	9,697,005.22
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	281.03	2,328,333.55
MASIMO CORP	4,835	260.33	1,258,695.55
MCKESSON CORP	13,893	189.10	2,627,166.30
MEDTRONIC PLC	117,112	128.17	15,010,245.04
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	257.25	1,270,815.00
NOVOCURE LTD	7,933	194.55	1,543,365.15
OAK STREET HEALTH INC	7,613	59.57	453,506.41
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	135.04	1,530,678.40
RESMED INC	12,370	247.68	3,063,801.60
STERIS PLC	7,163	211.24	1,513,112.12
STRYKER CORP	29,094	264.43	7,693,326.42
TELADOC HEALTH INC	11,375	158.60	1,804,075.00
TELEFLEX INC	3,934	422.82	1,663,373.88
THE COOPER COS INC	4,134	411.23	1,700,024.82
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,910	412.11	33,755,930.10
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	153.95	1,115,829.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	321.41	3,784,602.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	374.19	2,363,758.23
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,277	159.31	2,911,708.87
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	190.41	1,076,768.55
ABBVIE INC	152,263	116.58	17,750,820.54
AGILENT TECHNOLOGIES	26,029	150.03	3,905,130.87
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,936	184.20	3,488,011.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	176.74	1,884,932.10

AMGEN	49,749	245.20	12,198,454.80
AVANTOR INC	47,985	36.08	1,731,298.80
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	675.17	1,251,090.01
BIO-TECHNE CORP	3,245	465.39	1,510,190.55
BIOGEN INC	13,488	358.16	4,830,862.08
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	83.62	1,435,839.02
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	193,007	67.16	12,962,350.12
CATALENT INC	15,232	113.25	1,725,024.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	384.89	1,618,077.56
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	34.64	1,249,153.04
EXACT SCIENCES CORP	14,756	119.70	1,766,293.20
GILEAD SCIENCES INC	107,975	68.22	7,366,054.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	95.28	1,707,989.28
ILLUMINA INC	12,501	476.80	5,960,476.80
INCYTE CORP	17,504	82.04	1,436,028.16
IQVIA HOLDINGS INC	16,726	251.16	4,200,902.16
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	183.99	914,614.29
JOHNSON & JOHNSON	226,967	169.75	38,527,648.25
LILLY (ELI) & CO	70,198	234.99	16,495,828.02
MERCK & CO	218,163	77.99	17,014,532.37
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,435.41	2,944,025.91
MODERNA INC	27,089	232.81	6,306,590.09
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	99.03	839,180.22
NOVAVAX INC	5,754	188.59	1,085,146.86
PERKINELMER INC	9,372	153.96	1,442,913.12
PFIZER	484,175	39.61	19,178,171.75
PPD INC	11,027	45.85	505,587.95
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,176	580.40	5,325,750.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	41.77	648,855.18
SEAGEN INC	11,471	148.50	1,703,443.50
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.30	747,729.30
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,944	517.26	17,557,873.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	198.16	4,450,277.28
VIATRIS INC	103,541	14.31	1,481,671.71
WATERS CORP	5,228	369.40	1,931,223.20
ZOETIS INC	40,822	197.50	8,062,345.00
BANK OF AMERICA CORP	670,589	40.04	26,850,383.56
CITIGROUP	181,157	68.45	12,400,196.65
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	45.31	1,633,017.71
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	38.08	2,336,626.88
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	194.49	2,883,703.23
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	14.27	1,820,595.14

JPMORGAN CHASE & CO	263,503	155.77	41,045,862.31
KEY CORP	83,212	20.17	1,678,386.04
M & T BANK CORP	11,721	142.33	1,668,249.93
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,707	189.67	6,962,216.69
REGIONS FINL CORP	81,824	19.87	1,625,842.88
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	575.24	2,527,029.32
TRUIST FINANCIAL CORP	115,723	55.21	6,389,066.83
US BANCORP	122,617	56.97	6,985,490.49
WELLS FARGO & CO	356,388	43.91	15,648,997.08
ALLY FINANCIAL INC	31,445	51.28	1,612,499.60
AMERICAN EXPRESS	59,420	171.94	10,216,674.80
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	248.95	2,535,555.75
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	61.17	926,909.01
BANK NEW YORK CO	71,298	49.93	3,559,909.14
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	118,353	280.49	33,196,832.97
BLACKROCK INC	13,255	901.31	11,946,864.05
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,302	160.55	6,470,486.10
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	47.71	600,907.45
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	118.79	1,054,261.25
CME GROUP INC	31,096	209.62	6,518,343.52
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,121	122.40	3,197,210.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	29.65	972,964.75
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	343.20	1,080,393.60
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	32.15	838,150.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	139.75	603,161.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,769	371.76	11,066,923.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,552	118.97	5,776,231.44
INVESCO LTD	35,765	26.33	941,692.45
KKR & CO INC	43,643	59.10	2,579,301.30
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	460.77	1,477,689.39
MOODY'S CORP	14,787	375.59	5,553,849.33
MORGAN STANLEY	122,211	90.33	11,039,319.63
MSCI INC	7,235	560.23	4,053,264.05
NASDAQ INC	9,657	175.77	1,697,410.89
NORTHERN TRUST CORP	17,625	115.55	2,036,568.75
PRICE T ROWE GROUP INC	20,087	205.20	4,121,852.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	132.02	1,362,974.48
S&P GLOBAL INC	20,689	414.68	8,579,314.52
SCHWAB (CHARLES) CORP	124,071	70.55	8,753,209.05
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	62.12	761,653.32
STATE STREET CORP	29,894	84.11	2,514,384.34
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	48.73	2,412,573.57

THE BLACKSTONE GROUP INC	58,748	99.73	5,858,938.04
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	87.06	788,850.66
VOYA FINANCIAL INC	10,050	62.33	626,416.50
AFLAC	58,037	53.35	3,096,273.95
ALLEGHANY CORP	1,276	673.67	859,602.92
ALLSTATE CORP	26,425	133.47	3,526,944.75
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	123.43	779,954.17
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	46.87	3,525,889.49
AON PLC	19,359	236.31	4,574,725.29
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	38.50	1,310,193.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	140.50	2,298,439.50
ASSURANT INC	4,726	156.99	741,934.74
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	66.92	683,052.44
BROWN & BROWN INC	19,873	52.95	1,052,275.35
CHUBB LTD	38,652	162.73	6,289,839.96
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	118.87	1,520,466.17
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	188.22	407,684.52
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	247.86	814,963.68
FNF GROUP	24,961	44.20	1,103,276.20
GLOBE LIFE INC	8,106	94.46	765,692.76
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	61.58	1,870,246.18
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	62.01	1,014,731.64
LOEWS CORP	18,851	54.71	1,031,338.21
MARKEL CORP	1,156	1,238.29	1,431,463.24
MARSH & MCLENNAN COS	44,622	142.60	6,363,097.20
METLIFE INC	64,294	58.86	3,784,344.84
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	61.99	1,430,233.28
PROGRESSIVE CORP	50,582	99.63	5,039,484.66
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,851	100.58	3,505,313.58
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	112.82	750,478.64
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	151.04	734,658.56
TRAVELERS COS INC/THE	22,437	153.33	3,440,265.21
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	228.21	2,515,102.41
WR BERKLEY CORP	11,715	75.62	885,888.30
CBRE GROUP INC-A	30,111	85.83	2,584,427.13
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.74	467,838.00
WEYERHAEUSER CO	63,665	35.82	2,280,480.30
ACCENTURE PLC-CL A	55,165	312.62	17,245,682.30
ADOBE INC	41,289	604.50	24,959,200.50
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	117.90	1,612,046.70
ANSYS INC	7,474	353.76	2,644,002.24
AUTODESK INC	18,964	295.38	5,601,586.32

AUTOMATIC DATA PROCESS	36,764	203.72	7,489,562.08
AVALARA INC	7,698	161.28	1,241,533.44
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	64.20	898,543.20
BLACK KNIGHT INC	14,413	80.94	1,166,588.22
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	168.70	1,643,475.40
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,740	138.50	3,426,490.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	99.22	1,220,009.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	123.80	1,298,166.80
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	116.17	1,213,279.48
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	108.97	1,935,525.14
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	69.14	3,180,923.98
COUPA SOFTWARE INC	6,059	266.64	1,615,571.76
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,694	264.44	4,150,121.36
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	139.61	432,791.00
DATADOG INC - CLASS A	15,807	108.12	1,709,052.84
DOCUSIGN INC	15,540	288.02	4,475,830.80
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	31.05	895,637.25
DYNATRACE INC	17,890	61.81	1,105,780.90
EPAM SYSTEMS INC	4,753	527.82	2,508,728.46
FAIR ISAAC CORP	2,615	524.05	1,370,390.75
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	53,834	144.42	7,774,706.28
FISERV INC	51,693	108.94	5,631,435.42
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,154	253.03	1,810,176.62
FORTINET INC	12,295	256.81	3,157,478.95
GARTNER INC	7,500	256.87	1,926,525.00
GLOBAL PAYMENTS INC	25,292	190.37	4,814,838.04
GODADDY INC - CLASS A	15,914	87.43	1,391,361.02
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	111.66	884,682.18
HUBSPOT INC	4,000	602.90	2,411,600.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,449	141.52	10,960,582.48
INTUIT INC	23,568	503.93	11,876,622.24
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	167.38	1,052,987.58
MASTERCARD INC-CLASS A	76,521	372.94	28,537,741.74
MICROSOFT CORP	619,180	277.94	172,094,889.20
MONGODB INC	4,623	353.70	1,635,155.10
NORTONLIFELOCK INC	50,376	27.66	1,393,400.16
OKTA INC	10,230	251.84	2,576,323.20
ORACLE CORP	164,854	87.76	14,467,587.04
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	43,290	23.29	1,008,224.10
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	390.24	3,243,284.64
PAYCHEX INC	27,703	111.90	3,099,965.70
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	383.59	1,624,503.65



PAYPAL HOLDINGS INC	95,999	300.21	28,819,859.79
PTC INC	9,984	145.14	1,449,077.76
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	294.81	1,884,720.33
SALESFORCE.COM INC	79,266	245.06	19,424,925.96
SERVICENOW INC	16,939	566.37	9,593,741.43
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	41,035	44.47	1,824,826.45
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	269.49	528,200.40
SPLUNK INC	14,752	138.37	2,041,234.24
SQUARE INC - A	33,292	241.89	8,053,001.88
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	73.55	1,422,089.25
SYNOPSYS INC	13,492	280.75	3,787,879.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	77.95	2,789,051.00
TWILIO INC - A	13,692	392.27	5,370,960.84
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	478.84	1,777,932.92
UNITY SOFTWARE INC	4,329	106.53	461,168.37
VERISIGN INC	8,760	233.03	2,041,342.80
VISA INC-CLASS A SHARES	146,419	238.47	34,916,538.93
VMWARE INC-CLASS A	7,867	159.48	1,254,629.16
WESTERN UNION CO	38,757	23.31	903,425.67
WIX.COM LTD	5,010	294.81	1,476,998.10
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	239.94	3,720,269.70
ZENDESK INC	10,500	143.48	1,506,540.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	385.08	6,756,228.60
ZSCALER INC	6,234	227.79	1,420,042.86
AMPHENOL CORPORATION	51,451	70.31	3,617,519.81
APPLE INC	1,450,831	145.11	210,530,086.41
ARISTA NETWORKS INC	5,179	378.03	1,957,817.37
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	113.38	691,618.00
CDW CORP/DE	11,982	177.98	2,132,556.36
CISCO SYSTEMS	364,089	53.74	19,566,142.86
COGNEX CORP	16,230	86.58	1,405,193.40
CORNING	64,989	41.03	2,666,498.67
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	100.25	2,158,382.50
F5 NETWORKS INC	5,350	190.86	1,021,101.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	14.58	1,591,392.42
HP INC	106,353	30.04	3,194,844.12
IPG PHOTONICS CORP	3,207	207.41	665,163.87
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.62	864,616.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	155.81	2,493,583.24
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,918	224.52	3,349,389.36
NETAPP INC	20,586	82.57	1,699,786.02
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	87.96	1,578,002.40

TE CONNECTIVITY LTD	29,387	138.00	4,055,406.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	83.26	1,763,113.76
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	70.17	1,809,684.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	547.73	2,526,130.76
AT&T INC	614,997	28.45	17,496,664.65
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.49	411,018.84
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	26.44	890,499.20
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	13.51	1,163,629.81
T-MOBILE US INC	53,388	146.01	7,795,181.88
VERIZON COMMUNICATIONS	356,926	56.07	20,012,840.82
AES CORP	61,761	25.73	1,589,110.53
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	56.76	1,179,359.28
AMEREN CORPORATION	20,898	81.92	1,711,964.16
AMERICAN ELECTRIC POWER	44,128	85.39	3,768,089.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	162.28	2,509,497.92
ATMOS ENERGY CORP	11,419	98.53	1,125,114.07
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.47	1,226,686.14
CMS ENERGY CORP	26,742	60.31	1,612,810.02
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	73.30	2,107,008.50
DOMINION ENERGY INC	69,073	75.55	5,218,465.15
DTE ENERGY COMPANY	16,240	115.60	1,877,344.00
DUKE ENERGY CORP	66,012	100.66	6,644,767.92
EDISON INTL	32,117	58.28	1,871,778.76
ENERGY CORP	16,926	102.92	1,742,023.92
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	47.94	998,781.96
EVERGY INC	21,330	61.79	1,317,980.70
EVERSOURCE ENERGY	29,303	82.63	2,421,306.89
EXELON CORP	86,723	44.91	3,894,729.93
FIRSTENERGY CORP	45,787	37.53	1,718,386.11
NEXTERA ENERGY INC	170,459	74.99	12,782,720.41
NISOURCE INC	35,781	25.14	899,534.34
NRG ENERGY INC	23,078	41.97	968,583.66
PG&E CORP	135,327	10.37	1,403,340.99
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	83.65	901,077.80
PPL CORPORATION	69,904	28.44	1,988,069.76
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	60.49	2,616,676.42
SEMPRA ENERGY	27,056	132.86	3,594,660.16
SOUTHERN CO	91,389	61.47	5,617,681.83
UGI CORP	18,019	46.54	838,604.26
VISTRA CORP	37,797	19.32	730,238.04
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	91.84	2,463,240.64
XCEL ENERGY INC	46,423	67.67	3,141,444.41

	ADVANCED MICRO DEVICES	104,401	90.90	9,490,050.90	
	ANALOG DEVICES	31,938	166.27	5,310,331.26	
	APPLIED MATERIALS	79,412	134.90	10,712,678.80	
	BROADCOM INC	35,233	480.18	16,918,181.94	
	ENPHASE ENERGY INC	11,000	183.80	2,021,800.00	
	INTEL CORP	350,418	55.99	19,619,903.82	
	KLA CORP	13,649	308.76	4,214,265.24	
	LAM RESEARCH CORP	12,499	612.85	7,660,012.15	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,440	57.00	4,015,080.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,641	100.03	2,264,779.23	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	144.02	3,226,624.08	
	MICRON TECHNOLOGY	96,673	78.74	7,612,032.02	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,953	382.60	1,512,417.80	
	NVIDIA CORP	53,433	802.01	42,853,800.33	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	24,180	200.35	4,844,463.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	37.75	1,358,849.00	
	QORVO INC	9,678	192.94	1,867,273.32	
	QUALCOMM	98,431	141.43	13,921,096.33	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	189.57	2,722,035.63	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	267.68	1,231,328.00	
	TERADYNE INC	14,398	125.70	1,809,828.60	
	TEXAS INSTRUMENTS	79,929	190.27	15,208,090.83	
	XILINX INC	20,982	135.59	2,844,949.38	
	アメリカドル 小計	27,570,759		3,343,499,419.84 (368,353,331,083)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	22.79	612,595.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	44.51	4,575,004.86	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	11.37	1,099,092.42	
	ENBRIDGE	173,165	50.11	8,677,298.15	
	IMPERIAL OIL	24,763	36.45	902,611.35	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	20.12	713,354.60	
	KEYERA CORP	18,607	33.08	615,519.56	
	PARKLAND CORP	14,075	39.68	558,496.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	39.91	1,822,530.06	
	SUNCOR ENERGY	132,181	28.97	3,829,283.57	
	TC ENERGY CORP	82,366	62.56	5,152,816.96	
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	76.52	1,552,820.36	
	B2GOLD CORP	90,243	5.06	456,629.58	
	BARRICK GOLD CORP	153,589	26.32	4,042,462.48	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	68.64	901,860.96	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	28.85	1,586,750.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	16,953	183.35	3,108,332.55	

IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.20	476,992.40
KINROSS GOLD CORP	108,451	7.86	852,424.86
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	49.03	1,148,674.84
LUNDIN MINING CORP	62,243	11.54	718,284.22
NUTRIEN LTD	48,966	76.22	3,732,188.52
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	35.44	652,485.84
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	29.28	1,187,626.08
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	93.46	728,988.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	55.32	2,186,688.96
YAMANA GOLD INC	81,672	5.25	428,778.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	21.15	417,162.60
CAE INC	25,999	38.55	1,002,261.45
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	104.71	806,790.55
WSP GLOBAL INC	10,656	149.91	1,597,440.96
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	39.50	533,447.50
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	74.32	761,408.40
THOMSON REUTERS CORP	15,013	126.31	1,896,292.03
AIR CANADA	13,805	25.75	355,478.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	133.74	8,140,753.80
CP RAILWAY LIMITED	57,581	93.04	5,357,336.24
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	112.87	2,627,839.34
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	44.16	754,208.64
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	80.10	1,848,147.30
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.05	502,360.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.18	1,281,567.96
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	193.87	1,048,642.83
DOLLARAMA INC	26,700	57.18	1,526,706.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	46.34	3,436,250.02
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.86	607,984.58
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	78.57	1,014,574.41
METRO INC	18,840	60.52	1,140,196.80
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	119.30	821,141.90
SAPUTO INC	24,489	37.00	906,093.00
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	36.47	1,013,866.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	27.59	579,086.51
BANK MONTREAL	55,894	126.12	7,049,351.28
BANK NOVA SCOTIA	104,760	78.90	8,265,564.00
CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	141.87	5,503,137.30
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	93.50	2,551,521.50
ROYAL BANK OF CANADA	122,804	126.37	15,518,741.48
TORONTO-DOMINION BANK	156,322	84.70	13,240,473.40
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,862	63.85	7,078,538.70

	IGM FINANCIAL INC	7,685	43.98	337,986.30
	ONEX CORP	6,603	90.06	594,666.18
	TMX GROUP LTD	4,685	129.31	605,817.35
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	548.49	1,169,929.17
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.78	874,922.64
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	67.15	678,147.85
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	172.03	2,243,787.29
	MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	23.99	3,911,713.44
	POWER CORP OF CANADA	51,551	38.99	2,009,973.49
	SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	63.29	3,208,929.58
	FIRSTSERVICE CORP	3,690	222.08	819,475.20
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.69	578,786.00
	CGI INC - CL A	18,428	114.49	2,109,821.72
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	1,919.74	3,188,688.14
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	8,296	106.02	879,541.92
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	103.49	445,110.49
	OPEN TEXT CORP	24,643	64.15	1,580,848.45
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,710	1,862.97	18,089,438.70
	BCE INC	6,203	61.99	384,523.97
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	66.69	2,039,646.96
	TELUS CORP	32,908	27.96	920,107.68
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.77	972,623.86
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.49	646,223.55
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	44.26	231,966.66
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	50.87	574,576.65
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.97	361,030.28
	EMERA INC	23,704	57.09	1,353,261.36
	FORTIS INC	42,633	55.61	2,370,821.13
	HYDRO ONE LTD	32,299	30.47	984,150.53
	NORTHLAND POWER INC	17,854	42.87	765,400.98
	カナダドル 小計	3,516,775		206,436,873.13 (18,257,277,059)
ユーロ	ENI	218,529	10.08	2,202,772.32
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.97	441,663.73
	NESTE OIL OYJ	37,233	52.28	1,946,541.24
	OMV AG	12,549	47.04	590,304.96
	REPSOL SA	127,332	9.84	1,253,965.53
	TENARIS SA	40,648	9.00	365,913.29
	TOTALENERGIES SE	217,070	37.45	8,129,271.50
	VOPAK	6,360	38.13	242,506.80
	AIR LIQUIDE	40,492	147.92	5,989,576.64
	AKZO NOBEL	15,301	105.25	1,610,430.25

ARCELORMITTAL	61,651	26.29	1,620,804.79
ARKEMA	5,949	106.80	635,353.20
BASF SE	78,752	68.01	5,355,923.52
COVESTRO AG	17,254	56.14	968,639.56
CRH PLC	64,773	42.40	2,746,375.20
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	28.73	567,532.42
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	41.06	236,587.72
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	74.62	973,119.42
KONINKLIJKE DSM NV	14,947	158.15	2,363,868.05
LANXESS	7,293	58.42	426,057.06
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	23,039	46.39	1,068,779.21
SOLVAY SA	6,906	110.00	759,660.00
STORA ENSO OYJ R	54,792	16.11	882,699.12
SYMRISE AG	11,456	120.20	1,377,011.20
UMICORE	17,605	51.34	903,840.70
UPM KYMMENE OYJ	45,603	33.19	1,513,563.57
VOESTALPINE AG	7,152	35.58	254,468.16
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,693	22.12	435,609.16
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	19,693	1.25	24,616.25
AIRBUS SE	50,151	112.76	5,655,026.76
ALSTOM	24,388	37.83	922,598.04
BOUYGUES ORD	21,446	31.76	681,124.96
BRENTAG SE	12,514	81.86	1,024,396.04
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	13.67	1,272,130.55
DASSAULT AVIATION SA	213	988.00	210,444.00
EIFFAGE	7,964	86.90	692,071.60
FERROVIAL SA	41,438	25.46	1,055,011.48
GEA GROUP AG	13,382	35.07	469,306.74
KINGSPAN GROUP PLC	14,482	84.86	1,228,942.52
KION GROUP AG	5,887	92.26	543,134.62
KNORR-BREMSE AG	6,822	96.16	656,003.52
KONE OYJ-B	29,051	69.76	2,026,597.76
LEGRAND SA	21,768	91.70	1,996,125.60
MTU AERO ENGINES AG	4,753	213.80	1,016,191.40
PRYSMIAN SPA	21,155	30.52	645,650.60
RATIONAL AG	483	798.60	385,723.80
SAFRAN SA	28,410	119.92	3,406,927.20
SAINT-GOBAIN	43,973	57.75	2,539,440.75
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,506	137.02	6,372,252.12
SIEMENS	66,090	132.84	8,779,395.60
SIEMENS ENERGY AG	36,181	25.88	936,364.28
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	26.93	604,174.55

