

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	世界経済インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

世界経済インデックスファンド

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料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「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「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。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。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「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース)で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7)【申込期間】

2021年10月21日から2022年4月20日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9)【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

<振替受益権について>

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎても

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、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。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

 DR(預託証券)とは

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

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

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。



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。

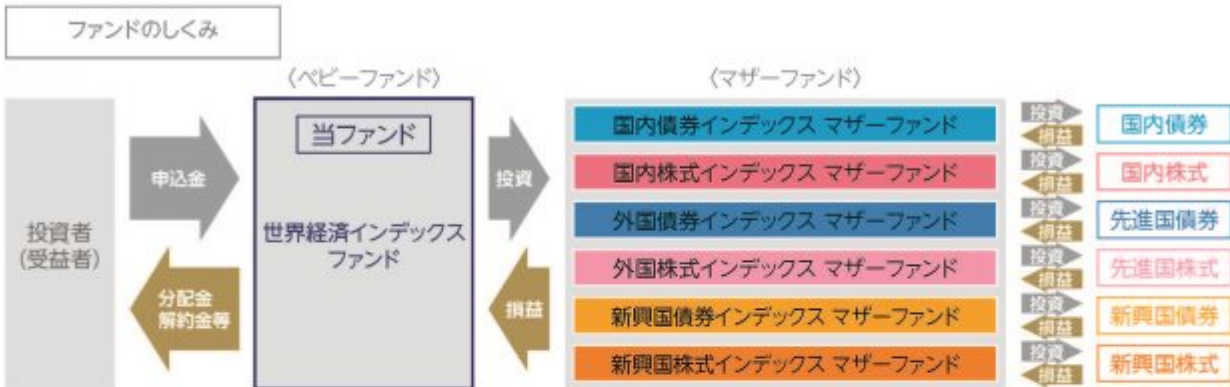
[ 特殊型 ]

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

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



### ? ファミリーファンド方式とは

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

## 2. 世界経済全体の発展を享受します。

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

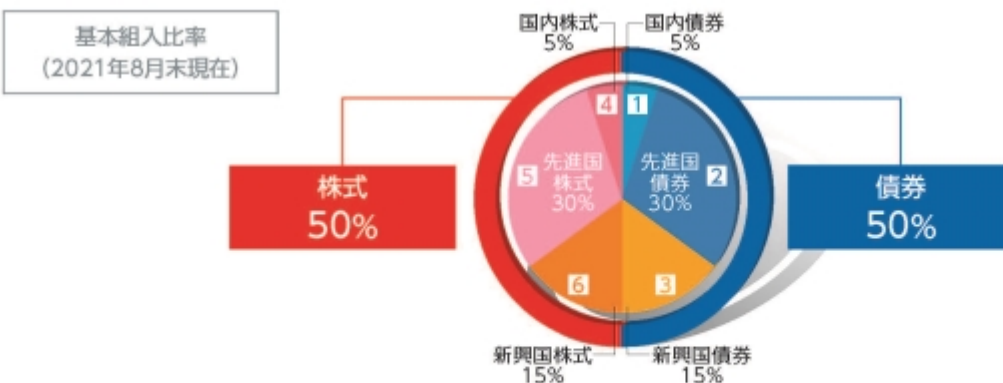


（出所）IMF「世界経済見通し2020年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

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

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

※上記のファンドの地域別構成比は、2021年8月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



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

資産	インデックス
----	--------

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

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

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

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

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

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

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

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

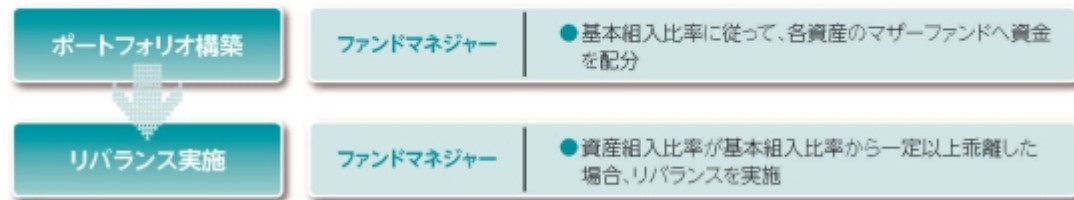
6 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株

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

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・グロース)」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」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。

### ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 分配方針

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

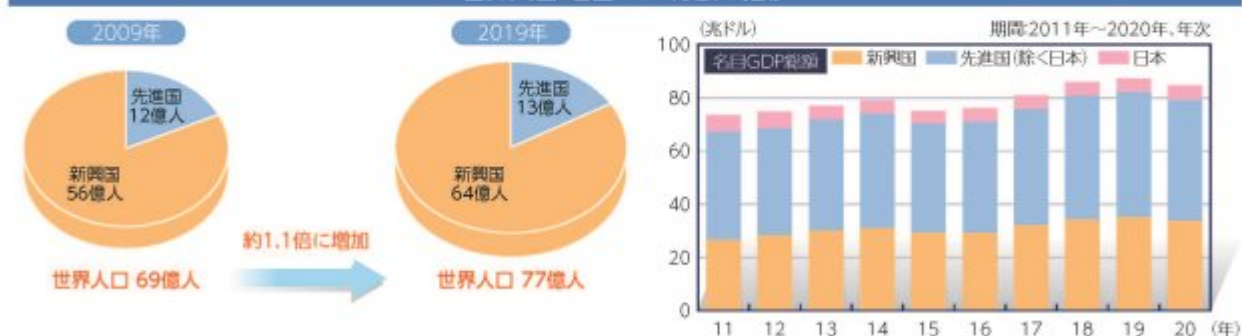
## 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

## 〈ご参考情報〉

## 世界人口・名目GDP総額の推移



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

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

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

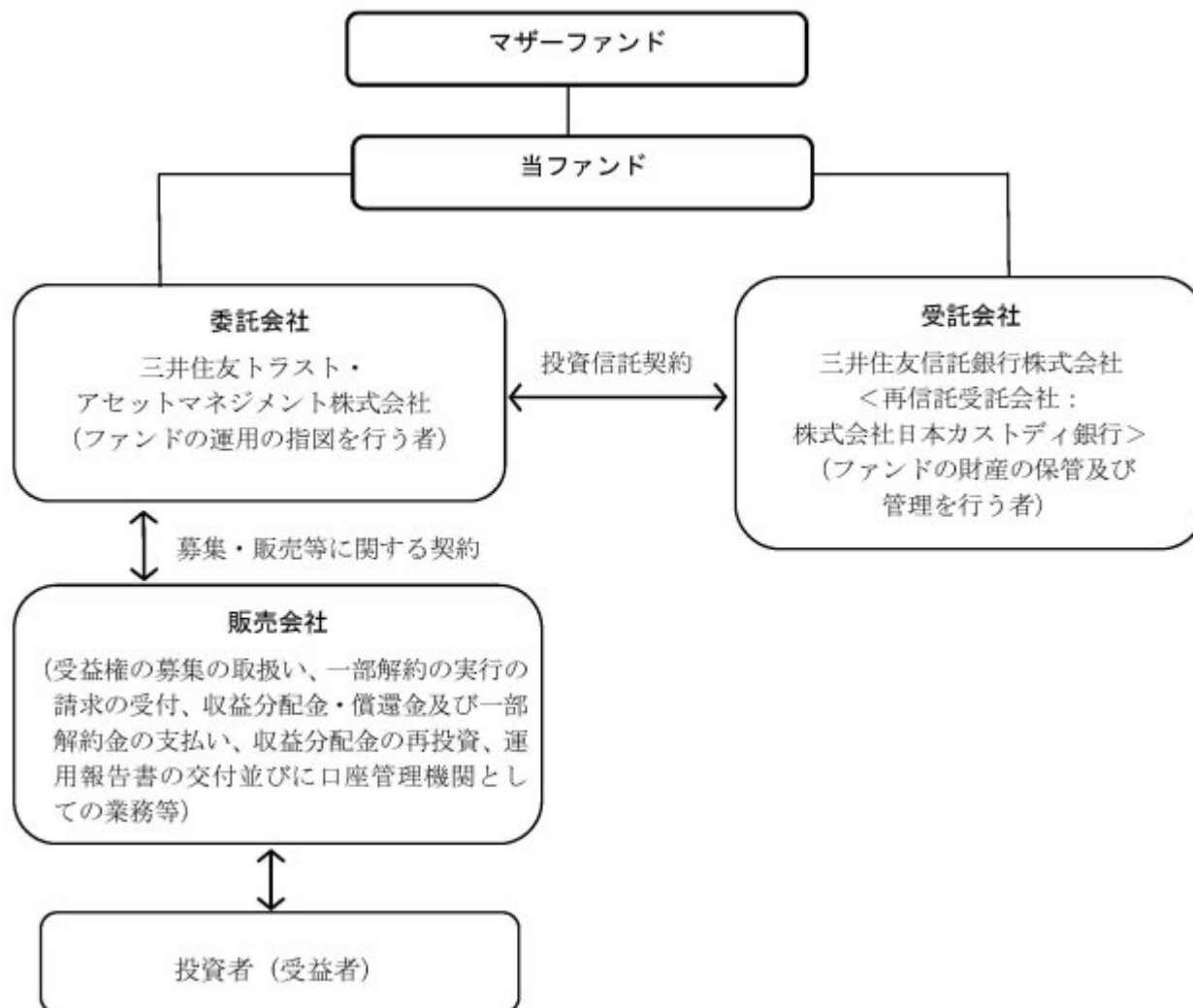
※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

2009年 1月16日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年 4月 1日	当ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国債券インデックス マザーファンド」の名称を「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の名称を「新興国株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

## (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 8月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

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

#### ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

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

### 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券））を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。
- ロ．株式（DR（預託証券））を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。
- ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- ヘ．投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（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および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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。
- ト．ただし、資金動向及び市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定め



るものをいいます。以下同じ。）

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

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる1.から6.までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに7.から28.までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

23. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
25. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
26. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
28. 外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

###### 1. 基本方針

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

###### 2. 運用方法

###### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

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

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

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

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

行うことができます。

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

は、上記の運用ができない場合があります。

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

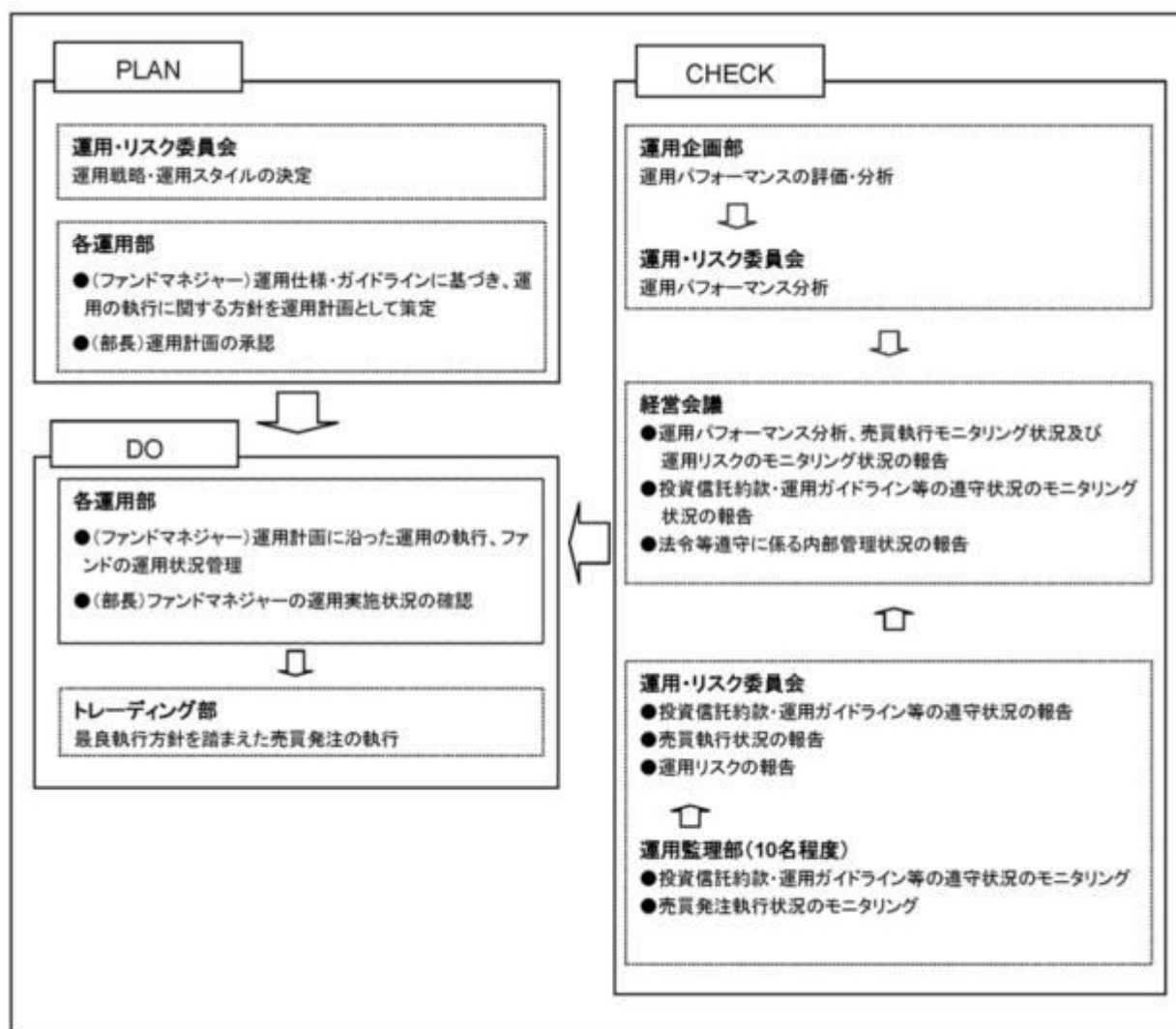
投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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