THALES SA	9,665	89.82	868,110.30
VINCI S.A.	45,934	91.74	4,213,985.16
WARTSILA OYJ	41,917	12.78	535,908.84
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.85	673,210.05
RANDSTAD NV	11,218	65.16	730,964.88
TELEPERFORMANCE	4,734	348.00	1,647,432.00
WOLTERS KLUWER	22,949	86.60	1,987,383.40
ADP	2,382	111.05	264,521.10
AENA SME SA	6,542	138.65	907,048.30
ATLANTIA SPA	46,597	15.44	719,457.68
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	10.05	234,023.23
DEUTSCHE POST AG-REG	85,364	58.27	4,974,160.28
GETLINK	44,101	13.86	611,239.86
INPOST SA	12,480	17.69	220,846.08
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	87.68	2,515,013.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.00	374,325.00
CONTINENTAL AG	9,928	118.64	1,177,857.92
DAIMLER AG	73,367	72.89	5,347,720.63
FAURECIA	10,948	40.36	441,861.28
FERRARI NV	10,170	176.00	1,789,920.00
MICHELIN	13,839	137.10	1,897,326.90
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	92.90	1,303,201.20
RENAULT SA	17,362	33.50	581,627.00
STELLANTIS NV	170,174	16.48	2,805,488.56
VALEO SA	21,538	24.98	538,019.24
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,304	212.35	3,462,154.40
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	281.20	699,063.20
ADIDAS AG	16,242	318.45	5,172,264.90
ESSILORLUXOTTICA	25,177	154.34	3,885,818.18
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,235.50	3,374,150.50
KERING	6,473	731.20	4,733,057.60
LVMH	24,043	662.40	15,926,083.20
MONCLER SPA	18,219	56.36	1,026,822.84
PUMA SE	9,220	102.90	948,738.00
SEB SA	2,282	148.70	339,333.40
ACCOR	14,436	31.41	453,434.76
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	150.80	2,189,314.40
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	49.03	397,535.24
SODEXO	8,135	76.12	619,236.20
BOLLORE	83,646	4.49	375,905.12
PUBLICIS GROUPE	17,077	53.16	907,813.32
SCOUT24 AG	7,492	70.82	530,583.44

UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	59.78	422,704.38
VIVENDI	61,243	28.25	1,730,114.75
DELIVERY HERO SE	13,414	119.15	1,598,278.10
HELLOFRESH SE	13,805	82.34	1,136,703.70
INDITEX	95,060	29.73	2,826,133.80
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	74.89	1,166,187.08
PROSUS	43,038	77.36	3,329,419.68
ZALANDO SE	17,664	101.50	1,792,896.00
CARREFOUR	52,544	16.35	859,094.40
COLRUYT SA	5,424	46.90	254,385.60
JERONIMO MARTINS	24,901	16.63	414,228.13
KESKO OYJ-B SHS	25,583	32.17	823,005.11
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	25.34	2,214,716.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	58.88	3,755,837.44
DANONE (GROUPE)	54,643	59.46	3,249,072.78
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.18	548,680.86
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	84.30	902,094.30
HEINEKEN NV	22,407	99.14	2,221,429.98
JDE PEET'S BV	7,000	31.13	217,910.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	120.50	1,572,525.00
PERNOD-RICARD	18,224	180.85	3,295,810.40
REMY COINTREAU	2,382	178.40	424,948.80
BEIERSDORF AG	9,190	102.15	938,758.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	78.35	687,913.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	87.76	1,267,166.64
LOREAL	21,631	371.80	8,042,405.80
AMPLIFON SPA	11,650	38.07	443,515.50
BIOMERIEUX	4,175	93.82	391,698.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	166.25	570,237.50
DIASORIN SPA	2,070	160.65	332,545.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	69.00	1,205,568.00
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	44.51	1,499,497.39
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	39.06	3,016,017.90
ORPEA	4,336	106.65	462,434.40
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	465.00	1,034,160.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	53.22	1,306,338.12
ARGENX SE	4,178	261.90	1,094,218.20
BAYER	83,832	50.83	4,261,180.56
EUROFINS SCIENTIFIC	12,420	101.58	1,261,623.60
GRIFOLS SA	27,685	21.68	600,210.80
IPSEN	3,532	88.00	310,816.00
MERCK KGAA	10,555	169.50	1,789,072.50



ORION OYJ-CLASS B	9,854	37.21	366,667.34
QIAGEN N.V.	21,801	42.70	930,902.70
RECORDATI SPA	9,859	50.20	494,921.80
SANOFI	97,536	87.22	8,507,089.92
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	434.30	1,050,571.70
UCB (GROUPE)	11,875	90.30	1,072,312.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.05	401,206.05
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	5.22	3,015,675.83
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.12	4,601,576.11
BNP PARIBAS	97,090	50.93	4,944,793.70
CAIXABANK	380,168	2.55	971,329.24
COMMERZBANK AG	94,388	5.70	538,577.92
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	11.79	1,267,418.62
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	31.09	743,206.45
FINECOBANK SPA	53,120	14.95	794,144.00
ING GROEP NV-CVA	343,429	10.87	3,735,133.80
INTESA SANPAOLO	1,441,455	2.28	3,292,283.22
KBC GROEP NV	21,052	66.30	1,395,747.60
MEDIOBANCA	53,990	9.75	526,510.48
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	18.89	235,936.10
SOCIETE GENERALE	67,846	24.77	1,680,884.65
UNICREDIT SPA	189,030	9.74	1,842,097.35
AMUNDI SA	6,226	75.80	471,930.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	10.50	1,861,261.50
DEUTSCHE BOERSE	16,510	144.45	2,384,869.50
EURAZEO SA	3,357	73.80	247,746.60
EXOR NV	10,345	66.70	690,011.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,615	95.38	1,012,458.70
NATIXIS	89,751	4.00	359,093.75
SOFINA	1,238	367.60	455,088.80
WENDEL	2,023	109.70	221,923.10
AEGON	166,267	3.55	590,912.91
AGEAS	16,065	46.84	752,484.60
ALLIANZ SE-REG	35,536	212.10	7,537,185.60
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	16.88	1,647,418.79
AXA SA	166,887	21.81	3,640,639.90
CNP ASSURANCES	16,287	14.67	238,930.29
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	146.00	845,194.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,376	230.85	2,856,999.60
NN GROUP NV	22,611	40.62	918,458.82
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.99	506,154.82
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	39.65	1,707,923.75

SCOR SE	13,354	25.59	341,728.86
AROUNDTOWN SA	94,068	6.66	626,869.15
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	51.58	1,448,985.36
LEG IMMOBILIEN SE	6,992	130.80	914,553.60
VONOVIA SE	45,080	57.62	2,597,509.60
ADYEN NV	1,666	2,118.50	3,529,421.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	57.58	2,251,032.52
ATOS SE	9,750	52.74	514,215.00
BECHTLE AG	2,553	161.35	411,926.55
CAPGEMINI SA	13,914	167.05	2,324,333.70
DASSAULT SYSTEMES SA	57,125	42.62	2,434,953.12
EDENRED	22,756	48.61	1,106,169.16
NEMETSCHKE SE	5,455	67.00	365,485.00
NEXI SPA	41,348	18.54	766,591.92
SAP SE	90,249	124.72	11,255,855.28
TEAMVIEWER AG	14,174	28.12	398,572.88
WORLDLINE SA	20,332	80.83	1,643,435.56
NOKIA OYJ	450,608	4.65	2,097,354.93
CELLNEX TELECOM SA	41,435	54.56	2,260,693.60
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	18.00	5,130,612.00
ELISA A	13,387	51.52	689,698.24
ILIAD SA	1,253	120.55	151,049.15
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.70	294,698.25
KPN (KON.)	282,927	2.68	759,376.06
ORANGE	171,535	9.48	1,627,009.47
PROXIMUS	13,141	16.54	217,417.84
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.39	333,688.85
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.42	201,646.04
TELEFONICA	456,377	3.76	1,717,803.02
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.43	239,877.45
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	33.94	322,871.22
E.ON SE	185,377	10.12	1,877,498.25
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.48	439,623.68
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.37	449,551.37
ELIA GROUP SA/NV	2,925	90.65	265,151.25
ENAGAS	25,299	18.33	463,730.67
ENDESA	25,972	21.25	551,905.00
ENEL	692,930	7.92	5,490,777.32
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.63	1,046,590.90
ENGIE	158,224	11.60	1,836,347.74
FORTUM OYJ	41,901	23.06	966,237.06
IBERDROLA SA	498,312	10.28	5,122,647.36

	IBERDROLA SA-RTS	498,312	0.25	127,069.56
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	22.07	514,451.70
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.75	624,204.00
	RWE STAMM	55,390	31.27	1,732,045.30
	SNAM SPA	189,497	4.89	927,019.32
	SUEZ	32,549	19.54	636,170.20
	TERNA SPA	130,230	6.42	836,337.06
	UNIPER SE	7,335	31.65	232,152.75
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	25.95	1,126,930.65
	VERBUND AG	6,430	80.45	517,293.50
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	278.70	1,175,277.90
	ASML HOLDING NV	36,125	583.10	21,064,487.50
	INFINEON TECHNOLOGIES	112,361	33.11	3,720,272.71
	STMICROELECTRONICS	55,076	32.11	1,768,765.74
	ユーロ 小計	16,893,642		410,523,651.75 (53,704,704,121)
イギリスポンド	BP PLC	1,757,685	3.10	5,464,642.66
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	354,259	14.68	5,201,939.15
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,099	14.33	4,587,018.67
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	29.91	3,258,574.86
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.42	517,222.80
	BHP GROUP PLC	182,400	22.62	4,125,888.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,112	76.38	1,001,494.56
	EVRAZ PLC	43,000	6.15	264,536.00
	GLENCORE PLC	875,677	3.19	2,796,912.33
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	31.62	532,733.76
	MONDI PLC	36,710	19.79	726,490.90
	RIO TINTO PLC REG	96,096	61.06	5,867,621.76
	ASHTREAD GROUP PLC	37,034	55.32	2,048,720.88
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.38	1,399,359.52
	BUNZL PLC	24,880	25.56	635,932.80
	DCC PLC	9,127	59.60	543,969.20
	FERGUSON PLC	19,417	103.50	2,009,659.50
	MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.59	728,315.28
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786,119	1.01	793,980.19
	SMITHS GROUP PLC	37,146	16.21	602,136.66
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	140.10	772,511.40
	EXPERIAN PLC	79,162	29.38	2,325,779.56
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	56.02	778,117.80
	RELX PLC	166,847	20.08	3,350,287.76
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.07	712,514.56
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.05	680,878.20

BURBERRY GROUP PLC	29,776	20.63	614,278.88
PERSIMMON PLC	25,686	30.04	771,607.44
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.64	585,867.36
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	47.58	562,823.82
COMPASS GROUP PLC	155,632	15.25	2,373,388.00
ENTAIN PLC	49,630	18.70	928,081.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	48.23	773,657.43
WHITBREAD PLC	17,434	31.36	546,730.24
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	6.40	623,438.32
INFORMA PLC	141,175	5.07	716,886.65
PEARSON	66,305	8.21	544,629.27
WPP PLC	113,065	9.67	1,094,016.94
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	9.57	395,863.05
KINGFISHER PLC	198,587	3.67	730,005.81
NEXT PLC	11,468	78.40	899,091.20
OCADO GROUP PLC	44,612	19.09	851,643.08
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.64	554,613.18
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.84	421,568.07
TESCO PLC	666,000	2.37	1,583,082.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	21.85	731,756.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	188,273	27.72	5,219,868.92
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.73	462,110.80
DIAGEO	200,801	34.34	6,895,506.34
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.84	1,283,223.17
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	64.32	3,893,546.88
UNILEVER PLC	227,095	42.95	9,753,730.25
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	15.70	1,077,284.47
ASTRAZENECA	113,182	86.48	9,787,979.36
GLAXOSMITHKLINE	430,042	14.35	6,171,962.78
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	26.23	431,588.42
BARCLAYS	1,516,252	1.73	2,628,574.46
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,754,485	4.14	7,265,322.38
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,190,268	0.46	2,891,474.18
NATWEST GROUP PLC	369,149	2.02	747,157.57
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.54	964,717.28
3I GROUP PLC	88,121	12.02	1,059,655.02
ABRDN PLC	210,980	2.83	598,550.26
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	16.53	546,961.26
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	78.72	2,172,042.24
M&G PLC	229,107	2.27	521,905.74
SCHRODERS PLC	11,794	35.94	423,876.36
ST JAMES'S PLACE PLC	50,535	15.18	767,121.30

	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	31.21	507,318.55
	AVIVA PIC	332,730	4.05	1,347,556.50
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.92	332,502.66
	LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.65	1,367,644.66
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.89	351,600.89
	PRUDENTIAL	225,330	13.79	3,107,300.70
	AVEVA GROUP PLC	10,917	39.24	428,383.08
	SAGE GROUP PLC	95,210	6.93	660,566.98
	HALMA PLC	31,069	27.75	862,164.75
	BT GROUP PLC	769,485	1.87	1,443,169.11
	VODAFONE GROUP PLC	2,359,596	1.18	2,799,424.69
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.39	2,882,316.96
	SEVERN TRENT PLC	22,468	26.47	594,727.96
	SSE PLC	92,294	15.29	1,411,175.26
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.31	604,252.70
	イギリスポンド 小計	25,504,232		152,294,531.89 (23,317,815,777)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.69	325,168.62
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	937.00	537,838.00
	GIVAUDAN-REG	795	4,333.00	3,444,735.00
	HOLCIM LTD	45,387	53.64	2,434,558.68
	SIKA AG-BR	12,505	309.10	3,865,295.50
	ABB LTD	149,042	32.85	4,896,029.70
	GEBERIT AG-REG	2,964	710.40	2,105,625.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	272.00	574,464.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	280.70	1,057,677.60
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	62.58	911,978.34
	SGS SA	506	2,896.00	1,465,376.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	314.60	1,439,924.20
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	45,940	110.65	5,083,261.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	310.20	770,226.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	59.55	234,507.90
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,208.00	618,240.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	99,200.00	992,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,525.00	781,050.00
	NESTLE SA - REGISTERED	248,795	115.20	28,661,184.00
	ALCON INC	42,603	64.42	2,744,485.26
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	330.20	1,544,345.40
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,545.00	1,319,430.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,536	666.80	4,358,204.80
	NOVARTIS	191,990	84.94	16,307,630.60
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	381.40	1,067,538.60

	ROCHE HOLDING GENUSS	60,854	353.10	21,487,547.40
	VIFOR PHARMA AG	4,486	123.90	555,815.40
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	81.00	231,174.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.19	1,960,622.17
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	57.60	1,088,467.20
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,941	1,420.00	2,756,220.00
	UBS GROUP AG	315,017	13.67	4,307,857.47
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	144.30	629,436.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	453.30	1,291,451.70
	SWISS RE LTD	24,674	84.20	2,077,550.80
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	365.10	4,651,374.00
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	94.60	705,526.80
	TEMENOS AG - REG	6,511	147.15	958,093.65
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	114.95	1,688,155.70
	SWISSCOM	2,187	535.80	1,171,794.60
	スイスフラン 小計	1,498,047		133,101,862.89 (16,040,105,496)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	295.90	5,095,989.80
	BOLIDEN AB	23,903	332.50	7,947,747.50
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	149.85	8,536,504.95
	ALFA LAVAL AB	27,268	311.80	8,502,162.40
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	268.30	23,220,828.40
	ATLAS COPCO A	58,390	543.00	31,705,770.00
	ATLAS COPCO B	31,902	458.70	14,633,447.40
	EPIROC AB-A	58,039	203.80	11,828,348.20
	EPIROC AB-B	37,972	173.10	6,572,953.20
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	292.70	4,098,385.40
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	90.34	9,722,752.16
	SANDVIK AB	96,684	223.50	21,608,874.00
	SKANSKA B	32,007	234.90	7,518,444.30
	SKF AB-B	35,405	220.60	7,810,343.00
	VOLVO AB-A SHS	13,514	217.80	2,943,349.20
	VOLVO B	123,279	211.95	26,128,984.05
	SECURITAS B	29,533	140.20	4,140,526.60
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	239.50	5,093,925.50
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	115.90	4,486,720.80
	EVOLUTION AB	14,096	1,422.80	20,055,788.80
EMBRACER GROUP AB	18,755	222.90	4,180,489.50	
HENNES & MAURITZ B	65,999	198.38	13,092,881.62	
ICA GRUPPEN AB	9,493	401.20	3,808,591.60	
SWEDISH MATCH AB	127,270	75.46	9,603,794.20	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	286.60	14,179,248.40	

	NORDEA BANK ABP	280,957	95.40	26,803,297.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	111.75	15,474,022.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.60	12,932,967.60	
	SWEDBANK AB-A	72,526	163.80	11,879,758.80	
	EQT AB	20,102	342.30	6,880,914.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	330.60	3,344,019.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	312.20	3,486,649.60	
	INVESTOR AB-B SHS	157,664	205.20	32,352,652.80	
	KINNEVIK AB - B	18,792	343.90	6,462,568.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	571.00	4,156,880.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	587.40	5,550,930.00	
	SINCH AB	33,150	141.25	4,682,437.50	
	ERICSSON (LM) B	253,862	112.14	28,468,084.68	
	HEXAGON AB-B SHS	169,708	131.20	22,265,689.60	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	120.05	6,003,940.60	
	TELIA CO AB	230,643	38.41	8,860,150.84	
	スウェーデンクローナ 小計	2,790,392		476,121,815.70	(6,118,165,331)
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	177.66	13,567,894.20	
	NORSK HYDRO	126,800	56.40	7,151,520.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	476.60	7,820,052.80	
	ADEVINTA ASA	19,117	173.05	3,308,196.85	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	399.60	3,705,890.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	448.00	3,172,736.00	
	MOWI ASA	40,968	223.80	9,168,638.40	
	ORKLA	69,804	89.68	6,260,022.72	
	DNB BANK ASA	85,517	186.95	15,987,403.15	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	201.60	3,744,518.40	
	TELENOR ASA	65,744	149.65	9,838,589.60	
	ノルウェークローネ 小計	535,658		83,725,462.52	(1,062,476,119)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	561.80	5,812,944.60	
	NOVOZYMES A/S	19,125	474.30	9,070,987.50	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,200.00	2,416,000.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	241.70	21,118,537.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,450.00	5,217,550.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,045.00	9,275,130.00	
	DSV PANALPINA A S	18,142	1,519.50	27,566,769.00	
	PANDORA A/S	9,401	857.80	8,064,177.80	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,158.50	10,016,391.00	
	AMBU A/S-B	13,555	224.50	3,043,097.50	
	COLOPLAST-B	9,208	1,049.50	9,663,796.00	

	DEMANT A/S	11,604	337.10	3,911,708.40
	GN STORE NORD A/S	11,967	551.40	6,598,603.80
	GENMAB A/S	5,192	2,689.00	13,961,288.00
	NOVO NORDISK A/S-B	147,877	544.60	80,533,814.20
	DANSKE BANK A/S	64,813	113.60	7,362,756.80
	TRYG A/S	29,772	157.90	4,700,998.80
	ORSTED A/S	15,439	926.60	14,305,777.40
	デンマーククローネ 小計	464,031		242,640,328.30 (4,268,043,374)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	29.09	600,097.61
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.89	723,995.13
	SANTOS	156,437	7.12	1,113,831.44
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	33.60	430,516.80
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	23.44	1,744,029.76
	BHP GROUP LTD	252,353	49.48	12,486,426.44
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	21.26	1,048,713.28
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.57	558,243.78
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	23.87	3,305,589.21
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	44.01	1,626,081.48
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	25.71	1,905,059.58
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.10	1,026,442.80
	ORICA LTD	38,288	13.27	508,081.76
	RIO TINTO LTD	32,028	125.40	4,016,311.20
	SOUTH32 LTD	341,133	2.93	999,519.69
	REECE LTD	16,814	22.99	386,553.86
	BRAMBLES LTD	137,883	11.39	1,570,487.37
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.75	718,091.25
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.72	401,200.00
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.42	3,366,969.06
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	41.70	2,199,758.40
	CROWN RESORTS LTD	30,328	10.99	333,304.72
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	114.72	406,223.52
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.78	870,022.14
	REA GROUP LTD	5,276	165.08	870,962.08
	SEEK LTD	31,593	31.94	1,009,080.42
	WESFARMERS LTD	100,575	58.00	5,833,350.00
COLES GROUP LTD	115,478	16.85	1,945,804.30	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.25	686,881.25	
WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	38.07	4,183,931.07	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.90	839,402.20	
COCHLEAR LIMITED	6,220	243.26	1,513,077.20	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	63.26	1,027,848.48	



	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	38.03	1,524,090.28	
	CSL LIMITED	38,878	275.47	10,709,722.66	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	27.85	6,675,115.85	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	152,346	98.59	15,019,792.14	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	26.08	7,266,879.04	
	WESTPAC BANKING	318,928	25.37	8,091,203.36	
	ASX LTD	18,195	75.54	1,374,450.30	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	154.19	4,596,866.47	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	51.21	558,803.52	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	4.87	1,117,212.09	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.24	874,346.40	
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	10.50	1,449,745.50	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	11.27	1,345,119.58	
	AFTERPAY LTD	19,934	117.51	2,342,444.34	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.00	710,016.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	30.63	422,724.63	
	XERO LTD	11,340	134.28	1,522,735.20	
	TELSTRA CORP	308,467	3.75	1,156,751.25	
	AGL ENERGY LTD	64,235	8.14	522,872.90	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.75	328,439.47	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.55	753,457.25	
	オーストラリアドル 小計	5,834,938		128,618,675.51 (10,594,320,301)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.46	879,317.66	
	A2 MILK CO LTD	66,854	7.60	508,090.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	30.00	1,635,600.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.09	475,389.53	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.89	846,547.02	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.55	423,215.15	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.22	577,039.68	
	ニュージーランドドル 小計	623,837		5,345,199.44 (411,526,904)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	57.65	13,230,444.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	131.30	15,427,750.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	30.95	5,323,400.00	
	MTR CORP	151,000	44.20	6,674,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	59.60	10,370,400.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	30.85	6,108,300.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.17	1,078,440.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	11.64	1,638,912.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	17.10	2,944,620.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.60	3,443,240.00	

	WH GROUP LTD	936,500	6.61	6,190,265.00
	BANK EAST ASIA	109,160	13.72	1,497,675.20
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	25.40	7,150,100.00
	HANG SENG BANK	59,400	152.50	9,058,500.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	104,100	490.00	51,009,000.00
	AIA GROUP LTD	1,045,200	94.55	98,823,660.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	207,496	52.90	10,976,538.40
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.70	3,877,900.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.18	3,145,140.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	36.40	4,558,299.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	37.35	5,093,606.25
	SINO LAND CO	315,400	12.48	3,936,192.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	113.50	13,449,750.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	51.50	2,085,750.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.35	2,150,070.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	43.75	6,868,750.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	45.25	3,054,375.00
	CLP HOLDINGS	137,500	77.25	10,621,875.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.24	11,073,001.68
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	47.30	6,503,750.00
	香港ドル 小計	6,942,612		327,363,904.13 (4,642,020,160)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.24	719,452.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.94	580,756.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.02	543,826.64
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.84	516,600.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.51	805,486.00
	DBS GROUP	155,200	29.66	4,603,232.00
	OCBC BANK	291,200	11.91	3,468,192.00
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	25.74	2,416,986.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	11.16	873,828.00
	CAPITALAND LTD	223,500	3.76	840,360.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.99	299,172.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.31	347,225.00
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.92	486,244.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.26	1,700,069.18
	シンガポールドル 小計	2,896,975		18,201,428.82 (1,483,962,491)
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	21.85	1,480,468.60
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	417.50	895,955.00
	BANK HAPUALIM BM	98,310	26.80	2,634,708.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	25.24	2,747,727.36