に係る業務規則を定めています。

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

#### （４）【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

- イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ニ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

- へ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。
- ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。
- リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ヌ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済

については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- ル．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ヲ．委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ワ．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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- カ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- コ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

- イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

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。

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

#### 信用リスク

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

#### カントリーリスク

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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

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

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

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

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

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

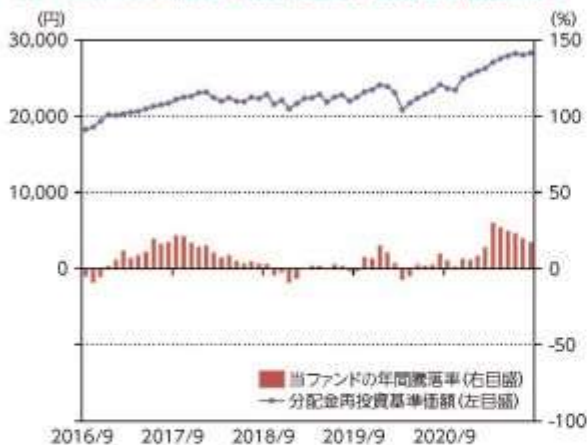
## (2) リスクの管理体制

## 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

## 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*2016年9月～2021年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内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、算出、算出値の公表、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、ファンドの約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.が算出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.が算出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債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により算出されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JP Eilon Global Bond Index マーケットグローバル・ディバーシファイド円ベース	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

##### (照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

##### (2)【換金（解約）手数料】

###### <解約手数料>

ありません。

###### <信託財産留保額>

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

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

##### (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 0.55%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.22% (税抜 0.2%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
------	-----------------------	------------------------------

販売会社	年率 0.275% (税抜 0.25%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

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

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込  
手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たりま  
す。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行  
うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異な  
る場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当  
該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配  
金）について」をご参照ください。）

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、



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

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

上記は、2021年 8月31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8月31日現在の状況について記載してあります。

### 【世界経済インデックスファンド】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	110,042,032,899	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,060,628,895	0.95
合計(純資産総額)		111,102,661,794	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	8,870,180,221	3.2697	29,003,390,984	4.0031	35,508,218,442	31.96
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	10,629,044,310	2.9969	31,854,314,395	3.0875	32,817,174,307	29.54
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	4,482,537,937	3.6411	16,321,724,045	3.6267	16,256,820,336	14.63
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	8,894,308,140	1.7328	15,412,579,603	1.7712	15,753,598,577	14.18
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	3,035,772,559	1.7857	5,421,032,739	1.8942	5,750,360,381	5.18
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	2,795,858,970	1.4082	3,937,139,703	1.4149	3,955,860,856	3.56

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
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3期計算期間末 (2012年 1月20日)	1,737,011,301	1,737,011,301	12,000	12,000
第4期計算期間末 (2013年 1月21日)	2,751,494,290	2,755,095,142	15,282	15,302
第5期計算期間末 (2014年 1月20日)	4,684,090,831	4,689,249,062	18,162	18,182
第6期計算期間末 (2015年 1月20日)	10,344,646,326	10,354,724,017	20,530	20,550
第7期計算期間末 (2016年 1月20日)	16,216,119,873	16,216,119,873	18,276	18,276
第8期計算期間末 (2017年 1月20日)	22,647,406,597	22,647,406,597	20,148	20,148
第9期計算期間末 (2018年 1月22日)	54,410,632,155	54,410,632,155	23,375	23,375
第10期計算期間末 (2019年 1月21日)	58,898,515,081	58,898,515,081	21,463	21,463
第11期計算期間末 (2020年 1月20日)	68,600,065,515	68,600,065,515	24,407	24,407
第12期計算期間末 (2021年 1月20日)	82,775,453,215	82,775,453,215	25,904	25,904
2020年 8月末日	73,794,656,432		24,074	
9月末日	73,214,775,731		23,562	
10月末日	73,325,412,980		23,343	
11月末日	77,948,295,406		24,856	
12月末日	80,297,372,486		25,368	
2021年 1月末日	82,868,066,654		25,811	
2月末日	84,790,141,595		26,188	
3月末日	90,279,987,589		26,977	
4月末日	94,158,621,846		27,474	
5月末日	97,951,743,086		27,822	

6月末日	102,454,387,413		28,127	
7月末日	105,441,978,290		27,931	
8月末日	111,102,661,794		28,193	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2011年 1月21日～2012年 1月20日	0
第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	20
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	20
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	20
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0
第10期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	0
第11期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	0
第12期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2011年 1月21日～2012年 1月20日	7.5
第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	27.5
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	19.0
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	13.1
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	11.0
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	10.2
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	16.0
第10期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	8.2
第11期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	13.7
第12期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	6.1
第13期中間計算期間	2021年 1月21日～2021年 7月20日	6.4

(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3期計算期間	2011年 1月21日～2012年 1月20日	911,791,372	252,161,321	1,447,503,755

第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	907,508,119	554,585,762	1,800,426,112
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	1,918,803,387	1,140,113,813	2,579,115,686
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	3,411,351,368	951,621,550	5,038,845,504
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	5,409,151,344	1,574,902,402	8,873,094,446
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	4,258,831,911	1,891,370,889	11,240,555,468
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	30,368,454,269	18,331,594,089	23,277,415,648
第10期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	11,121,535,048	6,956,801,315	27,442,149,381
第11期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	8,633,804,962	7,968,996,991	28,106,957,352
第12期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	10,639,014,321	6,790,775,126	31,955,196,547
第13期中間計算期間	2021年 1月21日～2021年 7月20日	8,184,439,049	2,896,900,416	37,242,735,180

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

(参考)

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	555,576,971,400	83.61
地方債証券	日本	36,796,668,324	5.54
特殊債券	日本	40,465,156,392	6.09
社債券	日本	28,138,791,400	4.23
	フランス	1,101,426,000	0.17
	オーストラリア	400,284,000	0.06
	小計	29,640,501,400	4.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,985,458,249	0.30
合計(純資産総額)		664,464,755,765	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	100.93	8,317,126,400	0.100	2025/9/20	1.25
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	101.38	7,938,445,500	0.100	2028/3/20	1.19

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	100.70	7,804,560,000	0.100	2024/9/20	1.17
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,880,000,000	100.60	6,921,280,000	100.54	6,917,289,600	0.100	2023/12/20	1.04
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	100.48	6,792,650,800	0.100	2023/9/20	1.02
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	101.11	6,714,235,200	0.100	2026/9/20	1.01
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	102.15	6,456,385,600	0.400	2025/9/20	0.97
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	101.22	6,427,978,000	0.100	2027/3/20	0.97
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,310,000,000	100.91	6,367,421,000	100.87	6,365,401,800	0.100	2025/6/20	0.96
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	100.66	6,341,580,000	0.100	2024/6/20	0.95
日本	国債証券	第427回利付国債(2年)	5,990,000,000	100.26	6,006,097,900	100.26	6,006,053,200	0.005	2023/8/1	0.90
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	101.17	5,807,674,600	0.100	2030/9/20	0.87
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	5,690,000,000	100.66	5,727,554,000	100.60	5,724,140,000	0.100	2024/3/20	0.86
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	100.29	5,717,043,000	0.100	2022/12/20	0.86
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	5,640,000,000	100.61	5,674,443,700	100.60	5,674,009,200	0.005	2026/6/20	0.85
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,450,000,000	100.54	5,479,970,900	100.59	5,482,373,000	0.005	2026/3/20	0.83
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	100.76	5,420,995,600	0.100	2024/12/20	0.82
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	5,260,000,000	100.90	5,307,718,000	101.41	5,334,534,200	0.100	2029/9/20	0.80
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	101.02	5,273,713,800	0.100	2026/3/20	0.79
日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	5,190,000,000	101.34	5,260,064,100	101.20	5,252,539,500	0.800	2022/12/20	0.79
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	5,150,000,000	100.95	5,199,383,100	101.45	5,224,778,000	0.100	2029/6/20	0.79
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	5,090,000,000	100.95	5,138,452,200	101.48	5,165,433,800	0.100	2029/3/20	0.78
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	101.34	5,158,256,900	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	5,010,000,000	101.05	5,062,991,900	101.45	5,082,945,600	0.100	2028/9/20	0.76
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	101.02	4,970,380,800	0.100	2030/12/20	0.75
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	102.06	4,960,359,000	0.600	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	100.31	4,865,244,200	100.90	4,893,941,000	0.100	2031/3/20	0.74
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	101.68	4,880,880,000	0.600	2023/12/20	0.73
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	101.08	4,872,345,200	0.100	2026/6/20	0.73
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	102.02	4,846,092,500	0.400	2025/6/20	0.73

(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	83.61
地方債証券	5.54
特殊債券	6.09
社債券	4.46
合計	99.70

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	476,236,932,620	99.27
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,484,540,222	0.73
合計（純資産総額）		479,721,472,842	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	3,280,715,000	0.68

(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	1,795,100	9,134.75	16,397,796,977	9,592.00	17,218,599,200	3.59
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,110,000	10,790.97	11,977,978,712	11,360.00	12,609,600,000	2.63
日本	株式	キーエンス	電気機器	173,900	54,031.40	9,396,062,016	66,130.00	11,500,007,000	2.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,379,700	8,223.42	11,345,864,610	6,181.00	8,527,925,700	1.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,213,000	5,560.39	6,744,764,550	6,500.00	7,884,500,000	1.64
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,955,100	619.33	7,404,246,794	594.40	7,106,111,440	1.48
日本	株式	ダイキン工業	機械	225,800	21,648.34	4,888,197,364	27,405.00	6,188,049,000	1.29
日本	株式	HOYA	精密機器	345,800	14,392.68	4,976,989,104	17,780.00	6,148,324,000	1.28
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,033,800	2,929.82	5,958,687,025	2,936.00	5,971,236,800	1.24
日本	株式	信越化学工業	化学	320,900	18,834.99	6,044,151,175	18,205.00	5,841,984,500	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,474,200	3,718.44	5,481,731,587	3,679.00	5,423,581,800	1.13
日本	株式	日本電産	電気機器	426,500	12,536.45	5,346,798,565	12,620.00	5,382,430,000	1.12
日本	株式	任天堂	その他製品	101,400	67,456.49	6,840,088,239	52,900.00	5,364,060,000	1.12
日本	株式	日立製作所	電気機器	851,900	5,752.88	4,900,886,490	6,085.00	5,183,811,500	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	103,800	48,605.05	5,045,204,250	47,240.00	4,903,512,000	1.02
日本	株式	村田製作所	電気機器	520,600	8,293.50	4,317,597,792	9,119.00	4,747,351,400	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,394,500	3,708.10	5,170,948,127	3,370.00	4,699,465,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,395,100	3,358.19	4,685,011,890	3,342.00	4,662,424,200	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,209,400	3,947.04	4,773,554,268	3,801.00	4,596,929,400	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,220,700	3,249.74	3,966,963,119	3,311.00	4,041,737,700	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	155,500	26,283.61	4,087,102,488	23,990.00	3,730,445,000	0.78
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,374,800	1,670.42	3,966,924,372	1,543.00	3,664,316,400	0.76
日本	株式	S M C	機械	51,900	65,569.29	3,403,046,416	70,510.00	3,659,469,000	0.76
日本	株式	第一三共	医薬品	1,392,500	2,524.88	3,515,905,625	2,614.50	3,640,691,250	0.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,062,600	2,988.42	3,175,504,878	3,311.00	3,518,268,600	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,200	2,417.39	3,365,501,504	2,429.00	3,381,653,800	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	682,800	4,746.14	3,240,670,752	4,815.00	3,287,682,000	0.69
日本	株式	富士通	電気機器	159,400	17,851.70	2,845,561,674	20,300.00	3,235,820,000	0.67
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	575,600	5,180.54	2,981,919,910	5,377.00	3,095,001,200	0.65
日本	株式	デンソー	輸送用機器	390,100	7,506.35	2,928,228,080	7,710.00	3,007,671,000	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	0.18