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.55	1,547,225.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	99.50	1,244,048.50	
	AZRIELI GROUP	4,323	240.20	1,038,384.60	
	NICE LTD	5,891	836.00	4,924,876.00	
	イスラエルシェケル 小計	399,293		16,513,393.06	(555,221,558)
	合 計	95,471,191		508,808,969,774	(508,808,969,774)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,042,302.43	
		LENDLEASE GROUP	64,786	755,404.76	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	965,270.25	
		オーストラリアドル 小計	303,750	2,762,977.44	(227,586,451)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,730,925.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,945,000.00	
		香港ドル 小計	595,500	5,675,925.00	(80,484,616)
	投資信託受益証券合計	899,250	308,071,067	(308,071,067)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	781,331.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,090,524.05	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,586	10,744,271.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,116,663.57	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,655,480.75	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,526,607.93	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,240,689.84	
		CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	7,435,197.48	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,924	3,726,402.24	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,572,269.00	
		EQUINIX INC	7,704	6,319,745.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,300,936.56	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32,077	2,621,011.67	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,764,522.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,882,228.92	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,573,411.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,158,500.99	
INVITATION HOMES INC	51,458	2,053,174.20			

	IRON MOUNTAIN INC	27,546	1,204,862.04	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,025,738.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,735,262.10	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	780,506.53	
	PROLOGIS INC	63,163	7,920,008.57	
	PUBLIC STORAGE	13,912	4,336,092.16	
	REALTY INCOME CORP	31,608	2,176,842.96	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	813,340.11	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,586	3,156,957.38	
	SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,654,145.44	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,639,586.55	
	UDR INC	28,059	1,457,945.64	
	VENTAS INC	31,565	1,850,971.60	
	VEREIT INC	21,159	1,008,014.76	
	VICI PROPERTIES INC	49,459	1,554,990.96	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	715,942.80	
	WELLTOWER INC	35,679	3,083,735.97	
	WP CAREY INC	16,500	1,286,505.00	
	アメリカドル 小計	1,058,468	90,964,417.95	(10,021,549,925)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	544,684.23	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	356,270.00	
	カナダドル 小計	24,377	900,954.23	(79,680,392)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	384,555.00	
	GECINA SA	4,459	592,378.15	
	KLEPIERRE	17,225	381,706.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	788,620.65	
	ユーロ 小計	37,101	2,147,259.80	(280,904,527)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	409,140.92	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	457,011.91	
	SEGRO PLC	106,999	1,246,003.35	
	イギリスポンド 小計	252,762	2,112,156.18	(323,392,232)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	971,949.70	
	GOODMAN GROUP	139,848	2,984,356.32	
	GPT GROUP	167,884	812,558.56	
	MIRVAC GROUP	392,919	1,151,252.67	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,318,856.73	
	STOCKLAND	207,412	939,576.36	
	VICINITY CENTERS	365,149	567,806.69	

オーストラリアドル 小計		1,853,965	8,746,357.03 (720,437,428)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	12,642,575.00	
香港ドル 小計		170,500	12,642,575.00 (179,271,713)	
シンガポールドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	855,255.38	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	912,838.40	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	481,800.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	573,478.50	
シンガポールドドル 小計		1,203,783	2,823,372.28 (230,189,541)	
投資証券合計		4,600,956	11,835,425,758 (11,835,425,758)	
合計			12,143,496,825 (12,143,496,825)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 601銘柄	97.4%			70.7%
	投資証券 36銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.6%			3.5%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	99.5%			10.3%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 83銘柄	98.6%			4.5%
	投資証券 3銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 41銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	91.8%			2.0%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.2%	0.1%

ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 30銘柄	94.7%			0.9%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.6%			0.3%
	投資証券 4銘柄			13.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	147,866,668
コール・ローン	1,872,563
株式	19,066,338,895
投資信託受益証券	57,721,604
投資証券	499,302,166
派生商品評価勘定	4,856,058
未収配当金	12,102,121
差入委託証拠金	199,023,727
流動資産合計	19,989,083,802
資産合計	19,989,083,802
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	4,856,058
未払利息	2
流動負債合計	4,856,060
負債合計	4,856,060
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	13,765,562,898
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	6,218,664,844
元本等合計	19,984,227,742
純資産合計	19,984,227,742
負債純資産合計	19,989,083,802

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p>

	2021年 7月12日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,765,562,898口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4518円 (1万口当たり純資産額) (14,518円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>



	2021年 7月12日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	12,431,370,895円
期中追加設定元本額	5,159,528,372円
期中一部解約元本額	3,825,336,369円
期末元本額	13,765,562,898円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,549,734,376円
分散投資コア戦略ファンドS	7,499,598,114円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	4,716,230,408円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	542,361,921
投資信託受益証券	2,889,355
投資証券	47,271,608
合計	586,744,174

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	206,057,390	-	210,913,448	4,856,058
	合計	206,057,390	-	210,913,448	4,856,058

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	CHENIERE ENERGY INC	1,339	88.01	117,845.39	
	NEWMONT CORPORATION	35,173	63.98	2,250,368.54	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	13,300	63.93	850,269.00	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	970	88.80	86,136.00	
	REPUBLIC SERVICES INC	14,785	112.67	1,665,825.95	
	ROLLINS INC	3,531	35.39	124,962.09	
	WASTE CONNECTIONS INC	14,641	122.14	1,788,251.74	
	WASTE MANAGEMENT INC	15,745	143.04	2,252,164.80	
	AMERCO	655	584.00	382,520.00	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,653	93.17	526,690.01	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	1,370	128.40	175,908.00	
	UNITED PARCEL SERVICE B	930	213.92	198,945.60	
	PELOTON INTERACTIVE INC-A	3,759	117.84	442,960.56	
	DOMINO'S PIZZA INC	1,557	477.56	743,560.92	
	MCDONALD'S CORP	6,081	235.68	1,433,170.08	
	STARBUCKS CORP	4,816	117.47	565,735.52	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	16,005	92.38	1,478,541.90	
	ALPHABET INC-CL C	706	2,591.49	1,829,591.94	
	COMCAST CORP-CL A	3,546	58.03	205,774.38	
	ELECTRONIC ARTS INC	6,545	140.99	922,779.55	
	NEWS CORP-CLASS A	26,008	25.52	663,724.16	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,251	170.37	894,612.87	
	AMAZON.COM	165	3,719.34	613,691.10	
	AUTOZONE INC	484	1,564.53	757,232.52	
	DOLLAR GENERAL CORP	8,243	220.77	1,819,807.11	
	DOLLAR TREE INC	3,511	99.51	349,379.61	
HOME DEPOT	927	322.09	298,577.43		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	339	591.65	200,569.35		
TARGET (DAYTON HUDSON)	7,150	248.58	1,777,347.00		

KROGER CO	47,884	38.27	1,832,520.68
WALMART INC	11,863	140.30	1,664,378.90
BOSTON BEER COMPANY INC-A	220	973.58	214,187.60
CAMPBELL SOUP CO (US)	6,910	45.64	315,372.40
GENERAL MILLS INC	5,102	59.70	304,589.40
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,292	176.75	1,642,361.00
HORMEL FOODS CORP	19,706	47.44	934,852.64
JM SMUCKER CO	4,903	130.85	641,557.55
KELLOGG CO	10,013	64.28	643,635.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,111	87.10	793,568.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,545	63.02	97,365.90
PEPSICO INC	16,788	149.48	2,509,470.24
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,242	86.98	716,889.16
CLOROX COMPANY	3,072	180.88	555,663.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	9,163	82.43	755,306.09
KIMBERLY-CLARK CORP	3,973	135.02	536,434.46
PROCTER & GAMBLE CO	10,421	137.03	1,427,989.63
ABBOTT LABORATORIES	4,104	119.74	491,412.96
ANTHEM INC	392	388.61	152,335.12
BAXTER INTERNATIONAL	7,662	80.43	616,254.66
BECTON DICKINSON & CO	543	249.80	135,641.40
DANAHER CORP	4,236	277.47	1,175,362.92
MASIMO CORP	1,278	260.33	332,701.74
MEDTRONIC PLC	7,708	128.17	987,934.36
TELADOC HEALTH INC	603	158.60	95,635.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,668	412.11	687,399.48
AMGEN	463	245.20	113,527.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	390	675.17	263,316.30
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,582	67.16	374,887.12
GILEAD SCIENCES INC	25,078	68.22	1,710,821.16
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,460	95.28	234,388.80
INCYTE CORP	3,448	82.04	282,873.92
JOHNSON & JOHNSON	14,293	169.75	2,426,236.75
LILLY (ELI) & CO	10,168	234.99	2,389,378.32
MERCK & CO	19,895	77.99	1,551,611.05
MODERNA INC	2,219	232.81	516,605.39
PFIZER	31,065	39.61	1,230,484.65
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,530	580.40	2,048,812.00
SEAGEN INC	1,140	148.50	169,290.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,178	198.16	2,215,032.48
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	8,997	280.49	2,523,568.53
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,462	118.79	292,460.98

CME GROUP INC	1,625	209.62	340,632.50
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,650	118.97	315,270.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	464	460.77	213,797.28
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,620	70.55	184,841.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,768	87.06	589,222.08
ALLSTATE CORP	11,649	133.47	1,554,792.03
AON PLC	2,916	236.31	689,079.96
BROWN & BROWN INC	2,000	52.95	105,900.00
CHUBB LTD	2,386	162.73	388,273.78
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,701	188.22	320,162.22
MARSH & MCLENNAN COS	10,205	142.60	1,455,233.00
PROGRESSIVE CORP	8,805	99.63	877,242.15
TRAVELERS COS INC/THE	827	153.33	126,803.91
WR BERKLEY CORP	1,598	75.62	120,840.76
ACCENTURE PLC-CL A	5,337	312.62	1,668,452.94
ADOBE INC	4,322	604.50	2,612,649.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	9,206	117.90	1,085,387.40
AUTOMATIC DATA PROCESS	5,943	203.72	1,210,707.96
BLACK KNIGHT INC	8,898	80.94	720,204.12
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,589	168.70	1,111,564.30
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,725	123.80	584,955.00
CITRIX SYSTEMS INC	8,159	116.17	947,831.03
CLOUDFLARE INC - CLASS A	1,280	108.97	139,481.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,754	69.14	466,971.56
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	2,614	144.42	377,513.88
FISERV INC	6,350	108.94	691,769.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,379	141.52	336,676.08
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,848	167.38	811,458.24
MASTERCARD INC-CLASS A	231	372.94	86,149.14
MICROSOFT CORP	490	277.94	136,190.60
NORTONLIFELOCK INC	8,957	27.66	247,750.62
ORACLE CORP	17,540	87.76	1,539,310.40
PALO ALTO NETWORKS INC	1,073	390.24	418,727.52
PAYCHEX INC	17,755	111.90	1,986,784.50
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,690	478.84	1,288,079.60
VERISIGN INC	1,750	233.03	407,802.50
VISA INC-CLASS A SHARES	6,794	238.47	1,620,165.18
WESTERN UNION CO	27,332	23.31	637,108.92
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	1,290	385.08	496,753.20
AMPHENOL CORPORATION	1,596	70.31	112,214.76
CISCO SYSTEMS	13,538	53.74	727,532.12
F5 NETWORKS INC	617	190.86	117,760.62

	JUNIPER NETWORKS INC	6,218	27.62	171,741.16
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	10,778	155.81	1,679,320.18
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,394	224.52	1,660,100.88
	AT&T INC	31,998	28.45	910,343.10
	T-MOBILE US INC	12,188	146.01	1,779,569.88
	VERIZON COMMUNICATIONS	40,088	56.07	2,247,734.16
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	4,014	56.76	227,834.64
	AMEREN CORPORATION	7,558	81.92	619,151.36
	AMERICAN ELECTRIC POWER	7,272	85.39	620,956.08
	CMS ENERGY CORP	6,204	60.31	374,163.24
	CONSOLIDATED EDISON INC	21,946	73.30	1,608,641.80
	DOMINION ENERGY INC	9,672	75.55	730,719.60
	DUKE ENERGY CORP	12,878	100.66	1,296,299.48
	EVERGY INC	2,502	61.79	154,598.58
	EVERSOURCE ENERGY	1,386	82.63	114,525.18
	NEXTERA ENERGY INC	31,903	74.99	2,392,405.97
	SOUTHERN CO	23,326	61.47	1,433,849.22
	WEC ENERGY GROUP INC	17,295	91.84	1,588,372.80
	XCEL ENERGY INC	26,106	67.67	1,766,593.02
	TEXAS INSTRUMENTS	4,279	190.27	814,165.33
	アメリカドル 小計	1,072,231		116,082,187.98 (12,788,774,649)
カナダドル	AGNICO EAGLE MINES	16,087	76.52	1,230,977.24
	BARRICK GOLD CORP	53,934	26.32	1,419,542.88
	FRANCO-NEVADA CORP	12,613	183.35	2,312,593.55
	KINROSS GOLD CORP	83,918	7.86	659,595.48
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	29,761	55.32	1,646,378.52
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,000	39.50	118,500.00
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,163	548.49	637,893.87
	INTACT FINANCIAL CORP	5,828	172.03	1,002,590.84
	CGI INC - CL A	6,425	114.49	735,598.25
	OPEN TEXT CORP	1,869	64.15	119,896.35
	BCE INC	4,909	61.99	304,308.91
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,399	66.69	1,026,959.31
	TELUS CORP	26,080	27.96	729,196.80
	カナダドル 小計	260,986		11,944,032.00 (1,056,330,190)
ユーロ	VOPAK	2,500	38.13	95,325.00
	KONE OYJ-B	13,276	69.76	926,133.76
	HERMES INTERNATIONAL	598	1,235.50	738,829.00
	HELLOFRESH SE	5,611	82.34	462,009.74
	COLRUYT SA	3,610	46.90	169,309.00

	KESKO OYJ-B SHS	4,000	32.17	128,680.00
	KONINKLIJKE AHOLD NV	20,483	25.34	519,039.22
	KERRY GROUP PLC-A	3,827	120.50	461,153.50
	BEIERSDORF AG	3,471	102.15	354,562.65
	DIASORIN SPA	1,679	160.65	269,731.35
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,949	53.22	316,605.78
	EUROFINS SCIENTIFIC	8,629	101.58	876,533.82
	MERCK KGAA	2,232	169.50	378,324.00
	QIAGEN N.V.	7,020	42.70	299,754.00
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	450	434.30	195,435.00
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,301	95.38	219,469.38
	SOFINA	280	367.60	102,928.00
	ADYEN NV	245	2,118.50	519,032.50
	SAP SE	3,287	124.72	409,954.64
	DEUTSCHE TELEKOM	124,210	18.00	2,235,780.00
	ELISA A	9,430	51.52	485,833.60
	ILIAD SA	450	120.55	54,247.50
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	10,200	9.70	98,960.40
	KPN (KON.)	164,829	2.68	442,401.03
	ORANGE	120,840	9.48	1,146,167.40
	PROXIMUS	10,217	16.54	169,040.26
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62,971	2.43	153,019.53
	ユーロ 小計	592,595		12,228,260.06 (1,599,700,981)
イギリスポンド	ANTOFAGASTA PLC	3,500	14.42	50,487.50
	OCADO GROUP PLC	3,020	19.09	57,651.80
	ASTRAZENECA	3,156	86.48	272,930.88
	ADMIRAL GROUP PLC	12,787	31.21	399,082.27
	イギリスポンド 小計	22,463		780,152.45 (119,449,141)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	466	937.00	436,642.00
	GIVAUDAN-REG	240	4,333.00	1,039,920.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,010	272.00	274,720.00
	SGS SA	240	2,896.00	695,040.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,571	314.60	1,123,436.60
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	108	2,208.00	238,464.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	99,200.00	297,600.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	40	9,525.00	381,000.00
	NESTLE SA - REGISTERED	20,346	115.20	2,343,859.20
	NOVARTIS	21,715	84.94	1,844,472.10
	ROCHE HOLDING GENUSS	7,118	353.10	2,513,365.80
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,080	81.00	87,480.00

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	473	365.10	172,692.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,022	94.60	96,681.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	11,480	114.95	1,319,626.00	
	SWISSCOM	1,716	535.80	919,432.80	
	スイスフラン 小計	70,628		13,784,432.00	(1,661,161,900)
スウェーデンクローナ	EPIROC AB-A	12,894	203.80	2,627,797.20	
	EMBRACER GROUP AB	15,408	222.90	3,434,443.20	
	ICA GRUPPEN AB	2,380	401.20	954,856.00	
	EQT AB	3,540	342.30	1,211,742.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,139	330.60	2,360,153.40	
	ERICSSON (LM) B	31,713	112.14	3,556,295.82	
	TELIA CO AB	72,110	38.41	2,770,105.65	
	スウェーデンクローナ 小計	145,184		16,915,393.27	(217,362,803)
ノルウェークローネ	TELENOR ASA	46,309	149.65	6,930,141.85	
	ノルウェークローネ 小計	46,309		6,930,141.85	(87,943,500)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	910	561.80	511,238.00	
	NOVOZYMES A/S	6,706	474.30	3,180,655.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	71	17,450.00	1,238,950.00	
	DSV PANALPINA A S	810	1,519.50	1,230,795.00	
	COLOPLAST-B	7,890	1,049.50	8,280,555.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	20,670	544.60	11,256,882.00	
	TRYG A/S	8,836	157.90	1,395,204.40	
	デンマーククローネ 小計	45,893		27,094,280.20	(476,588,388)
オーストラリアドル	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,780	33.60	227,808.00	
	WESFARMERS LTD	28,721	58.00	1,665,818.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	11,461	6.25	71,631.25	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	11,461	38.07	436,320.27	
	SONIC HEALTHCARE LTD	30,099	38.03	1,144,664.97	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	16,047	27.85	446,908.95	
	TELSTRA CORP	160,989	3.75	603,708.75	
	オーストラリアドル 小計	265,558		4,596,860.19	(378,643,373)
ニュージーランドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,900	30.00	237,000.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	62,201	4.89	304,162.89	
	ニュージーランドドル 小計	70,101		541,162.89	(41,664,130)
香港ドル	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	120,000	30.95	3,714,000.00	
	MTR CORP	103,000	44.20	4,552,600.00	



	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	72,200	17.10	1,234,620.00	
	BANK EAST ASIA	83,000	13.72	1,138,760.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	246,000	25.40	6,248,400.00	
	HANG SENG BANK	50,800	152.50	7,747,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	5,100	490.00	2,499,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	92,505	12.24	1,132,261.20	
	香港ドル 小計	772,605		28,266,641.20	(400,820,972)
シンガポールドル	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	27,100	3.94	106,774.00	
	SINGAPORE AIRLINES	41,500	5.02	208,330.00	
	OCBC BANK	20,200	11.91	240,582.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	53,600	11.16	598,176.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	532,300	2.26	1,202,998.00	
	シンガポールドル 小計	674,700		2,356,860.00	(192,154,795)
イスラエルシェケル	ICL LTD	46,962	21.85	1,026,119.70	
	NICE LTD	400	836.00	334,400.00	
	イスラエルシェケル 小計	47,362		1,360,519.70	(45,744,073)
	合 計	4,086,615		19,066,338,895	(19,066,338,895)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	179,500	1,409,075.00		
		HKT TRUST AND HKT LTD	253,000	2,661,560.00		
		香港ドル 小計	432,500	4,070,635.00	(57,721,604)	
	投資信託受益証券合計	432,500	57,721,604	(57,721,604)		
投資証券	アメリカドル	CROWN CASTLE INTL CORP	5,218	1,052,574.96		
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,603	1,143,573.57		
		PUBLIC STORAGE	6,028	1,878,807.04		
		アメリカドル 小計	17,849	4,074,955.57	(448,937,855)	
	香港ドル	LINK REIT	47,900	3,551,785.00		
		香港ドル 小計	47,900	3,551,785.00	(50,364,311)	
	投資証券合計	65,749	499,302,166	(499,302,166)		
				557,023,770		

合計	(557,023,770)
----	---------------

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 133銘柄	96.6%			65.2%
	投資証券 3銘柄			3.4%	2.3%
カナダドル	株式 13銘柄	100.0%			5.4%
ユーロ	株式 27銘柄	100.0%			8.2%
イギリスポンド	株式 4銘柄	100.0%			0.6%
スイスフラン	株式 16銘柄	100.0%			8.5%
スウェーデンクローナ	株式 7銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	100.0%			0.4%
デンマーククローネ	株式 7銘柄	100.0%			2.4%
オーストラリアドル	株式 7銘柄	100.0%			1.9%
ニュージーランドドル	株式 2銘柄	100.0%			0.2%
香港ドル	株式 8銘柄	78.8%			2.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		11.3%		0.3%
	投資証券 1銘柄			9.9%	0.3%
シンガポールドル	株式 5銘柄	100.0%			1.0%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%			0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	134,550,430
コール・ローン	3,592,971,376
国債証券	304,053,521,125
派生商品評価勘定	27,629,899
未収入金	30,699,204
未収利息	1,698,989,686
前払費用	58,151,440
差入委託証拠金	471,893,246
流動資産合計	310,068,406,406
資産合計	310,068,406,406
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,835,838
前受金	26,585,246
未払金	29,137,423
未払解約金	49,264,669
未払利息	5,482
流動負債合計	124,828,658
負債合計	124,828,658
純資産の部	
元本等	
元本	100,722,788,748
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	209,220,789,000
元本等合計	309,943,577,748
純資産合計	309,943,577,748
負債純資産合計	310,068,406,406

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

2021年 7月12日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,722,788,748口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0772円 (1万口当たり純資産額) (30,772円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 7月12日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	96,491,687,491円
期中追加設定元本額	17,610,847,912円
期中一部解約元本額	13,379,746,655円
期末元本額	100,722,788,748円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,423,389,430円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	610,286,906円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,066,930,698円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,388,253円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	7,332,425,280円
世界経済インデックスファンド	9,853,732,322円
D Cマイセレクション2 5	1,906,152,059円
D Cマイセレクション5 0	1,606,575,780円
D Cマイセレクション7 5	1,091,766,842円
D C外国債券インデックス・オープン	2,175,375,656円
D CマイセレクションS 2 5	891,567,483円
D CマイセレクションS 5 0	684,698,901円
D CマイセレクションS 7 5	363,886,754円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	38,615,318円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	85,329,117円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	42,644,496円
D C世界経済インデックスファンド	11,360,195,746円
外国債券インデックス・オープン（S M A専用）	674,428,066円

区分	2021年 7月12日現在
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	3,958,991円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,388,520円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,233,869円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	32,048,627円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	65,820,388円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	106,184,045円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	88,474,208円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	94,847,807円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,572,386,113円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	479,351,456円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,896,249,373円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	345,283,694円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	61,692,978円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	498,829,966円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	190,310,335円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	230,132,357円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	801,684,522円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	1,741,615,177円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	774,648,652円
外国債券ファンド・シリーズ1	628,379,698円
コア投資戦略ファンド(安定型)	911,972,296円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,419,366,371円
分散投資コア戦略ファンドA	1,164,439,715円
分散投資コア戦略ファンドS	2,447,192,293円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	475,380,191円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,712,455,883円
コア投資戦略ファンド(切替型)	950,325,514円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	229,042,787円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	101,090,206円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,250,887,185円
SMT インデックスバランス・オープン	194,848,396円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	20,880,259,904円
SMT 世界経済インデックス・オープン	183,472,103円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	202,716,747円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	325,343,765円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,460,450円
グローバル経済コア	766,071,712円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,281,967円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,241,837円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	271,449,363円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	30,730,194円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	4,671,165円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	3,599,664円

区分	2021年 7月12日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,892,494円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,784,854円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	510,300,812円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,569,126,292円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	337,289,328円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	340,159,039円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	191,339,468円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,993,642,041	
合計	2,993,642,041	

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,689,091,536	-	3,715,676,782	26,585,246
	合計	3,689,091,536	-	3,715,676,782	26,585,246

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2021年 7月12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		
	為替予約取引				



市場取引以外の取引	買建	3,589,875,952	-	3,571,084,767	18,791,185
	アメリカドル	1,642,705,873	-	1,635,966,585	6,739,288
	カナダドル	165,370,970	-	163,610,485	1,760,485
	ユーロ	1,519,819,558	-	1,509,696,266	10,123,292
	イギリスポンド	261,979,551	-	261,811,431	168,120
合計		3,589,875,952	-	3,571,084,767	18,791,185

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,953,906.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,687,369.91	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,993,945.30	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,490,771.47	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,038,590.62	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,975,000.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,237,050.79	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,398,000.00	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,970,546.94	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,162,291.04	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,964,453.10	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,006,562.48	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	985,859.38	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,848,046.90	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,372,265.62	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,534,750.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,874,375.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	7,003,281.25	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,940,312.48	

T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,168,613.30	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,696,562.48	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,958,984.39	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,941,406.24	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,376,914.12	
T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,813,099.25	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,206,180.48	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,868,911.71	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,410,312.50	
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,912,238.29	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,524,022.64	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,262,695.35	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,299,164.13	
T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,997,984.37	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,437,695.32	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,738,671.90	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,335,976.60	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	11,000,000.00	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,998,476.57	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,699,644.58	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,745,472.73	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	8,033,125.04	
T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,072,020.35	
T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	8,131,687.50	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,208,339.86	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	8,085,625.04	
T 1.25% 05/15/50	10,650,000.00	8,866,957.08	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,645,798.83	
T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,270,000.00	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,114,941.40	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,507,039.11	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,560,742.20	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,099,218.76	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,079,394.55	
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,870,625.00	
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,326,906.25	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,201,796.86	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,588,279.68	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,970,472.66	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,091,015.64	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,153,906.30	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,690,718.79	

T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,655,117.23
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,786,542.99
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,430,328.12
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,590,371.08
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,363,194.14
T 1.625% 05/15/31	9,470,000.00	9,701,571.14
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,026,738.28
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,541,845.70
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,957,246.12
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,086,425.80
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,578,027.35
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,599,128.88
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,243,178.10
T 1.625% 11/15/50	8,050,000.00	7,364,492.18
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,138,402.32
T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,676,500.00
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,737,275.40
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,795,438.87
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,113,339.87
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,496,281.25
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,459,587.46
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,252,899.42
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,121,406.25
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,856,179.72
T 1.875% 02/15/51	9,900,000.00	9,620,015.61
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,169,453.17
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,468,354.28
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,080,703.12
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,269,765.64
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,717,096.47
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,620,389.62
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,340,855.45
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,755,835.95
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,540,812.51
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,834,562.50
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,118,828.14
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,049,750.00
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,428,750.00
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,797,564.06
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,474,612.50
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,197,656.24
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,616,355.51
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	8,025,585.97

T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,368,593.75	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,196,593.75	
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,664,182.06	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,798,203.12	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,668,894.54	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,747,898.43	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,697,343.77	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,234,507.81	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,716,035.14	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,906,296.89	
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,172,363.30	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,069,150.02	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,798,453.13	
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,636,035.21	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,708,997.69	
T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	2,988,476.56	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,300,976.55	
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	8,124,609.37	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,663,154.28	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,350,000.00	
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,527,489.06	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,403,437.52	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,211,525.38	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,378,320.35	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,560,128.93	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,765,414.06	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,091,947.67	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,037,389.06	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,456,300.77	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,803,945.31	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,132,080.07	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,700,292.96	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,313,790.62	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,188,906.25	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,263,847.68	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,765,656.26	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,066,118.75	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,963,203.12	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,051,757.81	
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,486,062.50	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,721,890.62	
T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	7,901,367.22	

T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,495,125.00
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,474,290.65
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,223,612.50
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,528,707.04
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,348,125.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,119,289.09
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,842,531.25
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,630,040.62
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,157,532.83
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,952,253.12
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	9,989,006.25
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,048,804.70
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,025,537.09
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,649,511.72
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,267,638.27
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,210,156.25
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,146,093.75
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,902,167.22
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,000,000.00
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,515,217.18
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,463,992.58
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,760,390.62
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,060,351.57
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,271,910.56
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,244,726.60
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,834,796.87
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,051,875.00
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,270,910.16
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,242,109.37
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,349,493.75
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,043,037.50
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,569,437.50
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,115,449.22
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,807,885.17
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,875,507.83
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	975,674.22
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,145,500.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,611,562.50
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,633,906.26
T 3.75% 11/15/43	4,500,000.00	5,990,273.46
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,930,992.18
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,378,812.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,389,367.18

T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,517,031.25	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,924,003.12	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,191,250.00	
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,897,055.49	
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,615,363.30	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,610,156.25	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,494,726.55	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,346,656.26	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,247,062.50	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,283,574.23	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,392,812.50	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,688,054.69	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,774,332.04	
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,774,828.12	
T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,205,752.35	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	777,476.56	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,426,617.19	
T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,458,623.44	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,113,867.18	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,620,609.37	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,679,640.62	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,669,824.22	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,562,156.25	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,106,472.65	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,909,128.91	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,490,671.87	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,857,796.87	
アメリカドル 小計	1,200,330,000.00	1,254,878,264.13 (138,249,938,359)	
カナダドル			
CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,052,472.40	
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,208,864.00	
CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,373,600.00	
CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,589,106.00	
CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	909,572.30	
CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,767,327.30	
CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	3,930,668.70	
CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,244,477.40	
CAN 1.25% 03/01/25	2,400,000.00	2,440,080.00	
CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,608,029.40	
CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,090,511.90	
CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,396,162.40	
CAN 1.5% 06/01/31	1,400,000.00	1,416,380.00	

	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	614,790.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,697,974.80
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,725,761.50
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,519,600.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,398,049.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,900,908.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,361,455.20
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	315,750.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,268,069.60
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	707,358.40
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,386,438.50
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,443,954.80
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,911,964.80
	CAN 3.5% 12/01/45	1,480,000.00	1,985,938.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,458,450.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,571,017.50
	CAN 5.75% 06/01/33	1,410,000.00	2,063,450.40
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,212,394.60
	カナダドル 小計	64,090,000.00	67,570,576.90 (5,975,941,821)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,897,915.50
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	33,099,966.80
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,980,000.00	44,754,173.20
	MBONO 6.75% 03/09/23	29,950,000.00	30,454,058.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	40,626,320.10
	MBONO 7.75% 05/29/31	24,180,000.00	25,746,622.20
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	25,158,809.50
	MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,080,373.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	39,970,000.00	44,366,700.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	29,241,592.80
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	36,255,890.70
	MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	26,292,771.30
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	36,461,466.80
		メキシコペソ 小計	375,680,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,398,441.20
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	999,698.00
	BGB 0.4% 06/22/40	710,000.00	695,132.60
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,681,430.40
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	551,443.20
	BGB 0.8% 06/22/25	2,520,000.00	2,659,910.40
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,815,279.70
	BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,257,367.20

BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,573,627.20
BGB 0% 10/22/27	430,000.00	440,745.70
BGB 0% 10/22/31	630,000.00	629,029.80
BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,709,430.00
BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	843,091.20
BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,662,237.60
BGB 1.7% 06/22/50	1,140,000.00	1,405,677.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,308,625.50
BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,452,755.60
BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,189,246.40
BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,250,250.90
BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,956,689.50
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,097,781.30
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,347,751.20
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,027,124.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,405,084.80
BGB 4.25% 03/28/41	2,400,000.00	4,087,224.00
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,226,525.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,416,119.40
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,546,786.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,909,041.40
BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,454,155.80
BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,223,745.60
BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,998,955.50
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,044,595.70
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,668,424.80
BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,874,882.50
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	590,028.20
BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,790,544.10
BTPS 0.5% 07/15/28	620,000.00	623,844.00
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,131,123.30
BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,821,269.50
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,218,152.30
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,332,620.00
BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,865,512.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,225,187.80
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,044,180.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	980,750.40
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,638,127.40
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,290,299.20
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,477,818.00
BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,725,007.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,006,620.00



BTPS 0% 04/15/24	2,000,000.00	2,012,240.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,065,576.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,064,742.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,509,044.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,436,436.00	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,034,138.20	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,530,368.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,559,926.10	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,040,014.30	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,268,589.10	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,762,681.80	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,104,902.40	
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,386,496.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,915,740.20	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,118,420.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,905,254.00	
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,192,011.20	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,036,111.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,521,280.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	728,131.20	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,544,662.40	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,114,380.80	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,091,308.00	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,105,174.80	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,090,245.40	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,274,146.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,216,621.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,053,866.80	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,587,735.60	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,215,306.80	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,563,648.00	
BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	2,982,725.80	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,274,672.40	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,813,964.80	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,593,285.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,854,143.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,926,172.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,936,773.60	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,417,632.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,194,532.00	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,019,702.40	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,095,647.50	

BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,512,411.20
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,897,689.20
BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,472,175.50
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,737,295.20
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,937,736.50
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,936,594.50
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,237,397.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,929,994.80
BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,494,878.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,716,823.00
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,724,997.20
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,345,261.80
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,407,361.20
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,117,876.50
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,995,180.00
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,924,459.80
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,929,032.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	971,832.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,080,493.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,112,741.40
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,302,210.80
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,132,510.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,164,070.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,559,451.00
DBR 0.5% 08/15/27	5,690,000.00	6,071,628.30
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,701,625.90
DBR 0% 02/15/31	800,000.00	826,480.00
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,860,185.00
DBR 0% 05/15/36	1,670,000.00	1,679,552.40
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,492,767.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,629,185.00
DBR 0% 08/15/30	6,450,000.00	6,677,620.50
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	697,791.60
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,166,645.60
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,236,528.80
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,609,751.20
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,064,280.80
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,143,820.00
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,436,353.90
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,871,092.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,757,332.50
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,140,160.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,107,940.00

DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,911,297.60	
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,524,028.40	
DBR 2.5% 08/15/46	3,980,000.00	6,335,762.00	
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,024,621.60	
DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,339,714.80	
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,828,669.30	
DBR 4.25% 07/04/39	2,720,000.00	4,854,710.40	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,521,193.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,390,000.00	5,636,790.30	
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,430,430.40	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,478,282.40	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,338,102.00	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,794,959.30	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,984,062.50	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,407,436.80	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,855,032.00	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,819,972.60	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,336,610.50	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,645,320.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,140,239.00	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	792,089.10	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,230,000.00	1,197,528.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,369,105.50	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,711,422.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	6,200,000.00	6,661,342.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,071,607.00	
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,556,070.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,328,840.10	
FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	970,539.00	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,348,190.00	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,050,436.00	
FRTR 0% 03/25/25	6,690,000.00	6,829,687.20	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,322,857.00	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,065,307.60	
FRTR 0% 11/25/31	2,910,000.00	2,894,606.10	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,783,191.40	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,830,000.00	5,474,466.90	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,774,089.00	
FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	4,845,259.40	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,622,207.60	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,107,981.20	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,699,402.20	

FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,492,841.60
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,033,206.50
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,636,558.40
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,441,776.00
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	5,955,537.00
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,873,749.40
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,157,015.10
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,665,914.00
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,300,303.00
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,580,058.50
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,588,213.80
FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000.00	8,285,771.20
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	5,952,768.00
FRTR 4% 04/25/55	2,660,000.00	5,129,863.20
FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,399,915.80
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,410,737.20
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,504,720.30
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,137,650.80
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,439,961.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,164,530.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	960,327.30
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,049,734.80
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	769,386.00
IRISH 0.55% 04/22/41	490,000.00	488,588.80
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,155,268.30
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,123.40
IRISH 0% 10/18/31	730,000.00	723,276.70
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,317,972.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	759,150.20
IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	973,399.60
IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	924,183.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	984,770.80
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,520,649.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,476,526.70
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,497,656.50
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,074,081.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,087,285.20
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,841,656.40
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,393,714.40
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,792,011.60
NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,542,556.80
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,448,412.00
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,272,406.70

NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,756,663.20
NETHER 0% 01/15/24	2,060,000.00	2,097,244.80
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,893,507.20
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	687,526.00
NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	899,679.20
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,965,696.00
NETHER 0% 07/15/31	1,500,000.00	1,526,715.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,036,825.40
NETHER 2.25% 07/15/22	1,220,000.00	1,256,526.80
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,639,635.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,360,000.00	3,872,170.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,153,558.10
NETHER 3.75% 01/15/23	2,330,000.00	2,488,812.80
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,580,712.60
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,531,970.60
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,415,374.10
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	225,014.00
OBL 0% 04/05/24	4,250,000.00	4,333,002.50
OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,196,251.40
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,848,437.50
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,247,838.80
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,196,316.80
OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,466,641.20
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,535,005.60
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,571,247.20
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,873,987.50
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	940,427.40
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,742,326.20
RAGB 0.75% 03/20/51	790,000.00	832,596.80
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,219,214.40
RAGB 0.85% 06/30/20	400,000.00	386,060.00
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,472,533.00
RAGB 0% 02/20/31	740,000.00	746,275.20
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	950,934.30
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,520,580.00
RAGB 0% 07/15/24	1,350,000.00	1,376,203.50
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,662.40
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	390,196.80
RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,541,068.10
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,159,719.30
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	448,839.60
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,065,863.70

RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,404,333.70
RAGB 2.1% 09/20/17	780,000.00	1,345,507.80
RAGB 2.4% 05/23/34	1,260,000.00	1,633,905.00
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,336,017.80
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,491,876.80
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	998,721.80
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,936,060.40
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,646,735.50
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,663,115.60
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	535,345.20
RFGB 0.125% 04/15/52	490,000.00	441,793.80
RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	407,464.00
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	396,588.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	651,775.00
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	921,573.60
RFGB 0.5% 09/15/28	1,030,000.00	1,094,169.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	808,001.60
RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	673,747.80
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	732,918.00
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,132.40
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,925.00
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	639,147.60
RFGB 1.125% 04/15/34	710,000.00	805,750.60
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	611,157.40
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	675,194.00
RFGB 1.625% 09/15/22	930,000.00	955,128.60
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	872,090.80
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	514,365.60
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	784,954.40
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	985,268.10
SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,127,265.80
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,338,364.80
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,652,932.70
SPGB 0.45% 10/31/22	3,060,000.00	3,101,677.20
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,970,093.00
SPGB 0.5% 10/31/31	430,000.00	433,487.30
SPGB 0.6% 10/31/29	3,400,000.00	3,523,352.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,111,320.00
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	955,420.80
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,384,239.50
SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,428,428.70
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,933,589.80
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,402,372.00

SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,275,724.80	
SPGB 1.2% 10/31/40	1,910,000.00	1,962,372.20	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,320,718.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,734,038.50	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,730,459.30	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,625,446.00	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,973,257.00	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,337,160.00	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	596,732.40	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,909,223.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,285,033.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,168,852.50	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,113,985.80	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,390,466.80	
SPGB 1% 10/31/50	2,430,000.00	2,242,015.20	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,115,924.70	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,953,400.40	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,468,547.50	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	3,983,724.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,250,000.00	3,085,785.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	3,047,759.40	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,823,458.40	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,807,346.40	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,996,337.20	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,425,380.80	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,407,981.60	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,726,184.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,550,000.00	4,314,268.50	
SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,896,090.20	
SPGB 5.15% 10/31/44	2,100,000.00	3,838,128.00	
SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,294,880.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,072,433.80	
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,572,024.00	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,522,783.50	
ユーロ 小計	799,230,000.00	936,692,830.50 (122,538,156,086)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	2,820,000.00	2,798,680.80
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,512,886.40
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,966,762.70
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,208,359.00
	UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	2,006,441.20
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,352,409.40

UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,164,175.00
UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,082,639.60
UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,727,506.00
UKT 0.625% 07/31/35	2,950,000.00	2,805,922.00
UKT 0.625% 10/22/50	2,360,000.00	2,040,786.40
UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,950,274.40
UKT 0.875% 01/31/46	1,260,000.00	1,176,008.40
UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,738,573.00
UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,141,772.40
UKT 1.25% 07/31/51	180,000.00	183,061.80
UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,854,096.00
UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,118,980.00
UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,736,201.00
UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,378,706.00
UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,098,191.60
UKT 1.625% 10/22/71	1,040,000.00	1,290,525.60
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,477,671.00
UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,992,534.60
UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,180,559.20
UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,234,134.00
UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,638,496.00
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,616,975.00
UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,872,185.60
UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,751,738.40
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,910,580.80
UKT 3.25% 01/22/44	2,810,000.00	3,976,150.00
UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,778,717.50
UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,664,915.60
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,679,072.00
UKT 4.25% 03/07/36	2,390,000.00	3,461,915.00
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,862,258.00
UKT 4.25% 09/07/39	1,820,000.00	2,776,009.60
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,701,498.90
UKT 4.25% 12/07/40	1,900,000.00	2,947,926.00
UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,654,944.40
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,640,476.60
UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,163,816.80
UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,561,172.30
UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,839,776.20
UKT 4.75% 12/07/30	1,780,000.00	2,443,904.40
UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,626,602.00
UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,937,550.00
UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,114,712.00



	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,747,187.50	
イギリスポンド 小計		105,880,000.00	128,586,438.10	(19,687,869,537)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,970,000.00	5,930,956.20	
	SGB 0.75% 05/12/28	9,380,000.00	9,858,849.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,817,251.60	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,028,375.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,553,032.70	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,546,837.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	10,050,000.00	11,113,591.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	8,764,333.20	
スウェーデンクローナ 小計		63,950,000.00	70,613,226.70	(907,379,963)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,999,130.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,040,000.00	5,108,392.80	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,867,255.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,286,280.40	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,908,425.40	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,978,375.60	
	NGB 2% 04/26/28	6,100,000.00	6,444,284.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,542,288.20	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,780,403.20	
ノルウェークローネ 小計		56,970,000.00	58,914,835.40	(747,629,261)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	8,020,000.00	8,109,342.80	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,870,000.00	3,688,845.30	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,967,779.40	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,083,515.00	
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,115,660.20	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,782,986.40	
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,994,896.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	15,750,000.00	28,050,907.50	
デンマーククローネ 小計		70,130,000.00	84,793,932.60	(1,491,525,274)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,900,000.00	1,793,353.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,542,912.00	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,221,943.50	
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,600,000.00	2,505,672.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,116,792.90	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,060,998.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,050,000.00	6,363,934.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,421,176.00	

	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,016,968.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,537,123.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,107,452.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,260,000.00	6,807,311.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	4,066,214.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	783,318.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,642,152.80	
	ポーランドズロチ 小計	61,550,000.00	64,987,322.10 (1,869,451,302)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,919,598.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,307,544.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,040,000.00	3,001,027.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,697,310.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,238,838.90	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	1,894,585.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,661,053.10	
	ACGB 1% 11/21/31	3,750,000.00	3,614,812.50	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,203,489.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,771,660.80	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,255,716.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,193,521.30	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,481,609.40	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,828,061.30	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,402,778.10	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,148,823.40	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,858,370.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,150,000.00	3,542,710.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,844,182.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	3,200,000.00	3,709,248.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,180,733.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,064,349.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,964,457.60	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,297,736.20	
ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,543,508.80		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,835,388.00		
ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,741,475.00		
ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,543,630.00		
	オーストラリアドル 小計	70,360,000.00	75,746,219.80 (6,239,216,124)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	385,741.20	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	816,912.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	428,437.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	784,096.60	

	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	948,695.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	521,732.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	468,983.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,150,747.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,460,930.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,043,631.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,118,834.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	661,702.70	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	856,383.20	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	425,612.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,392,727.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	990,322.80	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,000,172.80	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,708,900.20	
	シンガポールドル 小計	14,830,000.00	16,164,565.40 (1,317,897,017)	
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,527,000.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	724,843.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,413,996.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,561,732.60	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,430,000.00	3,596,835.20	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,125,250.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	531,344.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,536,630.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	965,665.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,375,826.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,082,437.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,586,505.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,194,692.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,085,481.40	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,540,296.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	636,384.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,517,564.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,003,664.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	749,329.60	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,349,414.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,158,080.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,146,501.70	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,141,490.50	
MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,143,883.60		
MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,075,361.00		
MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,571,449.20		
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,487,890.40		

	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,524,321.80	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,826,596.80	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,706,998.80	
	マレーシアリングット 小計	51,820,000.00	54,887,465.90 (1,445,016,826)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	700,964.66	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,440,570.00	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,490,000.00	6,541,208.69	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,113,512.06	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,808,265.37	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,147,173.07	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,920,000.00	2,917,308.04	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,880,000.00	3,178,746.71	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,477,464.62	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,094,095.71	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,157,899.62	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,331,209.07	
	イスラエルシェケル 小計	35,840,000.00	40,908,417.62 (1,375,443,271)	
	合計		304,053,521,125 (304,053,521,125)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 216銘柄	100.0%	45.5%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 340銘柄	100.0%	40.3%
イギリスポンド	国債証券 50銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 30銘柄	100.0%	0.5%

イスラエルシェケル	国債証券 12銘柄	100.0%	0.5%
-----------	-----------	--------	------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	6,125,303,672
コール・ローン	56,090,382
株式	91,085,044,206
投資信託受益証券	238,977,978
投資証券	72,756,950
派生商品評価勘定	1,447,501
未収入金	10,092,157
未収配当金	326,517,041
前払金	204,115,265
差入委託証拠金	689,042,693
流動資産合計	98,809,387,845
<b>資産合計</b>	
98,809,387,845	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	205,514,424
未払解約金	28,321,504
未払利息	85
流動負債合計	233,836,013
<b>負債合計</b>	
233,836,013	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	26,523,301,434
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	72,052,250,398
元本等合計	98,575,551,832
<b>純資産合計</b>	
98,575,551,832	
<b>負債純資産合計</b>	
98,809,387,845	