建設業	2.27	
食料品	3.41	
繊維製品	0.48	
パルプ・紙	0.23	
化学	7.06	
医薬品	5.20	
石油・石炭製品	0.39	
ゴム製品	0.70	
ガラス・土石製品	0.78	
鉄鋼	0.89	
非鉄金属	0.69	
金属製品	0.62	
機械	5.59	
電気機器	18.23	
輸送用機器	7.70	
精密機器	2.98	
その他製品	2.20	
電気・ガス業	1.17	
陸運業	3.19	
海運業	0.52	
空運業	0.45	
倉庫・運輸関連業	0.18	
情報・通信業	8.37	
卸売業	4.81	
小売業	4.40	
銀行業	4.87	
証券、商品先物取引業	0.73	
保険業	1.91	
その他金融業	1.13	
不動産業	1.95	
サービス業	5.90	
	小計	99.27
合計		99.27

(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	167円		3,215,325,650	3,280,715,000	0.68

(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	131,700,668,414	44.04
	フランス	29,876,654,672	9.99
	イタリア	27,900,931,630	9.33
	ドイツ	21,749,783,490	7.27
	イギリス	18,552,624,251	6.20
	スペイン	17,407,448,866	5.82
	ベルギー	7,021,970,725	2.35
	カナダ	5,855,409,771	1.96
	オーストラリア	5,560,532,463	1.86
	オランダ	5,535,262,406	1.85
	オーストリア	4,377,432,262	1.46
	アイルランド	2,427,399,015	0.81
	メキシコ	2,085,033,179	0.70
	フィンランド	1,807,454,099	0.60
	ポーランド	1,697,196,962	0.57
	デンマーク	1,485,813,709	0.50
	マレーシア	1,414,154,662	0.47
	イスラエル	1,380,603,671	0.46
	シンガポール	1,293,919,713	0.43
	スウェーデン	858,155,093	0.29
ノルウェー	715,916,207	0.24	
	小計	290,704,365,260	97.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,339,143,306	2.79
合計(純資産総額)		299,043,508,566	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	2,528,375,694	0.85
	買建	ドイツ	3,245,043,522	1.09

(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		5,718,915,950	1.91

(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	10,133.98	1,616,370,143	10,432.77	1,664,027,247	0.625	2030/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,548.68	1,587,576,762	10,870.65	1,636,033,656	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,175.19	1,434,702,436	10,461.10	1,475,015,981	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	10,991.71	1,428,923,234	10,975.83	1,426,858,320	0.250	2024/3/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,569.88	1,244,085,172	10,230.14	1,329,918,796	1.375	2040/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	10,869.79	1,250,026,641	10,894.69	1,252,890,057	0.500	2026/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	10,987.85	1,208,663,889	11,009.31	1,211,025,016	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,633.94	1,188,989,211	11,665.71	1,192,235,903	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,341.76	1,153,106,437	10,645.70	1,186,995,991	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,685.89	1,186,117,855	11,626.21	1,180,061,129	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/50	11,300,000	9,687.91	1,094,734,356	10,304.84	1,164,447,167	1.625	2050/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,285.57	1,128,557,088	11,233.62	1,123,362,599	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,015.32	1,118,055,847	11,008.88	1,117,402,240	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,179.31	1,117,931,989	11,139.82	1,113,982,458	1.500	2022/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	10,931.74	1,093,174,750	10,962.09	1,096,209,573	0.250	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	10,961.23	1,096,123,709	10,951.36	1,095,136,334	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,836.74	1,083,674,104	10,843.60	1,084,360,979	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	9,900,000	10,051.55	995,104,150	10,931.61	1,082,229,947	1.875	2051/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	9,470,000	11,170.53	1,057,849,366	11,358.33	1,075,634,492	1.625	2031/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,615.65	1,061,565,312	10,754.74	1,075,474,531	0.625	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,190.26	1,063,075,368	11,152.05	1,059,445,655	1.500	2022/9/15	0.35

アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,781.19	1,054,416,878	11,821.97	1,058,066,977	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,411.83	1,042,593,825	12,559.50	1,054,998,787	3.125	2028/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000	22,380.60	1,011,603,269	23,137.21	1,045,802,107	4.500	2041/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	15,883.39	1,013,360,517	16,137.06	1,029,544,895	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,770.46	1,006,374,481	11,848.16	1,013,018,062	2.250	2027/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,535.80	1,000,901,376	10,658.15	1,012,524,586	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,417.15	1,002,425,806	11,454.92	1,005,742,725	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,221.17	1,009,905,877	11,172.02	1,005,481,969	1.875	2022/7/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,498.47	984,153,083	15,475.64	982,703,668	3.500	2026/4/25	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	97.21
合計	97.21

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

## 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	67	アメリカドル	8,264,671.97	908,287,449	8,289,679.52	911,035,779	0.30
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	49	アメリカドル	6,518,215.57	716,351,891	6,543,031.25	719,079,134	0.24
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	50	アメリカドル	8,127,640	893,227,636	8,173,437.5	898,260,781	0.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	34	ユーロ	3,819,106.4	495,299,908	3,818,540	495,226,452	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	46	ユーロ	6,219,996.6	806,671,359	6,219,200	806,568,048	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	85	ユーロ	14,993,948.5	1,944,565,181	14,983,800	1,943,249,022	0.65

(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	24,160,000.00	2,657,644,759	2,654,700,800	0.89
	カナダドル	買建	2,810,000.00	245,905,176	244,835,300	0.08
	ユーロ	買建	18,670,000.00	2,413,623,810	2,421,592,350	0.81
	イギリスポンド	買建	2,630,000.00	399,868,851	397,787,500	0.13

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	357,433,123,055	66.57
	イギリス	22,062,221,977	4.11
	カナダ	18,212,914,827	3.39
	スイス	17,774,336,754	3.31
	フランス	16,828,210,317	3.13
	ドイツ	14,922,078,316	2.78
	オランダ	10,904,098,554	2.03
	オーストラリア	9,952,007,092	1.85
	アイルランド	9,920,496,792	1.85
	スウェーデン	5,789,988,320	1.08
	デンマーク	4,426,130,750	0.82
	スペイン	3,980,260,142	0.74
	香港	3,633,518,768	0.68
	イタリア	3,013,281,886	0.56
	フィンランド	2,157,973,261	0.40
	ジャージー	1,632,149,271	0.30
	シンガポール	1,488,933,809	0.28
	ベルギー	1,332,278,934	0.25
	バミューダ	1,235,011,823	0.23
	イスラエル	1,028,042,154	0.19
	ノルウェー	1,023,723,690	0.19
	ケイマン	859,655,493	0.16
	ニュージーランド	556,510,280	0.10
	ルクセンブルク	543,286,758	0.10
キュラソー	362,750,060	0.07	
オーストリア	325,217,654	0.06	

	ポルトガル	248,412,696	0.05
	パナマ	183,135,997	0.03
	リベリア	173,397,432	0.03
	マン島	143,356,287	0.03
	パプアニューギニア	55,960,729	0.01
	小計	512,202,463,878	95.40
投資信託受益証券	オーストラリア	226,330,679	0.04
	香港	79,489,813	0.01
	小計	305,820,492	0.06
投資証券	アメリカ	9,998,930,151	1.86
	オーストラリア	702,814,575	0.13
	イギリス	342,979,671	0.06
	フランス	276,056,073	0.05
	シンガポール	227,509,911	0.04
	香港	173,094,072	0.03
	カナダ	77,841,410	0.01
	小計	11,799,225,863	2.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,597,501,434	2.35
合計(純資産総額)		536,905,011,667	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,051,214,536	1.69
	買建	カナダ	665,794,626	0.12
	買建	ドイツ	1,663,338,415	0.31
	買建	イギリス	453,247,275	0.08
	買建	オーストラリア	387,906,831	0.07

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		548,535,240	0.10
	売建		189,023,356	0.04

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,420,191	13,694.63	19,449,003,056	16,827.88	23,898,815,087	4.45
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	606,107	27,439.83	16,631,474,254	33,364.54	20,222,481,852	3.77
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,205	354,215.39	12,824,368,303	376,030.54	13,614,185,809	2.54
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	203,410	36,127.42	7,348,679,926	41,834.53	8,509,562,561	1.58
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,430	259,017.81	6,586,823,035	317,809.91	8,081,906,240	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	24,928	265,030.44	6,606,678,908	319,741.96	7,970,527,604	1.48
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	209,265	17,852.15	3,735,831,426	24,934.11	5,217,836,948	0.97
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	64,902	68,711.67	4,459,525,325	80,327.00	5,213,383,538	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	257,893	18,049.97	4,654,962,461	17,632.35	4,547,261,186	0.85
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	222,152	18,600.57	4,132,154,938	19,085.23	4,239,822,904	0.79
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	80,170	45,270.00	3,629,296,541	45,971.17	3,685,508,699	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	143,326	24,980.26	3,580,322,178	25,412.17	3,642,225,681	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	115,834	31,809.45	3,684,616,526	31,394.03	3,636,496,534	0.68
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	243,137	13,323.28	3,239,384,275	14,025.90	3,410,215,735	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	90,952	35,048.20	3,187,704,705	35,948.28	3,269,568,872	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	208,024	14,820.01	3,082,918,800	15,708.00	3,267,642,448	0.61
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	35,340	71,627.78	2,531,325,992	92,028.02	3,252,270,368	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	153,336	19,633.63	3,010,543,056	19,779.80	3,032,955,719	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	656,214	4,658.66	3,057,078,570	4,578.43	3,004,432,489	0.56

アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフト ウェア・ サービス	93,989	28,576.19	2,685,848,274	31,702.85	2,979,719,451	0.55
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフト ウェア・ サービス	40,430	55,453.34	2,241,978,617	73,192.30	2,959,164,729	0.55
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフト ウェア・ サービス	74,900	39,627.74	2,968,117,875	38,800.19	2,906,134,605	0.54
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	59,238	37,840.44	2,241,591,985	43,859.42	2,598,144,322	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディ ア・娯楽	385,983	6,301.66	2,432,335,948	6,562.12	2,532,870,238	0.47
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	470,870	4,256.42	2,004,223,782	5,138.92	2,419,765,144	0.45
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフト ウェア・ サービス	82,450	26,100.20	2,151,961,609	29,120.20	2,400,960,737	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディ ア・娯楽	37,386	55,258.81	2,065,906,207	62,223.18	2,326,275,882	0.43
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	356,369	5,813.71	2,071,826,019	6,498.38	2,315,823,677	0.43
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネル ギー	357,409	6,414.86	2,292,729,770	6,062.08	2,166,643,380	0.40
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバ コ	345,573	6,076.37	2,099,829,755	6,174.18	2,133,630,596	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.88
		素材	4.20
		資本財	6.29
		商業・専門サービス	1.23
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	1.86
		耐久消費財・アパレル	1.90
		消費者サービス	1.74
		メディア・娯楽	7.51
		小売	5.41
		食品・生活必需品小売り	1.38
		食品・飲料・タバコ	3.68
		家庭用品・パーソナル用品	1.66

	ヘルスケア機器・サービス	5.07
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.58
	銀行	5.74
	各種金融	4.66
	保険	2.97
	不動産	0.45
	ソフトウェア・サービス	12.28
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.99
	電気通信サービス	1.58
	公益事業	2.82
	半導体・半導体製造装置	4.66
	小計	95.40
投資信託受益証券		0.06
投資証券		2.20
合計		97.65

(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	364	アメリカドル	78,617,365.5	8,640,048,468	82,358,640	9,051,214,536	1.69
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	31	カナダドル	7,483,319.5	652,171,294	7,639,640	665,794,626	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	40	スイスフラン	4,826,150	578,655,385	4,972,800	596,238,720	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	196	ユーロ	8,005,092	1,038,180,381	8,228,080	1,067,099,695	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	26	オーストラリアドル	4,731,207	379,348,177	4,837,950	387,906,831	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	42	イギリスポンド	2,944,247.5	445,376,319	2,996,280	453,247,275	0.08

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

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



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	438,920,000	439,594,800	0.08
	ユーロ	買建	840,000.00	108,792,600	108,940,440	0.02
	アメリカドル	売建	1,720,000.00	189,010,800	189,023,356	0.04