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2021年 7月12日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,523,301,434口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.7166円 (1万口当たり純資産額) (37,166円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	



区分	2021年 7月12日現在
期首	2020年 7月11日
期首元本額	25,615,749,238円
期中追加設定元本額	4,030,434,492円
期中一部解約元本額	3,122,882,296円
期末元本額	26,523,301,434円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,515,621,245円
世界経済インデックスファンド	4,151,909,621円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,027,256,204円
D C 世界経済インデックスファンド	4,779,485,444円
新興国株式インデックス・オープン ( S M A 専用 )	195,634,370円
分散投資コア戦略ファンド A	266,983,353円
分散投資コア戦略ファンド S	1,326,986,681円
D C 世界経済インデックスファンド ( 株式シフト型 )	639,597,791円
D C 世界経済インデックスファンド ( 債券シフト型 )	557,954,118円
世界経済インデックスファンド ( 株式シフト型 )	313,571,249円
世界経済インデックスファンド ( 債券シフト型 )	15,502,152円
S M T インデックスバランス・オープン	83,354,886円
S M T 世界経済インデックス・オープン	116,907,190円
S M T 世界経済インデックス・オープン ( 株式シフト型 )	400,663,738円
S M T 世界経済インデックス・オープン ( 債券シフト型 )	70,910,598円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	3,053,970円
グローバル経済コア	348,741,999円
i - S M T 新興国株式インデックス ( ノーロード )	30,112,121円
D C ターゲット・イヤーファンド ( 6 資産・運用継続型 ) 2 0 3 0	6,451,370円
D C ターゲット・イヤーファンド ( 6 資産・運用継続型 ) 2 0 4 0	4,341,769円
D C ターゲット・イヤーファンド ( 6 資産・運用継続型 ) 2 0 5 0	2,052,572円
D C ターゲット・イヤーファンド ( 6 資産・運用継続型 ) 2 0 6 0	1,789,913円
世界株式ファンド ( 適格機関投資家専用 )	572,521,945円
F O F s 用世界成長戦略ファンド ( 適格機関投資家専用 )	91,897,135円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,248,171,298
投資信託受益証券	53,977,438
投資証券	14,760,841
合計	8,316,909,577

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,378,798,802	-	7,174,683,537	204,115,265
合計		7,378,798,802	-	7,174,683,537	204,115,265

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年 7月12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	46,222,200	-	46,270,542	48,342
	アメリカドル	46,222,200	-	46,270,542	48,342
合計		46,222,200	-	46,270,542	48,342

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

			評価額	
--	--	--	-----	--

通貨	銘柄	株式数 (株)	単価	金額	備考
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	575,861	7.90	4,549,301.90	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	39,446	89.52	3,531,205.92	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,717	216.10	2,099,843.70	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	7.69	1,031,825.80	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.71	580,793.08	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	25,084	41.84	1,049,514.56	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	4.32	67,007.52	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.59	145,428.70	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,882	33.39	2,233,189.98	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	31.42	615,769.16	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	19.67	527,510.06	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	95.15	755,300.70	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	21.76	843,700.48	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,585	65.18	624,750.30	
	51JOB INC-ADR	2,701	77.55	209,462.55	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,721	29.08	1,300,486.68	
	LI AUTO INC - ADR	46,720	31.82	1,486,630.40	
	NIO INC - ADR	132,230	45.53	6,020,431.90	
	XPENG INC - ADR	32,153	39.92	1,283,547.76	
	GAOTU TECHEDU INC	16,359	13.21	216,102.39	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	49.49	948,376.87	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	156,180	6.60	1,030,788.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	21.22	871,250.76	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	42,341	65.36	2,767,407.76	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	61.83	406,284.93	
	BAIDU INC - SPON ADR	26,907	181.36	4,879,853.52	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	16,053	106.74	1,713,497.22	
	DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	5,000	5.45	27,250.00	
	HUYA INC-ADR	8,211	15.13	124,232.43	
	IQIYI INC-ADR	28,984	13.19	382,298.96	
	JOYY INC	6,185	59.94	370,728.90	
	MAIL.RU GROUP-GDR REGS	19,368	21.68	419,898.24	
	MOMO INC-SPON ADR	15,529	13.66	212,126.14	
	NETEASE INC-ADR	40,751	108.33	4,414,555.83	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	64,895	12.88	835,847.60	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	60.03	315,097.47	
YANDEX NV-A	30,372	70.44	2,139,403.68		
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	32.99	115,728.92		
DADA NEXUS LTD-ADR	7,696	26.21	201,712.16		
JD.COM INC-ADR	85,581	73.56	6,295,338.36		
OZON HOLDINGS PLC - ADR	3,921	55.59	217,987.99		

	PINDUODUO INC-ADR	44,003	111.07	4,887,413.21
	TRIP.COM GROUP LTD	48,611	32.18	1,564,301.98
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	41,109	18.78	772,027.02
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	14.27	569,943.65
	ADECOAGRO SA	17,629	9.54	168,180.66
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,157	7.96	64,929.72
	BEIGENE LTD-ADR	4,248	329.25	1,398,654.00
	BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	5,009	27.41	137,296.69
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	37.52	271,757.36
	I-MAB-SPONSORED ADR	2,944	80.70	237,580.80
	ZAI LAB LTD-ADR	7,677	169.00	1,297,413.00
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	141,961	3.51	498,283.11
	CREDICORP LTD	6,128	119.40	731,683.20
	SBERBANK-SPONSORED ADR	268,967	16.39	4,409,713.96
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	11,906	89.10	1,060,824.60
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.29	489,935.95
	360 DIGITECH INC	8,061	26.31	212,084.91
	LUFAX HOLDING LTD	12,385	9.55	118,276.75
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	44.19	89,307.99
	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	10,604	20.51	217,488.04
	KE HOLDINGS INC	35,590	40.75	1,450,292.50
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.94	51,438.24
	21VIANET GROUP INC-ADR	7,475	19.74	147,556.50
	AGORA INC-ADR	4,630	37.90	175,477.00
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	12,493	13.95	174,277.35
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	9,050	70.45	637,572.50
	GLOBANT SA	3,899	220.01	857,818.99
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	29.69	165,017.02
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	10,976	10.59	116,235.84
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.54	340,353.16
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,948	67.80	335,474.40
	アメリカドル 小計	3,273,360		81,510,079.38 (8,979,965,445)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	16.71	25,819,640.31
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	323,292	91.73	29,655,575.16
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	276.96	4,015,920.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	53.33	5,165,117.16
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	62.86	2,357,250.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	372.92	8,690,900.60
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	219.76	9,599,116.80
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	156.67	2,660,256.60
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	223,390	53.91	12,042,954.90

	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	71.85	2,256,090.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	511,980	63.19	32,352,016.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	117.80	5,945,955.00	
	BECLE SAB DE CV	48,100	52.11	2,506,491.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	185,340	165.87	30,742,345.80	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	220.29	5,718,728.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	45.13	8,204,634.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	34.30	6,235,740.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	254,500	127.52	32,453,840.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	19.99	5,047,475.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,435,740	14.78	50,780,237.20	
	TELESITES SAB DE CV	74,800	18.11	1,354,628.00	
	メキシコペソ 小計	7,559,055		283,604,912.13 (1,571,681,702)	
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	24.65	2,916,095.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	375,100	28.16	10,562,816.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	484,940	27.49	13,331,000.60	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES - RTS	93,254	0.01	932.54	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	19.06	1,440,936.00	
	BRADESPAR SA -PREF	24,000	75.95	1,822,800.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	58.39	1,126,927.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	44.09	2,777,670.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	29.10	3,055,500.00	
	SUZANO SA	74,079	60.98	4,517,337.42	
	VALE SA	393,678	113.66	44,745,441.48	
	WEG SA	171,144	34.73	5,943,831.12	
	CCR SA	125,600	13.27	1,666,712.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	65.51	4,058,475.52	
	RUMO SA	114,200	20.00	2,284,000.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	10,300	53.04	546,312.00	
	B2W CIA DIGITAL	22,349	65.92	1,473,246.08	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	96,618	20.57	1,987,432.26	
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	44.57	3,695,164.99	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	21.92	6,696,560.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	28.73	2,183,480.00	
	VIA VAREJO SA	135,900	14.85	2,018,115.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	20.77	861,955.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	25.63	3,139,675.00	
	AMBEV SA	476,800	17.36	8,277,248.00	
	BRF SA	52,500	26.30	1,380,750.00	
	JBS SA	110,000	29.01	3,191,100.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	60.10	6,028,510.80	

	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	100,500	15.00	1,507,500.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	83.78	4,557,632.00	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	22,600	70.60	1,595,560.00	
	HYPERA SA	35,300	33.95	1,198,435.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	161,367	20.76	3,349,978.92	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	475,802	24.59	11,699,971.18	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	31.79	2,807,057.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	486,581	29.29	14,251,957.49	
	ITAUSA SA	503,167	11.17	5,620,375.39	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	637,309	16.15	10,292,540.35	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	22.60	1,559,400.00	
	TOTVS SA	57,900	37.37	2,163,723.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	41.65	2,178,295.00	
	TIM SA	96,100	11.24	1,080,164.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	14,500	42.29	613,205.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	42.70	1,434,720.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	113,867	11.73	1,335,659.91	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	79,000	5.95	470,050.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	35.45	1,230,115.00	
	CPFL ENERGIA SA	43,700	26.50	1,158,050.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	39.18	1,146,015.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	80,900	24.30	1,965,870.00	
	ブラジルリアル 小計	7,202,472		214,946,298.05 (4,501,878,255)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,700.00	299,691,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,646.70	223,893,565.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	12,523	35,950.00	450,201,850.00	
	FALABELLA SA	70,837	3,150.00	223,136,550.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,386.80	191,361,758.40	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	7,854.10	58,002,528.50	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	70.00	340,384,800.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	30,850.00	168,317,600.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	35.33	221,866,075.93	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,210.00	50,336,000.00	
	COLBUN SA	1,215,680	102.10	124,120,928.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	107.90	376,712,888.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	39.55	101,298,544.90	
	チリペソ 小計	18,867,218		2,829,324,089.73 (416,405,772)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,761.00	1,350,071,019.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	28,100.00	825,465,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	28,810.00	1,102,789,180.00	

	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	19,510.00	406,198,200.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	23,350.00	1,179,431,850.00
	コロンビアペソ 小計	627,964		4,863,955,849.00 (139,785,227)
ユーロ	OPAP SA	17,668	12.46	220,143.28
	JUMBO SA	7,201	14.20	102,254.20
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.82	233,232.82
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.63	383,539.44
	ユーロ 小計	333,851		939,169.74 (122,862,185)
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	35,948	15.85	569,955.54
	イギリスポンド 小計	35,948		569,955.54 (87,265,892)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	96.60	1,120,849.80
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	18.05	2,107,427.75
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	14.80	1,473,576.80
	KOC HOLDING AS	89,884	19.90	1,788,691.60
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	89,157	7.72	688,292.04
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	174.40	1,133,774.40
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	63.25	2,708,618.00
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.32	1,470,027.72
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.53	2,047,131.76
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.27	911,773.24
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	16.02	2,292,317.82
	トルコリラ 小計	1,288,706		17,742,480.93 (225,904,364)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	772.00	5,761,436.00
	MONETA MONEY BANK AS	14,764	85.00	1,254,940.00
	CEZ AS	18,145	600.00	10,887,000.00
	チェココルナ 小計	40,372		17,903,376.00 (90,949,150)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,378.00	100,720,190.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,270.00	125,522,060.00
	OTP BANK NYRT	22,061	16,185.00	357,057,285.00
	ハンガリーフォリント 小計	79,594		583,299,535.00 (214,539,902)
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	74.54	2,289,347.02
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	6.54	1,308,333.54
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	187.80	2,466,189.60
	LPP SA	124	13,630.00	1,690,120.00
	CD PROJEKT SA	6,704	188.00	1,260,352.00
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	31.54	1,138,530.92

	ALLEGRO.EU SA	39,203	71.55	2,804,974.65
	DINO POLSKA SA	5,945	292.00	1,735,940.00
	BANK PEKAO SA	15,847	92.26	1,462,044.22
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	37.46	3,495,467.52
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	253.20	915,318.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	37.07	2,299,971.08
	ORANGE POLSKA SA	55,658	7.20	400,737.60
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	9.04	574,003.84
	ポーランドズロチ 小計	625,942		23,841,329.99 (685,829,235)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.30	1,209,600.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,495,400	3.71	9,257,934.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	331,000	14.92	4,938,520.00
	PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LT	90,000	1.75	157,500.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,148,000	3.49	7,496,520.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	10.40	1,476,800.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.67	1,587,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	105,500	38.35	4,045,925.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	10.62	2,325,780.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	5.77	2,700,360.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	8.84	3,642,080.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	7.04	2,027,520.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	14,800	132.50	1,961,000.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	16.18	1,342,940.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.50	1,079,000.00
	MMG LIMITED	304,000	3.59	1,091,360.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	10.88	1,403,520.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	13.72	696,290.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	7.37	666,985.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	10.62	7,741,980.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.97	1,366,750.00
	BOC AVIATION LTD	23,800	62.90	1,497,020.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.50	686,000.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	31.15	4,968,425.00
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	17.50	2,240,000.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	3.92	1,858,080.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	4.99	848,300.00
	CITIC LTD	443,000	8.23	3,645,890.00
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	10.98	3,162,240.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	25.35	1,977,300.00
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	7.83	1,252,800.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	13.96	760,820.00



WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	16.44	3,481,992.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	12.10	380,133.60
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	47.90	2,984,170.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	7.73	898,226.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	33.10	1,373,650.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.15	1,598,057.10
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	76.00	10,336,000.00
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	64,000	17.64	1,128,960.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	9.26	1,666,800.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.47	1,170,580.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.95	1,227,600.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	11.48	1,900,479.56
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.67	821,920.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	14.50	7,511,725.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	6.19	1,552,291.06
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.55	1,333,800.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	10.54	1,348,297.88
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.89	606,320.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.30	2,686,400.00
BYD CO LTD-H	83,000	216.20	17,944,600.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	6.97	1,854,020.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	51.10	2,984,240.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	567,000	23.65	13,409,550.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	27.50	9,700,625.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	7.69	2,755,665.36
MINTH GROUP LTD	64,000	33.85	2,166,400.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	17.12	1,848,960.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	185.40	20,579,400.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	5.32	1,032,080.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	188,400	27.05	5,096,220.00
LI NING CO LTD	217,000	91.70	19,898,900.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	181.60	15,399,680.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	10.66	479,700.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	16.80	1,176,000.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	6.51	624,960.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	44.15	5,121,400.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	31.15	1,775,550.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.00	1,450,000.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	80.65	2,596,930.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	26,500	152.80	4,049,200.00
TENCENT HOLDINGS LTD	578,800	538.50	311,683,800.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,523,688	195.50	297,881,004.00

CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	42.15	2,276,100.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	0.95	1,146,610.10
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	268,000	5.49	1,471,320.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	26,150	98.45	2,574,467.50
MEITUAN-CLASS B	364,500	279.20	101,768,400.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	18.52	1,266,768.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	11.40	1,299,600.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	75.45	5,130,600.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	5.43	1,406,370.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	107.82	1,638,864.00
CHINA FEIHE LTD	346,000	15.60	5,397,600.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	281,000	44.55	12,518,550.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	148,000	63.15	9,346,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.62	1,136,520.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	22,800	39.05	890,340.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	115,000	41.50	4,772,500.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	15.40	3,511,200.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	73.85	3,397,100.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.38	670,400.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.39	3,018,400.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	51.75	2,484,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	52,500	52.05	2,732,625.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	22.70	567,500.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	15.16	6,397,520.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	16.58	2,055,920.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	63.90	4,217,400.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	83.85	4,502,745.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	16.80	4,099,200.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.52	1,992,768.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	21.85	2,735,620.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	20,500	61.10	1,252,550.00
3SBIO INC	119,000	8.27	984,130.00
AKESO INC	25,000	57.00	1,425,000.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	327.20	3,272,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	18.34	1,834,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	10.16	9,714,585.60
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	4.52	711,900.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	4.92	816,720.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	34.75	2,849,500.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	156.30	797,130.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	31.05	3,788,100.00

INNOVENT BIOLOGICS INC	114,500	82.30	9,423,350.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	12,800	181.60	2,324,480.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	54.75	3,996,750.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	6.95	7,735,350.00
SSY GROUP LTD	114,000	7.13	812,820.00
WUXI APPTec CO LTD-H	32,088	170.80	5,480,630.40
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	334,500	134.40	44,956,800.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	2.65	7,486,250.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,279,200	2.74	22,685,008.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.62	5,074,954.50
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	2.82	1,033,530.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.63	3,452,856.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,450,620	5.55	52,450,941.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.83	1,061,250.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	392,423	61.55	24,153,635.65
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.71	2,502,024.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.01	454,510.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,924,515	4.50	26,660,317.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.08	5,379,720.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.46	1,214,720.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	8.86	1,187,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.22	2,038,260.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.02	945,540.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	20.05	2,646,600.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	17.46	4,338,810.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	8.07	1,936,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	9.80	868,280.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.70	2,393,240.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	10.72	1,453,632.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	805,000	13.92	11,205,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	23.05	6,836,630.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	11.94	2,197,246.56
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	23.45	2,260,580.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.54	2,385,060.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	6.94	4,783,658.72
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	629,500	71.25	44,851,875.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	41.35	1,889,695.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	9.59	1,361,780.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	6.28	791,280.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	9.47	1,761,420.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.48	1,433,440.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	331,540	17.72	5,874,888.80

CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	7.75	620,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	317,111	30.80	9,767,018.80
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	32,000	46.60	1,491,200.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	24.35	4,344,040.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	5.75	1,587,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	800,964	8.21	6,575,914.44
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	11.44	829,400.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	8.39	1,134,328.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	60,000	34.60	2,076,000.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.59	404,040.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	10.20	1,555,500.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	10.04	1,506,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	40.95	8,067,150.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	48.40	387,200.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	178,000	6.65	1,183,700.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	7.11	1,450,440.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.31	776,160.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	17.92	2,374,400.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	25.20	1,890,000.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	24.15	6,061,650.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	64,000	26.70	1,708,800.00
WHARF HOLDINGS	100,000	29.20	2,920,000.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	7.99	923,644.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	4.33	567,230.00
CHINA YOUZAN LTD	1,456,000	1.34	1,951,040.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	24.90	6,025,800.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	41.60	3,827,200.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	32,000	37.30	1,193,600.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	15.00	1,185,000.00
WEIMOB INC	149,000	14.76	2,199,240.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	53.20	3,803,800.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	45.35	2,743,675.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	39.95	2,676,650.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	16.18	1,116,420.00
LENOVO GROUP LTD	732,000	8.93	6,536,760.00
SUNNY OPTICAL TECH	70,500	230.20	16,229,100.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	26.70	37,534,860.00
ZTE CORP-H	82,908	21.90	1,815,685.20
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.06	4,839,960.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	25.45	1,514,275.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.95	1,799,500.00
CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.70	1,344,700.00

	CHINA GAS HOLDINGS LTD	305,600	23.35	7,135,760.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	13.24	4,488,360.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.70	1,132,200.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	45.65	4,838,900.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	10.48	1,838,192.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	73,300	147.10	10,782,430.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	10.64	3,404,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	2.65	980,500.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	6.78	2,440,800.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	31.65	2,025,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	40.35	1,815,750.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	433,987	15.58	6,761,517.46	
	香港ドル 小計	90,155,226		1,630,462,491.79 (23,119,958,133)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.87	1,187,227.16	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	18.80	471,880.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.06	2,175,394.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	4.90	1,414,140.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.77	296,814.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.20	739,961.20	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.72	609,717.68	
	MISC BHD	125,040	6.78	847,771.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.24	296,800.00	
	GENTING BHD	188,500	4.83	910,455.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.80	1,035,160.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	26.10	151,380.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.72	1,005,664.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,146	19.82	696,593.72	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	133.60	961,920.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	18.34	1,347,623.20	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.58	696,384.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	3.84	948,656.64	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	7.11	1,289,043.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.61	1,286,373.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	128,200	3.09	396,138.00	
	SUPERMAX CORP BHD	161,715	3.29	532,042.35	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	3.82	1,928,718.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	30,500	2.88	87,840.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	635,119	4.49	2,851,684.31	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	18.66	1,143,708.72	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.82	296,400.06	

	MALAYAN BANKING BHD	411,105	8.13	3,342,283.65	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,481,600	4.06	6,015,296.00	
	RHB BANK BHD	206,419	5.25	1,083,699.75	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.78	1,078,392.42	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.24	1,321,608.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.42	1,184,118.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	5.98	421,900.96	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	15.60	1,177,800.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	225,575	9.69	2,185,821.75	
	マレーシアリングット 小計	8,280,059		43,416,410.57 (1,143,019,499)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	113.00	15,187,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	37.25	44,603,150.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	51.50	6,185,150.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	39.50	8,152,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	58.50	13,158,639.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	61.75	6,212,050.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	420.00	34,020,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	60.25	25,793,025.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.95	6,495,150.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.80	7,123,600.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.00	3,241,200.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	29.25	10,610,086.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	33.50	6,103,700.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	13.90	6,547,386.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	29.00	8,381,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	33.75	5,994,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	592,000	60.25	35,668,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	148.50	6,875,550.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	326,300	26.25	8,565,375.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	37.50	2,475,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	22.10	4,086,290.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	907,200	24.00	21,772,800.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	126.50	4,149,200.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	39.75	2,925,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	105.00	5,449,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	10.20	4,474,230.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	92.00	8,160,400.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	17.70	2,922,270.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	66.25	6,724,375.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	58.00	5,208,400.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	68.75	5,245,625.00	