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

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

## 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	7,581,059,238	9.93
	インドネシア	7,481,311,044	9.80
	メキシコ	6,823,900,785	8.94
	タイ	6,586,801,757	8.62
	ポーランド	6,506,486,766	8.52
	ブラジル	6,236,890,963	8.17
	マレーシア	5,863,692,444	7.68
	南アフリカ	5,810,088,355	7.61
	ロシア	5,579,614,806	7.31
	コロンビア	3,413,444,644	4.47
	チェコ	3,201,342,674	4.19
	ハンガリー	2,983,320,118	3.91
	チリ	1,604,190,297	2.10
	ペルー	1,462,825,948	1.92
	トルコ	1,438,631,924	1.88
	フィリピン	112,773,204	0.15
	ウルグアイ	99,345,061	0.13
ドミニカ共和国	98,835,001	0.13	
	小計	72,884,555,029	95.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,486,052,647	4.56
合計(純資産総額)		76,370,607,676	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	3.72	2,693,134,985	3.41	2,469,789,916	9.850	2027/6/28	3.23
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	1,773.16	1,633,083,363	1,727.26	1,590,808,550	0.000	2024/1/1	2.08
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	123,900,000	882.16	1,093,004,456	853.11	1,057,004,529	10.500	2026/12/21	1.38
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	47,550,000	2,289.04	1,088,439,412	2,155.99	1,025,177,333	10.000	2023/1/1	1.34
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,833.80	938,910,313	1,812.86	928,188,339	0.000	2023/7/1	1.22
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000	2,904.29	791,420,670	2,776.61	756,626,711	3.885	2029/8/15	0.99
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	103,700,000	714.47	740,908,711	715.84	742,335,683	8.000	2030/1/31	0.97
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	3,112.76	750,176,262	3,029.80	730,183,242	2.500	2026/7/25	0.96
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,823.53	734,117,881	2,785.31	724,181,400	3.955	2025/9/15	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	136,300,000	554.24	755,442,591	530.32	722,832,382	5.750	2026/3/5	0.95
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000	414.17	740,129,942	392.30	701,041,833	3.300	2038/6/17	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000	646.72	756,020,909	597.74	698,768,330	8.500	2029/5/31	0.91
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,398.80	762,818,945	2,153.85	684,925,876	10.000	2025/1/1	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	21,550,000	3,199.18	689,424,452	3,113.29	670,915,254	2.750	2029/10/25	0.88
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000	2,408.94	756,410,153	2,132.89	669,729,148	10.000	2027/1/1	0.88
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	22,600,000,000	2.98	675,329,507	2.81	635,429,838	7.250	2034/10/18	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	97,100,000	608.37	590,735,181	644.61	625,925,398	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	2,748.63	628,061,982	2,710.75	619,407,977	3.480	2023/3/15	0.81
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	607.80	660,380,859	567.27	616,347,563	7.500	2027/6/3	0.81
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	649.61	651,237,133	607.97	609,494,766	10.000	2024/12/5	0.80
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,998.21	596,644,372	2,934.71	584,008,085	2.500	2023/1/25	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 04/25/28	18,800,000	3,196.64	600,969,612	3,103.51	583,460,566	2.750	2028/4/25	0.76
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000	563.74	584,600,462	550.83	571,217,633	6.500	2022/6/9	0.75
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.5% 06/15/25	70,100,000,000	0.80	566,434,815	0.81	570,515,299	6.500	2025/6/15	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	599.20	586,916,688	571.92	560,202,700	8.000	2023/12/7	0.73
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	80,700,000	676.77	546,158,917	691.04	557,677,245	8.250	2032/3/31	0.73
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000	3,045.44	546,657,038	2,988.65	536,464,151	2.250	2024/10/25	0.70
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,658.41	505,815,662	1,701.61	518,992,171	2.850	2027/6/4	0.68
メキシコ	国債証券	MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000	570.31	528,109,670	556.09	514,940,798	6.750	2023/3/9	0.67
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000	418.52	540,737,997	396.89	512,783,211	3.400	2036/6/17	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	95.44
合計	95.44

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	19,347,592,474	19.50
	台湾	13,588,123,490	13.69
	韓国	12,046,772,843	12.14
	インド	10,977,388,396	11.06
	中国	10,625,134,472	10.71
	ブラジル	4,537,757,190	4.57
	サウジアラビア	3,010,981,823	3.03
	南アフリカ	2,846,869,476	2.87
	ロシア	2,750,082,411	2.77
	メキシコ	1,773,909,980	1.79
	タイ	1,594,907,646	1.61
	マレーシア	1,272,262,169	1.28
	インドネシア	1,177,759,900	1.19
	香港	1,076,012,252	1.08
	アラブ首長国連邦	750,228,041	0.76
	ポーランド	655,604,621	0.66
	カタール	645,451,317	0.65
	フィリピン	611,375,429	0.62
	バミューダ	576,862,492	0.58
	クウェート	563,124,485	0.57
チリ	425,311,158	0.43	

	アメリカ	368,071,755	0.37
	トルコ	276,021,499	0.28
	ルクセンブルク	269,922,075	0.27
	ハンガリー	256,555,315	0.26
	オランダ	244,099,369	0.25
	ギリシャ	170,194,638	0.17
	コロンビア	143,048,405	0.14
	キプロス	139,140,661	0.14
	チェコ	100,352,297	0.10
	ジャージー	99,643,948	0.10
	エジプト	61,885,896	0.06
	マン島	47,891,869	0.05
	英ヴァージン諸島	41,378,880	0.04
	パキスタン	28,780,869	0.03
	シンガポール	19,594,980	0.02
	ペルー	14,140,613	0.01
	アルゼンチン	8,864,226	0.01
	小計	93,143,099,360	93.88
投資信託受益証券	ブラジル	219,040,287	0.22
	メキシコ	36,635,121	0.04
	小計	255,675,408	0.26
投資証券	南アフリカ	54,287,651	0.05
	メキシコ	37,343,043	0.04
	小計	91,630,694	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,729,399,678	5.77
合計(純資産総額)		99,219,805,140	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,705,140,889	5.75