	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	50.75	11,484,725.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.90	6,888,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	28,000	588.00	16,464,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	169.50	20,289,150.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	64.50	15,718,650.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.04	2,922,683.36	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	40.50	2,162,700.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	169.00	2,856,100.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	129,400	59.25	7,666,950.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	73.25	4,995,650.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	33.25	9,582,650.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	44.00	2,389,200.00	
	タイパーツ 小計	12,714,866		435,932,010.36 (1,469,090,874)	
フィリピン ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	41.50	9,874,510.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	784.00	22,171,520.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	587.50	4,029,075.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	60.40	18,332,185.20	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	1,000.00	22,805,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	160.00	15,377,600.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	203.00	12,385,030.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	144.00	13,760,640.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	102,805	88.40	9,087,962.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	111.50	24,520,076.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	47.45	7,653,068.15	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.75	8,833,875.00	
	AYALA LAND INC	794,100	36.00	28,587,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,003,150	36.00	36,113,400.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	1,965.00	9,215,850.00	
	PLDT INC	10,460	1,300.00	13,598,000.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	275.20	8,011,072.00		
	フィリピンペソ 小計	5,533,289		264,356,463.85 (581,663,527)	
インドネシ ア ル ピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,250.00	1,799,125,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	19,500.00	3,917,550,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,590.00	2,553,222,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	890.00	2,565,425,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,200.00	1,758,240,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	10,650.00	2,023,500,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	604,200	2,980.00	1,800,516,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	8,900.00	3,075,840,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	4,910.00	10,892,344,000.00	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	6,325.00	5,011,297,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	41,150.00	2,452,540,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,550.00	1,376,550,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,475.00	2,778,422,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,890.00	3,649,896,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,320.00	3,637,788,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,066,100	30,100.00	32,089,610,000.00	
	BANK MANDIRI	1,691,296	5,775.00	9,767,234,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	4,640.00	3,759,328,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,531,700	3,800.00	21,020,460,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,100,000	1,325.00	1,457,500,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,789,600	3,160.00	15,135,136,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	3,240.00	3,486,564,000.00	
	インドネシアルピア 小計	30,120,196		136,008,088,400.00 (1,033,661,471)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	44,050.00	290,421,650.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	102,000.00	453,594,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	272,000.00	1,519,392,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	42,900.00	531,144,900.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	51,600.00	373,687,200.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	426,500.00	333,949,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	216,000.00	409,968,000.00	
	LG CHEM LTD	4,588	833,000.00	3,821,804,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	373,000.00	327,121,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	253,000.00	488,290,000.00	
	POSCO	7,515	338,000.00	2,540,070,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	158,500.00	530,975,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	748	247,000.00	184,756,000.00	
	SKC CO LTD	1,734	160,000.00	277,440,000.00	
	CJ CORP	1,230	98,400.00	121,032,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	48,600.00	209,368,800.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	17,992	26,100.00	469,591,200.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	42,050.00	284,258,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	57,100.00	557,752,800.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	5,180	66,600.00	344,988,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	33,750.00	240,941,250.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	124,500.00	542,073,000.00	
	LG CORP	9,026	97,100.00	876,424,600.00	
	SAMSUNG C&T CORP	8,727	128,000.00	1,117,056,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	23,000.00	425,868,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	6,550.00	388,454,300.00	
	SK INC	3,592	270,000.00	969,840,000.00	



S-1 CORPORATION	840	81,400.00	68,376,000.00
CJ LOGISTICS	862	181,500.00	156,453,000.00
HMM CO LTD	25,309	44,650.00	1,130,046,850.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	199,000.00	315,614,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	16,389	30,300.00	496,586,700.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	7,940.00	236,103,840.00
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	49,800.00	351,886,800.00
HANON SYSTEMS	19,000	15,950.00	303,050,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,328	276,500.00	1,749,692,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	226,000.00	3,366,722,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	109,500.00	334,084,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	110,500.00	381,114,500.00
KIA CORP	26,820	86,000.00	2,306,520,000.00
COWAY CO LTD	5,058	76,100.00	384,913,800.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	53,000.00	216,240,000.00
HLB INC	10,012	33,850.00	338,906,200.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	159,000.00	1,752,021,000.00
KANGWON LAND INC	7,703	25,450.00	196,041,350.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	24,450.00	123,961,500.00
HYBE CO LTD	841	308,000.00	259,028,000.00
KAKAO CORP	30,701	160,500.00	4,927,510,500.00
NAVER CORP	12,477	415,500.00	5,184,193,500.00
NCSOFT CORPORATION	1,643	800,000.00	1,314,400,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	133,500.00	329,077,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	80,300.00	369,781,500.00
CJ ENM CO LTD	830	179,800.00	149,234,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	92,700.00	282,827,700.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	108,000.00	111,672,000.00
SHINSEGAE CO LTD	881	272,000.00	239,632,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	163,000.00	89,487,000.00
EMART	1,864	152,000.00	283,328,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	442,500.00	342,937,500.00
KT&G CORP	13,223	82,200.00	1,086,930,600.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,348	117,000.00	157,716,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	239,500.00	688,083,500.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,720,000.00	1,644,320,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	83	794,000.00	65,902,000.00
PACIFIC CORP	3,393	60,800.00	206,294,400.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,678	111,000.00	963,258,000.00
ALTEOGEN INC	2,841	93,300.00	265,065,300.00
CELLTRION INC	9,922	262,000.00	2,599,564,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,911	160,600.00	306,906,600.00

	GREEN CROSS CORP	564	321,500.00	181,326,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	499	339,000.00	169,161,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,638	857,000.00	1,403,766,000.00	
	SEEGENE INC	3,838	88,000.00	337,744,000.00	
	SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	67,100.00	204,587,900.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,470	128,000.00	188,160,000.00	
	YUHAN CORPORATION	5,817	61,800.00	359,490,600.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	29,188	42,500.00	1,240,490,000.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,050.00	284,716,500.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	38,842	50,400.00	1,957,636,800.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,219	38,200.00	1,727,365,800.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	11,150.00	662,376,900.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	95,200.00	438,110,400.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,650.00	222,753,600.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	9,030.00	280,065,450.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	12,300.00	148,916,100.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	42,850.00	247,501,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	53,500.00	225,181,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	209,500.00	651,126,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	75,600.00	560,725,200.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	93,000.00	134,943,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	182,000.00	677,950,000.00	
	KMW CO LTD	1,901	50,600.00	96,190,600.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	23,050.00	554,836,550.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	227,500.00	321,912,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	182,000.00	1,019,746,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	478,574	79,400.00	37,998,775,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	83,239	72,200.00	6,009,855,800.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,575	736,000.00	4,103,200,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	14,600.00	323,025,000.00	
	SK TELECOM	3,705	322,000.00	1,193,010,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	24,300.00	642,953,700.00	
	SK HYNIX INC	54,927	119,500.00	6,563,776,500.00	
	韓国ウォン 小計	1,567,557		125,837,121,440.00 (12,105,531,082)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	110.00	12,346,400.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	52.80	12,364,492.80	
	CHINA STEEL	1,266,261	38.05	48,181,231.05	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	356,061	85.10	30,300,791.10	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	103.50	40,243,284.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	501,752	86.30	43,301,197.60	
	TAIWAN CEMENT	486,511	52.00	25,298,572.00	

AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	1,080.00	12,960,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	32.95	11,467,522.60
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	22,532	380.50	8,573,426.00
EVERGREEN MARINE	266,039	187.00	49,749,293.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	29.85	4,477,500.00
WAN HAI LINES LIMITED	28,000	275.00	7,700,000.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	141,000	195.50	27,565,500.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	44.70	7,914,626.70
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	630.00	12,560,310.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	238.00	10,340,624.00
GIANT MANUFACTURING	34,464	296.00	10,201,344.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	414.50	6,632,000.00
POU CHEN	273,780	38.75	10,608,975.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	591.00	17,730,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	260.50	15,511,212.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	494,395	73.80	36,486,351.00
ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	207.50	4,150,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	16.20	9,425,905.20
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,786,237	22.70	40,547,579.90
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,122,970	26.20	29,421,814.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,002,216	22.65	22,700,192.40
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	772,097	18.65	14,399,609.05
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,056,339	32.90	34,753,553.10
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	13.95	16,138,601.55
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	965,570	16.10	15,545,677.00
TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	9.48	4,744,275.48
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	823,289	21.50	17,700,713.50
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	44.95	14,872,201.95
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,302	208.50	28,627,467.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	25.55	26,984,862.45
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	53.80	47,781,017.40
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	13.70	17,217,886.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	326,258	26.90	8,776,340.20
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	712,082	74.20	52,836,484.40
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,195,537	9.63	11,513,021.31
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	62.90	9,287,814.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	331.00	15,888,000.00
ACER INC	255,803	28.55	7,303,175.65
ADVANTECH CO LTD	29,336	348.00	10,208,928.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	373.00	26,890,316.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	22.25	21,028,252.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	181.50	12,650,550.00

	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	20.70	16,042,500.00	
	COMPAL ELECTRONICS	431,760	22.10	9,541,896.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	198,903	295.00	58,676,385.00	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	65.00	6,035,250.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,255,248	114.00	143,098,272.00	
	INVENTEC CO LTD	280,511	27.50	7,714,052.50	
	LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	2,990.00	27,029,600.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	57.50	12,963,490.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	154.50	9,270,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	418.00	8,778,000.00	
	PEGATRON CORP	200,474	67.60	13,552,042.40	
	QUANTA COMPUTER INC	286,270	90.50	25,907,435.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	52.60	6,738,060.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	142.50	14,250,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	211.00	5,697,000.00	
	WISTRON CORP	242,695	32.70	7,936,126.50	
	WIWYNN CORP	8,000	1,045.00	8,360,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	55.40	7,960,536.80	
	YAGEO CORPORATION	38,764	584.00	22,638,176.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	105.00	6,291,810.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	366,315	114.50	41,943,067.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	65.40	10,267,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	143,200	103.00	14,749,600.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	314,315	111.00	34,888,965.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,445.00	4,335,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	886.00	21,264,000.00	
	MEDIATEK INC	152,804	919.00	140,426,876.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	78.60	9,039,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	492.50	28,587,162.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	482.00	5,590,718.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	69,770	110.50	7,709,585.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	515.00	26,236,160.00	
	SILERGY CORP	7,000	3,750.00	26,250,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,476,389	584.00	1,446,211,176.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,230,000	52.20	64,206,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	113.50	10,101,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	370.00	11,840,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	35.30	12,319,700.00	
	新台湾ドル 小計	32,954,802		3,318,355,833.09 (13,036,160,890)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	456.90	30,210,228.00	
	COAL INDIA LTD	84,540	146.70	12,402,018.00	

HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	278.95	16,576,603.75
INDIAN OIL CORP LTD	193,765	107.30	20,790,984.50
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	117.90	29,794,391.10
PETRONET LNG LTD	83,779	224.00	18,766,496.00
RELIANCE INDUSTRIES LTD	285,779	2,071.20	591,905,464.80
ACC LTD	5,315	2,037.25	10,827,983.75
AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	363.60	26,736,598.80
ASIAN PAINTS LTD	37,699	3,010.60	113,496,609.40
BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	844.10	24,857,900.90
GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,500.15	47,298,229.35
HINDALCO INDUSTRIES LTD	147,807	390.05	57,652,120.35
JSW STEEL LTD	80,284	681.55	54,717,560.20
PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,992.15	24,377,046.05
PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,268	2,277.80	27,944,050.40
SHREE CEMENT LTD	901	27,502.75	24,779,977.75
TATA STEEL LTD	67,202	1,239.35	83,286,798.70
ULTRATECH CEMENT LTD	9,760	6,899.55	67,339,608.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	814.55	44,151,868.20
VEDANTA LTD	147,245	271.55	39,984,379.75
ADANI ENTERPRISES LTD	26,979	1,431.35	38,616,391.65
BHARAT ELECTRONICS LTD	116,287	180.85	21,030,503.95
HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,023.35	24,024,164.60
LARSEN & TOUBRO LTD	71,836	1,499.60	107,725,265.60
SIEMENS INDIA LTD	5,926	2,002.15	11,864,740.90
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	45,467	728.50	33,122,709.50
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	673.95	17,829,347.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,809.30	15,125,748.00
BAJAJ AUTO LTD	5,820	3,995.90	23,256,138.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,280.20	20,136,446.20
BHARAT FORGE LTD	30,322	808.00	24,500,176.00
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,712.15	39,827,922.75
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,896.80	35,451,038.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	83,591	771.55	64,494,636.05
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,994	7,425.70	103,915,245.80
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	236.35	29,408,085.10
MRF LTD	133	79,994.70	10,639,295.10
TATA MOTORS LTD	190,082	306.30	58,222,116.60
PAGE INDUSTRIES LTD	601	31,357.85	18,846,067.85
TITAN INDUSTRIES LTD	32,890	1,720.60	56,590,534.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	3,108.75	27,313,477.50
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	5,381.90	42,274,824.50
TRENT LTD	19,255	905.30	17,431,551.50

AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	3,377.60	59,189,062.40
ITC LTD	289,062	201.35	58,202,633.70
NESTLE INDIA LIMITED	3,198	17,636.00	56,399,928.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	765.95	46,732,907.35
UNITED SPIRITS LTD	32,483	655.25	21,284,485.75
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,724.00	16,491,784.00
DABUR INDIA LTD	58,111	595.60	34,610,911.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	965.65	37,142,761.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	83,473	2,451.45	204,629,885.85
MARICO LTD	42,465	531.95	22,589,256.75
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	3,725.90	37,683,752.60
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	948.70	33,598,210.50
BIOCON LTD	58,256	388.55	22,635,368.80
CIPLA LTD	49,816	959.80	47,813,396.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,599.70	67,992,765.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	5,460.30	69,040,033.20
IPCA LABORATORIES LTD	9,167	2,089.55	19,154,904.85
LUPIN LTD	26,552	1,147.85	30,477,713.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	78,858	667.90	52,669,258.20
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	3,005.05	18,360,855.50
AXIS BANK LTD	229,173	747.35	171,272,441.55
BANDHAN BANK LTD	74,811	316.75	23,696,384.25
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	170,867	2,496.45	426,560,922.15
ICICI BANK LTD	511,368	638.55	326,534,036.40
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	56,150	1,720.05	96,580,807.50
STATE BANK OF INDIA	187,504	423.75	79,454,820.00
YES BANK LTD	1,020,164	13.25	13,517,173.00
BAJAJ FINANCE LTD	28,025	6,136.15	171,965,603.75
BAJAJ FINSERV LTD	3,888	12,854.75	49,979,268.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	519.30	20,015,379.90
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,920.95	11,961,290.25
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,534.60	19,064,335.80
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	2,312.15	27,103,022.30
REC LTD	48,168	145.35	7,001,218.80
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	17,588	974.50	17,139,506.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,455.70	30,884,131.20
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	74,097	683.25	50,626,775.25
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,568.60	36,924,844.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	613.35	19,462,822.20
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	41,424	1,019.60	42,235,910.40
DLF LTD	56,420	300.35	16,945,747.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	109,406	976.85	106,873,251.10

	INFOSYS LTD	342,781	1,562.90	535,732,424.90
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,054.10	23,335,399.60
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	94,235	3,208.15	302,320,015.25
	TECH MAHINDRA LTD	62,414	1,051.75	65,643,924.50
	WIPRO LTD	144,908	525.80	76,192,626.40
	BHARTI AIRTEL LTD	241,735	536.25	129,630,393.75
	INDUS TOWERS LTD	90,578	241.50	21,874,587.00
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,019.40	43,406,052.00
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,949	917.15	24,716,275.35
	ADANI TRANSMISSION LTD	27,228	1,000.50	27,241,614.00
	GAIL INDIA LTD	174,768	147.15	25,717,111.20
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	570.05	15,234,016.20
	NTPC LTD	513,123	117.80	60,445,889.40
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	201,365	230.25	46,364,291.25
	インドルピー 小計	8,314,296		6,329,897,532.20 (9,431,547,322)
パキスタンル ピー	LUCKY CEMENT	31,357	888.19	27,850,973.83
	HABIB BANK LTD	66,500	128.68	8,557,220.00
	MCB BANK LTD	53,300	157.97	8,419,801.00
	パキスタンルピー 小計	151,157		44,827,994.83 (31,379,596)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	21,829	17.75	387,464.75
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.19	947,608.96
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.88	836,798.62
	INDUSTRIES QATAR	196,788	13.43	2,642,862.84
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	5.44	1,109,705.60
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.45	1,809,103.00
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	9.30	916,697.25
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	17.06	1,948,763.80
	QATAR NATIONAL BANK	448,253	17.80	7,978,903.40
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.13	650,273.66
	OOREDOO QSC	72,800	7.26	528,528.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	16.75	1,045,551.75
	カタールリアル 小計	2,573,602		20,802,261.63 (624,691,916)
南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	177.57	3,998,876.40
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	5,158	265.30	1,368,417.40
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,675.63	10,253,179.97
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,424	277.64	10,945,679.36
	GOLD FIELDS LTD	97,102	129.32	12,557,230.64
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	53.95	3,037,438.95
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	79,345	235.47	18,683,367.15

	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	691.70	3,715,812.40	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	217.15	7,372,242.50	
	SASOL LTD	57,207	222.50	12,728,557.50	
	SIBANYE STILLWATER LTD	266,701	59.64	15,906,047.64	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	191.69	5,310,196.38	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	112.75	4,569,644.75	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	212.88	6,069,208.80	
	NASPERS LTD-N SHS	43,648	2,735.45	119,396,921.60	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	55.11	6,089,379.45	
	BID CORP LTD	35,017	322.50	11,292,982.50	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	257.35	6,928,119.35	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,265	157.87	6,988,115.55	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	182.52	4,247,970.48	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	204.00	2,656,692.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	168.05	6,258,854.20	
	ABSA GROUP LTD	73,296	139.18	10,201,337.28	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,544	1,630.08	13,927,403.52	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	174.49	6,637,076.13	
	STANDARD BANK GROUP LTD	127,912	133.21	17,039,157.52	
	FIRSTSTRAND LTD	509,757	56.03	28,561,684.71	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	277.93	4,776,782.91	
	REMGRO LTD	55,441	115.35	6,395,119.35	
	DISCOVERY LIMITED	48,488	124.72	6,047,423.36	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	13.17	6,448,190.04	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	31.12	3,151,460.16	
	SANLAM LTD	167,172	60.25	10,072,113.00	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	33,499	105.00	3,517,395.00	
	MTN GROUP LTD	173,000	105.47	18,246,310.00	
	VODACOM GROUP	62,331	127.31	7,935,359.61	
	南アフリカランド 小計	3,005,371		423,331,747.56 (3,268,121,091)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	271,405	4.34	1,177,897.70	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	227,621	6.73	1,531,889.33	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	61,141	5.50	336,275.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	215,945	4.80	1,036,536.00	
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	13.10	3,475,377.60	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	445,149	16.28	7,247,025.72	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	3.81	1,400,323.59	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.00	1,540,160.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	174,383	22.04	3,843,401.32	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	2,413,519		21,588,886.76 (646,587,158)	



クウェートディ ナール	AGILITY	142,931	0.94	134,498.07
	BOUBAYAN BANK K.S.C	130,019	0.75	97,514.25
	KUWAIT FINANCE HOUSE	443,151	0.75	334,135.85
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	660,861	0.85	566,357.87
	MABANEE CO KPSC	67,003	0.71	47,974.14
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.58	125,560.00
クウェートディナール 小計		1,658,965		1,306,040.18 (479,617,135)
香港・オフショ ア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	109,080	4.34	473,407.20
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	19.98	399,600.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	4.99	499,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	10.38	397,554.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	10.98	964,044.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	14.65	896,580.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.86	962,798.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	39.22	1,154,636.80
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	7.70	297,990.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	29.70	1,585,980.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	151.71	1,213,680.00
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5,000	26.07	130,350.00
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	24.91	924,161.00
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	17.09	170,900.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.86	857,460.00
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	5.12	307,200.00
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	66,900	22.28	1,490,532.00
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	9.37	361,400.90
	KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	20.02	608,608.00
	LB GROUP CO LTD-A	15,300	31.32	479,196.00
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	2.42	532,642.00
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	17.08	827,526.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	19.33	140,181.16
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	36.61	656,783.40
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.92	1,123,472.00
	SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	5,100	45.04	229,704.00
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	159.25	891,800.00
	SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	117.51	705,060.00
	TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	12.19	49,979.00
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	24.42	239,316.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	8.08	744,976.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	124.65	2,181,375.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	76.06	701,273.20	
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	9.93	1,105,209.00	

YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	249.07	2,590,328.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	135.99	775,143.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	12.86	303,496.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.75	297,500.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	50.53	576,042.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	24.86	422,620.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	15,540	64.92	1,008,856.80
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	40.18	337,512.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	110,200	4.09	450,718.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	4.60	970,140.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	545.88	7,314,792.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	117.58	890,433.34
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	139,400	8.15	1,136,110.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	48.65	282,170.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	190.75	1,201,725.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	51.55	701,080.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	86.96	996,213.76
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	58,320	25.30	1,475,496.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	3.86	629,952.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	25.70	1,076,830.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	10,650	79.20	843,480.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	154,700	6.29	973,063.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	118.00	1,180,000.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	7.92	178,992.00
TBEA CO LTD-A	99,019	13.30	1,316,952.70
WEICHAO POWER CO LTD-A	43,200	16.99	733,968.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.32	247,767.52
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	28,280	40.35	1,141,098.00
YUTONG BUS CO LTD-A	44,300	12.81	567,483.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	30.92	977,072.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	58.14	480,236.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	23.75	1,120,762.50
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	8.57	686,457.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.35	592,410.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	79.52	874,720.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.55	195,545.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	5.25	560,175.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.92	196,800.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	65.50	1,329,650.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	46.14	245,418.66
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.27	233,988.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	54.80	454,840.00

YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	16.15	352,716.00
BYD CO LTD -A	4,700	248.82	1,169,454.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	33,348	20.99	699,974.52
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	53.95	998,075.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	23.70	812,910.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	28.34	830,362.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	21.93	934,218.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	224.23	627,844.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	47.43	1,316,656.80
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	74.07	451,975.14
MIDEA GROUP CO LTD-A	11,600	69.20	802,720.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	14.38	477,416.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	132.50	1,020,250.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	25.66	667,160.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	3,000	22.06	66,180.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	8.06	822,120.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	60.50	484,000.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.56	599,508.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	15.90	532,332.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.74	522,064.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	8.25	1,150,050.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	57.28	933,664.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	11.26	185,790.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	20.54	468,312.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	21.38	523,810.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	6.08	373,920.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	265.16	3,234,952.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	19.15	325,550.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	6.22	284,876.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	15,480	46.90	726,012.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	49.30	423,980.00
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	60,340	17.87	1,078,275.80
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	50.18	508,825.20
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	4.69	189,945.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	50.72	542,704.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	222.99	356,784.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	65.80	144,760.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	7.49	445,655.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	38.00	391,400.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	40.75	407,500.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	184.20	1,455,180.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	34.88	160,448.00

FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	18,408	113.90	2,096,671.20
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	3,000	198.00	594,000.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	22.22	608,828.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	74.00	1,258,000.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	30.31	36,372.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	34.31	1,176,901.62
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	54.67	945,791.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	185.10	1,684,410.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	11.40	315,780.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	40.00	460,000.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	76.50	535,500.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,972.11	14,988,036.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	216.51	2,121,798.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	56.70	1,902,738.60
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	13.65	365,820.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	16,800	27.40	460,320.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	316.70	2,970,646.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	41.47	1,310,452.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	13.97	533,095.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	267.28	5,666,336.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	79.86	806,586.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	17.00	90,100.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	28.26	839,322.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	23,226	63.83	1,482,515.58
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	71.97	467,805.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	30.44	1,025,828.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	135.41	384,293.58
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	41.04	398,908.80
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	5,250	119.49	627,322.50
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	81.80	1,010,230.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	39.04	702,720.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	14.89	154,856.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	28.60	423,280.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	8.71	216,356.40
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	97.74	704,607.66
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5,300	444.41	2,355,373.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	361.70	723,400.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	16.20	612,846.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	357.59	71,518.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	39.59	926,406.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	112.00	616,000.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	381.52	839,344.00

CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	25.80	263,160.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	175.03	1,732,797.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	34.19	758,778.67
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	32.30	516,800.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	157.90	1,263,200.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	35.91	676,903.50
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	62.10	2,366,134.20
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	16,380	38.31	627,517.80
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.25	464,725.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	139.50	948,600.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	29.50	206,500.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	59,640	18.51	1,103,936.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	19.74	221,719.68
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	11.65	227,175.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	64.63	1,098,710.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	150.78	2,482,441.92
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	15.94	416,034.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	104.11	739,181.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	432.05	1,684,995.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	20.38	183,827.60
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	29,040	27.99	812,829.60
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	60.20	583,940.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.03	1,071,408.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.85	281,300.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.85	479,665.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	6.84	513,957.60
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	10.26	518,130.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	35.10	842,400.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.56	343,980.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.48	809,352.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.62	466,618.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	49.90	5,234,510.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	4.34	1,187,424.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.95	1,218,970.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.82	694,908.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.85	1,266,820.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	20.31	1,933,512.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	21.27	2,539,638.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.76	673,540.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	9.91	1,370,553.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.85	471,625.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	17.37	1,379,178.00

CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	10.16	448,056.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	7.09	141,091.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	9.70	452,990.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	18.36	526,197.60
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	23.51	1,015,632.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	29.24	704,684.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	41,880	31.49	1,318,801.20
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	15.88	57,168.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.52	392,504.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	8.94	740,232.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.27	864,762.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	94,200	12.07	1,136,994.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.62	1,158,621.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	104.14	562,356.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	56,420	5.34	301,282.80
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	15.44	486,360.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	8.99	790,221.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	9.88	421,876.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	9.57	303,369.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	69,616	7.98	555,535.68
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.50	932,400.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.69	534,660.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	4.65	439,890.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	12.08	527,896.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	27.90	507,780.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	60.09	4,014,012.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	5.68	103,376.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	11.29	617,563.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	24.06	1,292,022.00
GEMDALE CORP-A	45,500	10.07	458,185.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	117,600	5.36	630,336.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	5.97	420,049.20
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	12.18	996,324.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	40.68	520,704.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	17.99	152,915.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	12.61	339,209.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,900	22.13	418,257.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	14.33	412,704.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	57.29	383,843.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	78,400	15.55	1,219,120.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	7.54	419,978.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9,100	84.08	765,128.00

IFLYTEK CO LTD - A	10,800	61.40	663,120.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	252.72	758,160.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	55.30	337,883.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	157.18	864,490.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	30.81	405,767.70
ADDSINO CO LTD -A	5,800	17.58	101,964.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	13,400	81.22	1,088,348.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	6.31	723,126.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	42.33	1,185,240.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	14.65	509,820.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	17.54	364,832.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	11.95	538,945.00
GOERTEK INC -A	26,900	40.02	1,076,538.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	9.14	457,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	116.20	813,400.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	27.18	535,772.16
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	28.20	473,760.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	46.27	2,149,241.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	485.80	524,664.00
NINESTAR CORP-A	18,543	31.66	587,071.38
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	8.64	270,432.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	24.50	595,350.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	108.90	518,364.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	17.87	419,945.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	31.68	424,512.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	19.93	568,005.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	15.91	747,770.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	23.01	422,003.40
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	16.30	45,640.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	99.79	419,118.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	29,512	26.63	785,904.56
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	23,360	65.61	1,532,649.60
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	83.53	939,712.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	20.52	621,756.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	36.34	316,158.00
ZTE CORP-A	12,600	31.27	394,002.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	4.95	860,310.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	20.31	2,721,540.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	9.74	658,424.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	6.20	930,000.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	4.16	343,200.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	189.00	1,185,408.00

	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	62.35	467,625.00
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	41.93	1,249,514.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	33,600	91.93	3,088,848.00
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	329.00	1,019,900.00
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	32.36	1,313,816.00
	SG MICRO CORP-A	2,100	247.88	520,548.00
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	116.36	302,536.00
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	39.48	1,164,660.00
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	15.56	509,590.00
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	23.94	537,836.04
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	170.33	834,617.00
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	329.15	1,777,410.00
	香港・オフショア人民元 小計	13,001,353		260,712,580.23 (4,432,139,935)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	26.15	616,067.85
	SAUDI ARABIAN OIL CO	218,286	34.60	7,552,695.60
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	73.00	715,692.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	20.08	641,114.24
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	13,666	43.80	598,570.80
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,868	119.80	2,260,386.40
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	30.00	968,490.00
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	64.10	2,883,474.40
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	91,645	116.80	10,704,136.00
	SAUDI CEMENT	7,489	63.70	477,049.30
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	35.35	744,435.65
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	18.60	1,229,720.40
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	67.80	1,800,496.80
	JARIR MARKETING CO	7,199	203.00	1,461,397.00
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	118.00	439,550.00
	ALMARAI CO	30,130	58.30	1,756,579.00
	SAVOLA	25,336	40.90	1,036,242.40
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	2,778	158.80	441,146.40
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	4,029	172.80	696,211.20
	AL RAJHI BANK	124,491	106.60	13,270,740.60
	ALINMA BANK	109,956	20.88	2,295,881.28
	ARAB NATIONAL BANK	57,638	21.92	1,263,424.96
	BANK AL-JAZIRA	35,813	18.40	658,959.20
	BANK ALBILAD	45,859	35.85	1,644,045.15
	BANQUE SAUDI FRANSI	48,656	37.50	1,824,600.00
	RIYAD BANK	138,943	25.60	3,556,940.80
	SAUDI BRITISH BANK	71,793	29.90	2,146,610.70
	THE SAUDI NATIONAL BANK	223,924	55.40	12,405,389.60



BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	130.00	788,190.00
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	79.00	522,427.00
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	10.10	475,629.20
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	12.12	559,786.44
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	31.10	1,070,275.40
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	14.04	377,549.64
SAUDI TELECOM CO	60,999	126.80	7,734,673.20
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	24.72	2,279,703.12
サウジアラビアリアル 小計	1,856,991		89,898,281.73 (2,644,807,448)
合計	254,235,731		91,085,044,206 (91,085,044,206)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	6,085,864.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	6,085,864.00 (33,726,641)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	101,600	3,091,688.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	31,500	2,393,055.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,826,820.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	744,150.00	
	KLABIN SA-UNIT	64,600	1,744,200.00		
ブラジルリアル 小計	260,100	9,799,913.00 (205,251,337)			
投資信託受益証券合計			318,500	238,977,978 (238,977,978)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	6,655,272.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	6,655,272.00 (36,882,186)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	4,646,990.25	
		南アフリカランド 小計	295,047	4,646,990.25 (35,874,764)	
投資証券合計			603,447	72,756,950 (72,756,950)	
合計				311,734,928 (311,734,928)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 72銘柄	100.0%			9.8%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.7%			1.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.2%	0.0%
ブラジルリアル	株式 50銘柄	95.6%			4.9%
	投資信託受 益証券 5銘柄		4.4%		0.2%
チリペソ	株式 13銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 4銘柄	100.0%			0.1%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 11銘柄	100.0%			0.2%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%			0.8%
香港ドル	株式 213銘柄	100.0%			25.3%
マレーシアリンギット	株式 36銘柄	100.0%			1.3%
タイバーツ	株式 43銘柄	100.0%			1.6%
フィリピンペソ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%			1.1%
韓国ウォン	株式 102銘柄	100.0%			13.2%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			14.3%
インドルピー	株式 100銘柄	100.0%			10.3%
パキスタンルピー	株式 3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%			0.7%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.9%			3.6%
	投資証券 1銘柄			1.1%	0.0%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 9銘柄	100.0%			0.7%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.0%			0.5%
香港・オフショア人 民元	株式 298銘柄	100.0%			4.8%

サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%			2.9%
------------	----	------	--------	--	--	------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	760,211,286
コール・ローン	929,766,625
国債証券	69,702,775,676
未収利息	816,283,886
前払費用	82,543,739
流動資産合計	72,291,581,212
資産合計	72,291,581,212
負債の部	
流動負債	
未払金	272,103,080
未払解約金	22,428,929
未払利息	1,418
流動負債合計	294,533,427
負債合計	294,533,427
純資産の部	
元本等	
元本	40,865,028,836
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	31,132,018,949
元本等合計	71,997,047,785
純資産合計	71,997,047,785
負債純資産合計	72,291,581,212

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2021年 7月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,865,028,836口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7618円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,618円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2021年 7月12日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	35,367,224,488円
期中追加設定元本額	7,992,318,525円
期中一部解約元本額	2,494,514,177円
期末元本額	40,865,028,836円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,467,278,189円
世界経済インデックスファンド	8,212,947,094円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,943,087,552円
DC世界経済インデックスファンド	9,437,298,073円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,808,232,006円
コア投資戦略ファンド（安定型）	146,670,330円
コア投資戦略ファンド（成長型）	399,809,303円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	80,389,900円
分散投資コア戦略ファンドA	224,890,391円
分散投資コア戦略ファンドS	482,336,271円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	387,931,776円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,150,771,687円
コア投資戦略ファンド（切替型）	114,516,341円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,174,908円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	86,348,368円
SMT インデックスバランス・オープン	159,936,836円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,176,467,356円
SMT 世界経済インデックス・オープン	231,593,608円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	255,612,685円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	412,172,168円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,971,163円
グローバル経済コア	638,220,943円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	43,103,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,024,122円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,695,243円

区分	2021年 7月12日現在
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,148,784円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,858,486円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,562,890円
F O F s用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	77,033,105円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	245,807,993円
S M T A M海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	301,296,923円
S M T A M海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	301,183,796円
S M T A M海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	290,856,697円
S M T A M海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	289,032,886円
S M T A M海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	288,766,966円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,489,346,619
合計		2,489,346,619

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	39,257,988.00	
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	111,876,995.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000.00	113,199,442.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000.00	104,674,780.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000.00	94,158,458.00	

	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	113,442,551.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	60,400,000.00	64,313,316.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	77,000,000.00	80,083,850.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	34,866,678.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000.00	129,759,000.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	64,400,000.00	71,821,456.00	
	MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	77,728,759.00	
	MBONO 8% 11/07/47	64,800,000.00	69,174,648.00	
	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	102,420,438.00	
	メキシコペソ 小計	1,140,250,000.00	1,206,778,359.50	(6,687,724,312)
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000.00	69,032,956.73	
	BLTN 0% 07/01/22	22,350,000.00	20,948,107.42	
	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	44,069,621.76	
	BLTN 0% 07/01/24	13,500,000.00	10,643,764.50	
	BNTNF 10% 01/01/23	39,550,000.00	40,886,227.04	
	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	33,313,131.95	
	BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000.00	32,979,852.25	
	BNTNF 10% 01/01/29	17,400,000.00	18,307,164.06	
	BNTNF 10% 01/01/31	7,450,000.00	7,766,690.30	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,457,750.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,935,625.00	
	ブラジルレアル 小計	301,750,000.00	281,340,891.01	(5,892,459,889)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	375,000,000.00	326,239,726.12	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,458,469,391.88	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,742,056,630.60	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,480,000,000.00	1,502,235,480.04	
	BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	860,961,912.72	
	BTPCL 5% 03/01/35	1,890,000,000.00	1,900,717,853.58	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,480,000,000.00	1,647,079,835.88	
	チリペソ 小計	10,290,000,000.00	10,437,760,830.82	(1,536,177,450)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000.00	85,541,745,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	11,000,000,000.00	11,229,900,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	19,300,000,000.00	19,252,329,000.00	
	コロンビアペソ 小計	102,600,000,000.00	116,023,974,000.00	(3,334,412,988)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,369,152.50	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,600,000.00	5,104,568.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,200,000.00	3,535,968.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,970,000.00	7,387,781.80	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	6,388,767.00	



	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	8,371,748.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	7,094,560.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,450,000.00	7,071,264.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	6,839,720.50	
	ペルーヌエボソル 小計	52,770,000.00	55,163,529.80 (1,531,146,514)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	25,510,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	12,983,375.00	
	ウルグアイペソ 小計	37,500,000.00	38,493,375.00 (96,706,906)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,452,640.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	28,375,750.00	
	ドミニカペソ 小計	45,400,000.00	49,828,390.00 (96,567,419)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,362,951.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	6,450,997.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,950,000.00	7,783,188.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	6,850,000.00	6,363,650.00	
	TURKGB 11.7% 11/13/30	12,400,000.00	9,408,500.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	5,701,626.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	7,350,000.00	7,044,019.50	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,194,823.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,832,615.00	
	TURKGB 12.6% 10/01/25	14,400,000.00	12,273,120.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	7,100,000.00	6,919,731.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,276,262.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	5,100,000.00	4,607,136.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	8,300,000.00	6,207,155.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	10,750,000.00	8,670,412.50	
	トルコリラ 小計	123,000,000.00	103,096,186.50 (1,312,661,884)	
チェココル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	27,123,865.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	49,770,771.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	46,118,750.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,900,000.00	43,857,597.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	46,000,000.00	43,754,280.00	
	CZGB 1% 06/26/26	59,200,000.00	57,464,848.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	42,900,000.00	44,295,537.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	51,000,000.00	53,703,510.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	50,300,000.00	54,192,717.00	
	CZGB 2% 10/13/33	52,200,000.00	53,272,188.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	36,608,600.00	

	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	37,619,714.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	42,366,506.00	
	チェココルナ 小計	581,800,000.00	590,148,883.00	(2,997,956,325)
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	458,500,000.00	447,454,735.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	324,473,700.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	274,000,000.00	266,495,140.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	275,000,000.00	278,668,500.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	455,995,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	382,000,000.00	361,127,520.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	560,806,760.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	485,518,360.00	
	HGB 2% 05/23/29	173,000,000.00	168,680,190.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	587,000,000.00	623,775,550.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	417,823,175.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	580,824,150.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	617,384,960.00	
	HGB 3% 10/27/38	340,000,000.00	333,567,200.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	749,456,400.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	520,831,800.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	262,000,000.00	338,430,640.00	
HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	296,494,800.00		
	ハンガリーフォリント 小計	7,528,000,000.00	7,827,808,830.00	(2,879,099,398)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	10,500,000.00	9,910,635.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	12,850,000.00	12,788,320.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	14,100,000.00	13,588,452.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,217,440.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	13,800,000.00	14,455,914.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,582,570.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	14,989,432.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	25,536,360.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	15,302,736.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000.00	15,394,220.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	21,550,000.00	23,491,655.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,408,447.50	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	11,733,624.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	11,588,668.00	
	ポーランドズロチ 小計	206,600,000.00	215,988,474.00	(6,213,210,838)
ロシアルー ブル	RFLB 4.5% 07/16/25	195,500,000.00	179,420,125.00	
	RFLB 5.7% 05/17/28	219,000,000.00	204,088,290.00	
	RFLB 6.1% 07/18/35	192,000,000.00	175,067,520.00	

	RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	147,784,160.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	157,492,820.00	
	RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	207,442,800.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	146,000,000.00	146,671,600.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	165,100,000.00	166,318,438.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	212,529,248.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	162,478,965.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	205,220,868.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	167,254,555.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	117,700,000.00	119,157,126.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	221,500,000.00	230,519,480.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	140,700,990.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	165,201,640.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	146,521,835.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	189,009,250.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	71,642,152.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	107,791,744.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	164,667,360.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	128,576,296.00	
	ロシアルーブル 小計	3,584,550,000.00	3,595,557,262.00 (5,321,424,747)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	7,700,000.00	7,379,449.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,332,773.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,673,742.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	9,450,000.00	9,773,757.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,288,048.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,006,849.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	7,550,000.00	7,293,904.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,372,285.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,242,312.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000.00	28,821,507.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,667,576.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,610,682.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	9,227,568.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	27,502,800.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	8,500,000.00	8,963,760.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	5,900,000.00	5,817,164.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	8,012,148.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	9,600,000.00	10,150,944.00	
MGS 4.762% 04/07/37	5,850,000.00	6,383,403.00		
	マレーシアリンギット 小計	202,050,000.00	210,520,673.00 (5,542,356,706)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	91,043,905.00	

	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	118,029,213.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	99,000,000.00	101,858,130.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	53,205,696.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	41,598,648.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	85,100,000.00	85,810,585.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	59,300,000.00	60,083,353.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	106,100,000.00	113,130,186.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	91,000,000.00	95,117,750.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	83,200,000.00	92,523,392.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	61,600,000.00	57,377,936.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	53,500,000.00	54,662,555.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000.00	203,081,828.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000.00	136,927,424.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,024,040.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	97,300,000.00	114,698,213.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	89,400,000.00	106,984,086.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	97,400,000.00	110,605,492.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	132,089,165.00	
	タイバーツ 小計	1,718,400,000.00	1,857,851,597.00 (6,260,959,881)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,123,450.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	23,891,200.00	
	フィリピンペソ 小計	35,000,000.00	39,014,650.00 (85,843,934)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,307,938,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,530,234,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	33,500,000,000.00	33,684,250,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	52,500,000,000.00	53,779,950,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	45,113,850,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,593,698,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	39,000,000,000.00	38,931,360,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	62,100,000,000.00	65,284,488,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	23,973,600,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,058,080,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,639,240,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	28,159,888,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,072,307,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,004,284,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	39,164,400,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,041,740,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	38,898,340,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,396,220,000.00	

	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,086,212,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,400,000,000.00	20,491,896,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	51,009,292,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	57,560,360,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,534,120,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	32,802,393,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	40,165,597,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,714,770,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	22,883,717,000.00	
	インドネシアルピア 小計	860,400,000,000.00	918,882,224,000.00 (6,983,504,902)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	121,100,000.00	137,530,848.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	43,600,000.00	30,973,004.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,883,146.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	44,900,000.00	46,671,305.00	
	SAGB 7% 02/28/31	40,200,000.00	34,545,468.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	67,700,000.00	61,889,309.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	59,071,695.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	57,701,974.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	97,100,000.00	82,094,166.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	56,102,576.00	
	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000.00	90,438,096.00	
	SAGB 9% 01/31/40	48,450,000.00	42,626,310.00	
	南アフリカランド 小計	790,950,000.00	722,527,897.00 (5,577,915,364)	
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,406,000.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	17,917,740.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,470,080.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	4,700,000.00	4,721,009.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000.00	30,330,420.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	16,989,570.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000.00	34,216,580.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	5,000,000.00	5,008,150.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	5,000,000.00	5,015,700.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,202,440.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	8,000,000.00	8,068,320.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,207,200.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,798,532.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000.00	29,816,598.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,211,200.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,400,400.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,167,455.00	
CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,460,680.00		

	CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,409,200.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,509,340.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,254,080.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	5,100,000.00	5,249,634.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	23,700,000.00	24,675,729.00	
	香港・オフショア人民元 小計	429,200,000.00	432,506,057.00 (7,352,646,219)	
	合計		69,702,775,676 (69,702,775,676)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.6%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.5%
チリペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	4.8%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.2%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.9%
チェココルナ	国債証券 13銘柄	100.0%	4.3%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	4.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	8.9%
ロシアルーブル	国債証券 22銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリングット	国債証券 19銘柄	100.0%	8.0%
タイバーツ	国債証券 19銘柄	100.0%	9.0%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券 27銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	8.0%
香港・オフショア人民元	国債証券 23銘柄	100.0%	10.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,283,917,299
投資証券	108,677,185,200
派生商品評価勘定	164,872,800
未収入金	388,319,977
未収配当金	698,732,434
差入委託証拠金	221,238,000
流動資産合計	113,434,265,710
資産合計	113,434,265,710
負債の部	
流動負債	
前受金	164,872,800
未払解約金	233,269,396
未払利息	5,011
流動負債合計	398,147,207
負債合計	398,147,207
純資産の部	
元本等	
元本	49,323,843,791
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	63,712,274,712
元本等合計	113,036,118,503
純資産合計	113,036,118,503
負債純資産合計	113,434,265,710

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2021年 7月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	49,323,843,791口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2917円 (1万口当たり純資産額) (22,917円)

## （金融商品に関する注記）

## 1.金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。



	2021年 7月12日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	67,089,596,986円
期中追加設定元本額	5,714,855,447円
期中一部解約元本額	23,480,608,642円
期末元本額	49,323,843,791円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,642,287,080円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,366,440円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,942,983,060円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	23,336,027,727円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,308,419,559円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,930,352,237円
分散投資コア戦略ファンドA	410,633,592円
分散投資コア戦略ファンドS	823,636,982円
コア投資戦略ファンド（切替型）	810,853,753円
S M T インデックスバランス・オープン	27,209,188円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	271,547,410円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,362,280円
グローバル経済コア	260,522,228円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,761,833円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	409,005,482円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,199,142円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	496,637,523円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	10,004,860円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	893,261,362円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	378,268,198円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	307,503,855円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

投資証券	22,791,488,383
合計	22,791,488,383

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 投資証券関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,807,313,200	-	3,972,186,000	164,872,800
	合計	3,807,313,200	-	3,972,186,000	164,872,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1)株式

該当事項はありません。

###### (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,504	224,848,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,252	301,092,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,420	409,948,000	
	東海道リート投資法人	248	28,569,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,172	2,201,368,000	
	森ヒルズリート投資法人	10,812	1,816,416,000	
	産業ファンド投資法人	13,010	2,807,558,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	8,743	3,383,541,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,273	1,510,538,400	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	4,612	2,370,568,000	
	G L P 投資法人	29,705	5,688,507,500	

コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,138	1,564,164,000	
日本プロロジスリート投資法人	14,551	5,187,431,500	
星野リゾート・リート投資法人	1,400	989,800,000	
Oneリート投資法人	1,435	491,487,500	
イオンリート投資法人	9,336	1,558,178,400	
ヒューリックリート投資法人	7,630	1,435,966,000	
日本リート投資法人	2,990	1,320,085,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	58,490	1,326,553,200	
積水ハウス・リート投資法人	27,072	2,612,448,000	
トーセイ・リート投資法人	2,036	292,573,200	
ケネディクス商業リート投資法人	3,661	1,097,567,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,963	306,816,900	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,772	230,005,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	29,764	5,271,204,400	
いちごホテルリート投資法人	1,609	156,073,000	
ラサールロジポート投資法人	11,134	2,174,470,200	
スターアジア不動産投資法人	9,457	608,085,100	
マリモ地方創生リート投資法人	862	115,077,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,212	1,917,564,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,486	127,944,600	
投資法人みらい	9,940	553,658,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,993	280,614,400	
三菱地所物流リート投資法人	2,315	1,113,515,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	2,945	587,822,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,410	177,660,000	
タカラレーベン不動産投資法人	2,766	362,899,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,570	586,551,000	
日本ビルファンド投資法人	10,359	7,292,736,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,204	6,461,208,000	
日本都市ファンド投資法人	45,846	5,432,751,000	
オリックス不動産投資法人	18,339	3,900,705,300	
日本プライムリアルティ投資法人	5,730	2,481,090,000	
NTT都市開発リート投資法人	8,313	1,371,645,000	
東急リアル・エステート投資法人	6,171	1,261,969,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,391	811,017,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	19,684	3,330,532,800	
森トラスト総合リート投資法人	6,578	1,055,769,000	
インヴィンシブル投資法人	38,486	1,758,810,200	
フロンティア不動産投資法人	3,227	1,658,678,000	
平和不動産リート投資法人	5,947	1,066,297,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,014	2,029,725,000	
福岡リート投資法人	4,760	888,216,000	

ケネディクス・オフィス投資法人	2,847	2,263,365,000	
いちごオフィスリート投資法人	7,542	751,937,400	
大和証券オフィス投資法人	1,946	1,547,070,000	
阪急阪神リート投資法人	4,157	715,419,700	
スタートプロシード投資法人	1,433	360,542,800	
大和ハウスリート投資法人	13,132	4,215,372,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,652	2,010,405,600	
大和証券リビング投資法人	12,019	1,490,356,000	
ジャパンエクセレント投資法人	8,541	1,332,396,000	
合計	578,006	108,677,185,200	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		283,310,998
コール・ローン		34,345,067
投資証券		93,684,589,683
未収入金		1,097,099
未収配当金		306,860,242
流動資産合計		94,310,203,089
資産合計		94,310,203,089
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		59,501
未払株式払込金		3,471,644
未払解約金		50,482,858
未払利息		52
流動負債合計		54,014,055
負債合計		54,014,055
純資産の部		
元本等		
元本		41,364,083,335
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		52,892,105,699
元本等合計		94,256,189,034

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
純資産合計	94,256,189,034
負債純資産合計	94,310,203,089

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,364,083,335口
2. 1口当たり純資産額	2.2787円

2021年 7月12日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (22,787円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2021年 7月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	56,703,060,151円
期中追加設定元本額	5,933,734,007円
期中一部解約元本額	21,272,710,823円
期末元本額	41,364,083,335円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	71,453,859円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	111,784,396円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,674,023,062円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,558,605円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,895,193,707円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,452,704,405円



区分	2021年 7月12日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	878,873,279円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,924,492,863円
分散投資コア戦略ファンドA	345,347,104円
分散投資コア戦略ファンドS	767,067,340円
コア投資戦略ファンド（切替型）	781,748,503円
SMT インデックスバランス・オープン	151,113,822円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	268,792,026円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,782,584円
グローバル経済コア	263,391,588円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,128,689円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	408,099,388円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,971,190円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,152,266,960円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	428,372,456円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	93,284,369円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	4,065,754円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	126,865,565円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	129,296,887円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	124,909,598円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	124,042,433円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	120,452,903円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		18,775,970,474
合計		18,775,970,474

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,279,300	-	25,338,801	59,501
	アメリカドル	25,279,300	-	25,338,801	59,501

合計	25,279,300	-	25,338,801	59,501
----	------------	---	------------	--------

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	1,025,639.00	
		AGREE REALTY CORP	38,105	2,759,945.15	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	765,719.40	
		ALEXANDER'S INC	1,190	321,311.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,750	14,434,162.50	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,157	1,026,263.03	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	74,992	3,694,105.92	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	495,788.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,482	6,288,357.68	
		AMERICOLD REALTY TRUST	138,199	5,409,108.86	
		APARTMENT INCOME REIT CO	86,759	4,333,612.05	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	76,106	547,202.14	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,735,480.64	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	412,360.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,519	17,118,520.77	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	156,964.50	
		BOSTON PROPERTIES	79,055	9,262,874.35	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,305,999.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	162,046	3,757,846.74	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,126,318.70	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	24,100	457,418.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	88,550.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	53,609	7,568,518.62	

CARETRUST REIT INC	52,477	1,245,803.98
CENTERSPACE	7,499	616,267.82
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	315,732.00
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	13,000	112,450.00
CITY OFFICE REIT INC	25,050	306,612.00
CLIPPER REALTY INC	7,300	57,743.00
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	60,331	1,035,883.27
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,605	574,215.40
COREPOINT LODGING INC	22,000	247,280.00
COESITE REALTY CORP	23,959	3,314,248.47
CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,852,453.47
COUSINS PROPERTIES INC	83,426	3,176,862.08
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	154,140.00
CUBESMART	112,530	5,458,830.30
CYRUSONE INC	67,819	5,059,975.59
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,073,856.00
DIGITAL REALTY TRUST INC	156,215	24,332,048.40
DIGITALBRIDGE GROUP INC	263,096	2,023,208.24
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	547,136.00
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	92,547	3,163,256.46
DUKE REALTY CORP	208,631	10,400,255.35
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,027,245.40
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,329	3,819,598.74
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	993,695.50
EPR PROPERTIES	41,912	2,206,247.68
EQUINIX INC	49,526	40,627,168.32
EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,818,246.00
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,289	7,405,458.06
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	189,646	15,495,974.66
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	1,783,501.16
ESSEX PROPERTY TRUST	36,145	11,575,074.80
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,703	12,764,622.57
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	152,012.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,320	4,641,726.00
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,298	3,796,092.00
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	40,250	1,159,602.50
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	306,677.17
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	121,511	5,692,790.35
GEO GROUP INC/THE	64,306	459,144.84
GETTY REALTY CORP	21,985	712,094.15
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	454,987.00

GLADSTONE LAND CORP	15,500	362,390.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	419,006.60	
GLOBAL NET LEASE INC	51,412	955,749.08	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	78,310	2,401,767.70	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	119,276	3,251,463.76	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,842	10,422,507.92	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	223,861.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,422	2,696,759.52	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	393,361	6,730,406.71	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,365,661.60	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,131	1,121,715.07	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,941	1,009,230.60	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,388	2,730,884.24	
INVITATION HOMES INC	314,773	12,559,442.70	
IRON MOUNTAIN INC	158,471	6,931,521.54	
JBG SMITH PROPERTIES	62,238	1,981,657.92	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	350,000	281,750.00	
KILROY REALTY CORPORATION	57,829	4,091,401.75	
KIMCO REALTY CORP	239,966	5,089,678.86	
KITE REALTY GROUP TRUST	46,370	996,955.00	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	1,874,652.08	
LIFE STORAGE INC	42,485	4,843,290.00	
LTC PROPERTIES INC	20,326	792,104.22	
MACERICH CO/THE	92,542	1,654,650.96	
MACK-CALI REALTY CORP	50,236	880,637.08	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	589,251.20	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	328,046	6,724,943.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,511	11,476,437.70	
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,028,701.44	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	95,939	4,573,412.13	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	38,720	2,040,544.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,687,022.00	
NETSTREIT CORP	14,992	366,854.24	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	406,800.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	707,164.12	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	806,791.70	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	130,489	4,852,885.91	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	250,660.85	
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	908,027.12	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	133,133	2,616,063.45	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,647,099.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	78,750.00	

PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,209,995.68	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,273,575.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	330,243.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	302,614.19	
PRIME US REIT	295,000	250,750.00	
PROLOGIS INC	409,939	51,402,251.21	
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,713,449.64	
PUBLIC STORAGE	84,437	26,317,324.16	
QTS REALTY TRUST INC	38,049	2,953,363.38	
REALTY INCOME CORP	207,543	14,293,486.41	
REGENCY CENTERS CORP	87,710	5,702,027.10	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	62,989	1,116,794.97	
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	115,918	1,343,489.62	
RETAIL VALUE	9,529	205,921.69	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	73,995	4,347,946.20	
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,328,067.49	
RPT REALTY	43,950	570,031.50	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,390,911.44	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,636	2,199,511.44	
SAFEHOLD INC	8,340	700,643.40	
SAUL CENTERS INC	6,800	310,216.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	344,668.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,176,170.81	
SIMON PROPERTY GROUP	182,255	23,636,650.95	
SITE CENTERS CORP	91,820	1,390,154.80	
SL GREEN REALTY CORP	38,945	3,068,476.55	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,982	3,116,563.22	
STAG INDUSTRIAL INC	89,179	3,481,548.16	
STORE CAPITAL CORP	135,047	4,846,836.83	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	581,385.20	
SUN COMMUNITIES INC	62,196	11,249,390.52	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	116,130	1,401,689.10	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	1,087,161.50	
TERRENO REALTY CORP	38,649	2,582,139.69	
UDR INC	163,050	8,472,078.00	
UMH PROPERTIES INC	21,320	469,679.60	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	431,558.97	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,133,559.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	287,906.50	
VENTAS INC	208,066	12,200,990.24	
VEREIT INC	127,247	6,062,047.08	

	VICI PROPERTIES INC	295,341	9,285,521.04	
	VORNADO REALTY TRUST	85,675	3,985,601.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,112,819.40	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,885	2,177,106.75	
	WELLTOWER INC	231,721	20,027,646.03	
	WHITESTONE REIT	19,090	154,819.90	
	WP CAREY INC	98,450	7,676,146.50	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,162,903.50	
	アメリカドル 小計	13,867,875	638,389,085.61 (70,331,325,561)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,566,423.30	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	471,861.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	152,640.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	626,935.40	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,320	2,838,952.80	
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,282,209.60	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	633,511.80	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	489,548.34	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	472,796.50	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	51,250	825,125.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	322,420.60	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,047,741.10	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,805	1,539,242.25	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,039	1,377,663.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	40,490	724,771.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	628,939.50	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	273,171.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	229,313.10	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,470	632,048.80	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	115,000.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	83,631	1,923,513.00	
	SLATE GROCERY REIT	10,300	136,475.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	91,800.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	37,476	1,140,769.44	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	867,150.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	192,726.00		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	539,795.00		

	カナダドル 小計	976,675	21,142,542.53 (1,869,846,461)
ユーロ	AEDIFICA	19,825	2,337,367.50
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	98,200	1,639,940.00
	ALTAREA	2,230	422,362.00
	BEFIMMO S.C.A.	14,010	505,060.50
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	416,250.00
	CARMILA	25,000	296,500.00
	COFINIMMO	16,333	2,172,289.00
	COVIVIO(FP)	26,742	2,072,505.00
	CROMWELL REIT EUR	160,000	403,200.00
	EUROCOMMERCIAL	20,783	456,394.68
	GECINA SA	30,422	4,041,562.70
	HAMBORNER REIT AG	37,000	341,547.00
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	470,828.40
	ICADE	17,080	1,295,518.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	141,411.15
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,062	1,275,200.48
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	298,870.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	416,000.00
	KLEPIERRE	111,130	2,462,640.80
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	179,860.00
	MERCIALYS	19,000	202,160.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	180,986	1,675,930.36
	MONTEA NV	5,300	562,860.00
	NSI NV	10,050	361,297.50
RETAIL ESTATES	6,400	472,320.00	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,158	5,820,027.94	
VASTNED RETAIL	10,650	278,497.50	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,470	2,588,621.00	
WERELDHAVE NV	22,670	340,276.70	
XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	559,584.00	
	ユーロ 小計	1,858,381	34,506,882.21 (4,514,190,330)
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	117,292.00
	ASSURA PLC	1,467,040	1,123,019.12
	BIG YELLOW GROUP PLC	89,146	1,240,912.32
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	408,900.00
	BRITISH LAND CO PLC	524,845	2,704,001.44
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	810,321.73
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	384,197.98
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	233,104.62

	DERWENT LONDON PLC	61,915	2,157,118.60	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	277,542.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	264,000	512,160.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	144,780	1,088,745.60	
	HAMMERSON PLC	2,291,000	884,326.00	
	HOME REIT PLC	132,934	150,880.09	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	204,312.96	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	419,205	2,887,484.04	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,222,252.96	
	LXI REIT PLC	344,008	491,931.44	
	NEWRIVER REIT PL	186,000	161,820.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	309,540.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,153,829.70	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	200,910.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,185,898.14	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	172,550.00	
	SEGRE PLC	660,723	7,694,119.33	
	SHAFTESBURY PLC	168,693	1,026,496.90	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	190,351.88	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	552,210.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	213,043.72	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	947,658	1,959,756.74	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	392,000	315,560.00	
	UNITE GROUP PLC	221,192	2,533,754.36	
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	601,466.85	
	イギリスポンド 小計	14,153,068	35,179,080.52 (5,386,269,018)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	744,691.20	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	250,500.00	
	ARENA REIT	201,053	743,896.10	
	AVENTUS GROUP	193,500	607,590.00	
	BWP TRUST	254,160	1,082,721.60	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	321,000	959,790.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	266,606	989,108.26	
	CENTURIA OFFICE REIT	220,945	536,896.35	
	CHARTER HALL GROUP	258,140	3,926,309.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,312	1,436,242.56	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,092,830.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	687,340.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,102,633	992,369.70	
	DEXUS	590,307	6,097,871.31	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	356,950.00	



	GOODMAN GROUP	926,628	19,774,241.52	
	GPT GROUP	1,055,317	5,107,734.28	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	662,037.20	
	HOME CONSORTIUM	91,000	487,760.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	400,276.58	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	268,547.40	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	940,728.00	
	IRONGATE GROUP	272,000	402,560.00	
	MIRVAC GROUP	2,193,770	6,427,746.10	
	NATIONAL STORAGE REIT	601,340	1,250,787.20	
	RURAL FUNDS GROUP	212,766	529,787.34	
	SCENTRE GROUP	2,887,179	7,824,255.09	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,398,293.40	
	STOCKLAND	1,308,941	5,929,502.73	
	VICINITY CENTERS	2,158,040	3,355,752.20	
	WAYPOINT REIT LTD	455,796	1,189,627.56	
	オーストラリアドル 小計	18,243,294	76,454,743.98 (6,297,577,261)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	848,849.82	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,464,732.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	1,017,310.65	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,160,919.80	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	738,168.44	
	ニュージーランドドル 小計	2,867,311	5,229,980.71 (402,656,214)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	4,973,060.00	
	FORTUNE REIT	756,000	6,357,960.00	
	LINK REIT	1,146,400	85,005,560.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,256,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,642,310.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	3,247,460.00	
	香港ドル 小計	5,171,400	104,482,350.00 (1,481,559,723)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	431,750.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	655,579.76	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,819,618	5,477,050.18	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,051,389.62	
	CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	695,577.77	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,477,444	5,301,730.16	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	525,672.00	
	EC WORLD REIT	180,000	146,700.00	

	ESR REIT	1,404,065	631,829.25	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	318,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	734,262	1,820,969.76	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	241,500.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,581,096	2,355,833.04	
	IREIT GLOBAL	405,985	259,830.40	
	KEPPEL DC REIT	688,603	1,776,595.74	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,251,166.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	485,625.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,480,400	158,745.60	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,210,473	2,650,935.87	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,073,963	3,071,534.18	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,618,200	3,398,220.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,212,100	1,248,463.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	554,035.14	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	203,000	956,130.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	478,540	205,772.20	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	286,926.00	
	SPH REIT	576,800	533,540.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	859,400	507,046.00	
	SUNTEC REIT	1,180,700	1,794,664.00	
	シンガポールドル 小計	27,835,368	38,936,007.17 (3,174,452,664)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	54,685	418,340,250.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	63,691,980.00	
	JR REIT XXVII	64,338	340,348,020.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	123,800,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	433,430,400.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	199,932,250.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	149,880,050.00	
	韓国ウォン 小計	284,799	1,729,422,950.00 (166,370,487)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,794,690.00	
	イスラエルシェケル 小計	103,500	1,794,690.00 (60,341,964)	
	合計	85,361,671	93,684,589,683 (93,684,589,683)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 156銘柄	100.0%	75.1%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	4.8%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.7%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券 7銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,719,731
コール・ローン	106,703,091
投資信託受益証券	35,718,965,831
派生商品評価勘定	287,627,218
流動資産合計	36,120,015,871
資産合計	36,120,015,871
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,850,289
未払利息	162

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	5,850,451
負債合計	5,850,451
純資産の部	
元本等	
元本	28,562,552,203
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,551,613,217
元本等合計	36,114,165,420
純資産合計	36,114,165,420
負債純資産合計	36,120,015,871

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,562,552,203口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 1.2644円 (1万口当たり純資産額) (12,644円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引

	2021年 7月12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>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	22,572,469,512円
期中追加設定元本額	9,867,819,725円
期中一部解約元本額	3,877,737,034円
期末元本額	28,562,552,203円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,248,503,799円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,329,169,406円
分散投資コア戦略ファンドA	3,137,168,962円
分散投資コア戦略ファンドS	12,026,495,095円

区分	2021年 7月12日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,376,230,479円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,632,248円
グローバル経済コア	1,187,625,868円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,241,421,226円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	557,552,669円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	67,659,411円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	138,698,918円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,720,394,122円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		352,728,678
合計		352,728,678

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益	
			(円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	35,023,344,558	-	34,735,717,340	287,627,218
	アメリカドル	35,023,344,558	-	34,735,717,340	287,627,218
合計		35,023,344,558	-	34,735,717,340	287,627,218

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	9,416,695	324,216,808.85	
	アメリカドル 小計		9,416,695	324,216,808.85 (35,718,965,831)	
合計			9,416,695	35,718,965,831 (35,718,965,831)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	886,001,346
社債券	18,025,929,000



	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	18,911,930,346
資産合計	18,911,930,346
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,409,251
未払利息	1,352
流動負債合計	1,410,603
負債合計	1,410,603
純資産の部	
元本等	
元本	21,125,701,112
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,215,181,369
元本等合計	18,910,519,743
純資産合計	18,910,519,743
負債純資産合計	18,911,930,346

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,125,701,112口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,215,181,369円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8951円 (1万口当たり純資産額) (8,951円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 10月6日
期首元本額	495,000円
期中追加設定元本額	21,314,923,722円
期中一部解約元本額	189,717,610円
期末元本額	21,125,701,112円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	620,000,000円
コア投資戦略ファンド(成長型)	755,000,000円
分散投資コア戦略ファンドA	2,026,367,965円
分散投資コア戦略ファンドS	8,997,719,621円
コア投資戦略ファンド(切替型)	280,000,000円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	159,246,941円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	6,835,083,213円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	100,000,000円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	11,350,833円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	257,979,579円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS(適格機関投資家専用)	205,748,207円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(適格機関投資家専用)	877,204,753円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	351,701,000
合計	351,701,000

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	STAR HELIOS 0% 10/18/ 21	20,170,000,000	18,025,929,000	
合計		20,170,000,000	18,025,929,000	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【分散投資コア戦略ファンドA】

## 【純資産額計算書】

(2021年 7月30日現在)

資産総額	80,899,766,795円
負債総額	138,983,084円
純資産総額（ - ）	80,760,783,711円
発行済口数	71,710,971,743口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1262円
（1万口当たり純資産額）	（11,262円）

## 【分散投資コア戦略ファンドS】

## 【純資産額計算書】

(2021年 7月30日現在)

資産総額	172,470,459,599円
負債総額	215,800,263円
純資産総額（ - ）	172,254,659,336円
発行済口数	137,232,646,590口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2552円
（1万口当たり純資産額）	（12,552円）

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	464,224,984,794円
負債総額	1,364,308,081円
純資産総額（ - ）	462,860,676,713円
発行済口数	252,090,254,402口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8361円
（1万口当たり純資産額）	（18,361円）

## 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	4,586,919,275円
負債総額	3,168,506円
純資産総額（ - ）	4,583,750,769円
発行済口数	4,074,360,095口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1250円
（1万口当たり純資産額）	（11,250円）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	648,172,298,040円
負債総額	6,080,642,616円
純資産総額（ - ）	642,091,655,424円
発行済口数	453,444,066,244口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4160円
（1万口当たり純資産額）	（14,160円）

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	539,353,356,044円
負債総額	527,976,732円
純資産総額（ - ）	538,825,379,312円
発行済口数	137,922,426,477口
1口当たり純資産額（ / ）	3.9067円
（1万口当たり純資産額）	（39,067円）

## 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

資産総額	20,172,981,203円
負債総額	6,958,771円
純資産総額（ - ）	20,166,022,432円
発行済口数	13,765,562,898口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4650円
（1万口当たり純資産額）	（14,650円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

資産総額	313,126,284,146円
負債総額	9,399,803,770円
純資産総額（ - ）	303,726,480,376円
発行済口数	98,391,992,936口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0869円
（1万口当たり純資産額）	（30,869円）

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

資産総額	102,865,255,615円
負債総額	5,200,775,570円
純資産総額（ - ）	97,664,480,045円
発行済口数	26,885,488,825口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6326円
（1万口当たり純資産額）	（36,326円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

資産総額	74,304,365,110円
負債総額	5,944,645円
純資産総額（ - ）	74,298,420,465円

発行済口数	42,138,983,496口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7632円
（1万口当たり純資産額）	（17,632円）

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

資産総額	112,733,555,223円
負債総額	3,503,814,323円
純資産総額（ - ）	109,229,740,900円
発行済口数	47,994,232,137口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2759円
（1万口当たり純資産額）	（22,759円）

## グローバル R E I T インデックス マザーファンド

### 純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

資産総額	94,990,226,122円
負債総額	17,445,449円
純資産総額（ - ）	94,972,780,673円
発行済口数	41,566,618,257口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2848円
（1万口当たり純資産額）	（22,848円）

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

資産総額	36,899,784,182円
負債総額	37,098,393円
純資産総額（ - ）	36,862,685,789円
発行済口数	28,836,846,033口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2783円
（1万口当たり純資産額）	（12,783円）



## 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	19,245,694,429円
負債総額	222,075,747円
純資産総額（ - ）	19,023,618,682円
発行済口数	21,380,416,911口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8898円
（1万口当たり純資産額）	（8,898円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

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

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

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2021年 7月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2021年10月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年7月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	530	14,468,851
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	77	287,195
単位型公社債投資信託	49	314,283
合計	656	15,070,328

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 百万円 )

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

( 単位 : 百万円 )

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

## (2) 【損益計算書】

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

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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



	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

### 7．ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

効性を判定しております。

#### 8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

#### 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

#### 10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

## 注記事項

### （貸借対照表関係）

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		百万円		百万円
建物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	〃	391	〃
その他	4	〃	4	〃
計	367	〃	503	〃

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

#### 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	21,589	21,589	-
(2) 金銭の信託	10,857	10,857	-
(3) 未収委託者報酬	8,471	8,471	-
(4) 未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 投資有価証券 その他有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:百万円)

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-

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

## （有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連



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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	-	315	315
	合計	13,711	-	315	315

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 2. 確定給付制度

##### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

##### (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

#### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44百万円、当事業年度92百万円であります。

#### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## （資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

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

## [関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
-------	------

三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年10月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

分散投資コア戦略ファンドSの募集・販売等の取扱いを行います。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年10月 9日	有価証券届出書
2020年10月 9日	有価証券報告書
2021年 4月 9日	有価証券届出書
2021年 4月 9日	半期報告書

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ



て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2020年7月11日から2021年7月12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、分散投資コア戦略ファンドAの2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2020年7月11日から2021年7月12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、分散投資コア戦略ファンドSの2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。