(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		128,901,455	0.13

売建		320,636	0.00
----	--	---------	------

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,615,389	1,849.89	4,838,206,570	2,393.98	6,261,202,035	6.31
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	611,000	8,689.65	5,309,378,298	6,572.43	4,015,759,618	4.05
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,607,788	3,898.00	6,267,169,087	2,232.20	3,588,907,589	3.62
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	5,810.11	2,944,702,203	7,042.23	3,569,169,203	3.60
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	383,000	4,646.31	1,779,537,845	3,222.72	1,234,303,292	1.24
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	302,723	3,102.29	939,135,553	3,428.07	1,037,757,905	1.05
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	362,651	1,766.42	640,594,004	2,564.05	929,857,291	0.94
ブラジル	株式	VALE SA	素材	420,578	1,468.43	617,592,573	2,120.32	891,763,997	0.90
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,122,620	82.94	839,631,084	78.73	796,992,339	0.80
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	91,706	9,226.76	846,149,522	8,428.23	772,919,352	0.78
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	182,172	3,293.59	600,000,342	4,161.10	758,037,184	0.76
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	1,202.95	428,252,563	1,690.37	601,774,568	0.61
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	672,000	1,169.21	785,709,595	886.10	595,464,576	0.60
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	543,013	726.57	394,538,267	1,077.61	585,157,053	0.59
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	5,348.42	474,336,114	6,579.67	583,532,080	0.59
台湾	株式	MEDIA TEK INC	半導体・半導体製造装置	159,804	2,791.62	446,112,563	3,608.78	576,698,118	0.58
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	137,294	4,927.02	676,450,466	4,154.22	570,349,481	0.57
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,319,248	331.68	437,578,101	431.31	569,008,813	0.57
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	58,155	8,407.89	488,961,033	9,770.40	568,197,612	0.57
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	631,765	518.67	327,682,450	887.77	560,863,404	0.57

インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	98,522	4,164.11	410,257,315	5,588.96	550,635,813	0.55
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	13,066	29,016.24	379,126,250	40,403.19	527,908,211	0.53
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	268,967	1,374.54	369,706,430	1,937.53	521,133,514	0.53
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	370.52	520,889,106	350.63	492,920,574	0.50
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	46,519	12,739.64	592,635,328	10,438.30	485,579,371	0.49
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	28,591	15,990.70	457,190,113	16,834.48	481,314,675	0.49
韓国	株式	KAKAO CORP	メディア・娯楽	33,015	7,738.12	255,474,121	14,301.60	472,167,324	0.48
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	130,773	2,112.36	276,239,967	3,539.60	462,885,418	0.47
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	52,083.85	306,878,103	72,027.19	424,384,262	0.43
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	42,826	9,723.42	416,415,339	9,849.23	421,803,467	0.43

(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	5.01
		素材	8.49
		資本財	2.74
		商業・専門サービス	0.28
		運輸	1.64
		自動車・自動車部品	3.53
		耐久消費財・アパレル	1.69
		消費者サービス	1.05
		メディア・娯楽	7.28
		小売	7.80
		食品・生活必需品小売り	1.18
		食品・飲料・タバコ	3.20
		家庭用品・パーソナル用品	1.02
		ヘルスケア機器・サービス	1.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.39
		銀行	13.21
		各種金融	2.33
		保険	2.53
		不動産	1.61
		ソフトウェア・サービス	2.76
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.16		

		電気通信サービス	2.64
		公益事業	2.03
		半導体・半導体製造装置	9.17
		小計	93.88
投資信託受益証券			0.26
投資証券			0.09
合計			94.23

(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	811	アメリカドル	52,654,262	5,786,703,394	51,912,110	5,705,140,889	5.75

(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	1,172,911.56	128,703,051	128,901,455	0.13
	ブラジルリアル	売建	15,129.58	318,951	320,636	0.00

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2009年1月16日

作成基準日：2021年8月31日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額 28,193円

純資産総額 1,111.03億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年1月	0円
2018年1月	0円
2019年1月	0円
2020年1月	0円
2021年1月	0円
設定来 分配金合計額	60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。

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	32.0%	APPLE INC MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/IT機器	-	-	1.4%
外国債券 インデックス マザーファンド	29.5%	T 0.625% 08/15/30 T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.2%
新興国株式 インデックス マザーファンド	14.6%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC TENCENT HOLDINGS LTD	台湾 ケイマン島	株式	半導体・半導体製造装置 メディア・娯楽	-	-	0.9%
新興国債券 インデックス マザーファンド	14.2%	COLOM 9.85% 06/28/27 BLTN 0% 01/01/24	コロンビア ブラジル	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	5.2%	トヨタ自動車 ソニーグループ	日本	株式	輸送用機器 電気機器	-	-	0.2%
国内債券 インデックス マザーファンド	3.6%	第145回利付国債(5年) 第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.0%
			日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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



#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

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、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日  
ロンドンの取引所の休業日  
ニューヨークの銀行休業日  
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、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

##### イ．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。

##### ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

###### （イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

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

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

###### （ハ）公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産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。（2009年1月16日設定）

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

#### （4）【計算期間】

原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2009年1月16日から2010年1月20日までとします。

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

#### （５）【その他】

##### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

###### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が5億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

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

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

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

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

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

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

##### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

###### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

#### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示

のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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)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12期計算期間(2020年1月21日から2021年1月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【世界経済インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第11期 ( 2020年 1月20日現在 )	第12期 ( 2021年 1月20日現在 )
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	54,244
コール・ローン	1,046,736,999	1,059,406,955
親投資信託受益証券	67,872,223,896	81,864,274,672
未収入金	245,830,000	368,070,000
<b>流動資産合計</b>	<b>69,164,790,895</b>	<b>83,291,805,871</b>
<b>資産合計</b>	<b>69,164,790,895</b>	<b>83,291,805,871</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	386,687,264	304,937,633
未払受託者報酬	17,623,637	20,954,168
未払委託者報酬	158,612,680	188,587,520
未払利息	419	719
その他未払費用	1,801,380	1,872,616
<b>流動負債合計</b>	<b>564,725,380</b>	<b>516,352,656</b>
<b>負債合計</b>	<b>564,725,380</b>	<b>516,352,656</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	28,106,957,352	31,955,196,547
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	40,493,108,163	50,820,256,668
( 分配準備積立金 )	7,187,704,256	11,452,082,551
<b>元本等合計</b>	<b>68,600,065,515</b>	<b>82,775,453,215</b>
<b>純資産合計</b>	<b>68,600,065,515</b>	<b>82,775,453,215</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>69,164,790,895</b>	<b>83,291,805,871</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自 2019年 1月22日	至 2020年 1月20日	自 2020年 1月21日	至 2021年 1月20日
営業収益				
受取利息		286		6,732
有価証券売買等損益		8,674,571,935		5,760,520,776
営業収益合計		8,674,572,221		5,760,527,508
営業費用				
支払利息		461,807		433,592
受託者報酬		33,930,139		38,780,963
委託者報酬		305,371,196		349,028,649
その他費用		1,805,888		1,874,264
営業費用合計		341,569,030		390,117,468
営業利益又は営業損失（ ）		8,333,003,191		5,370,410,040
経常利益又は経常損失（ ）		8,333,003,191		5,370,410,040
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,333,003,191		5,370,410,040
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（ ）		959,703,631		333,081,542
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		31,456,365,700		40,493,108,163
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,885,931,187		14,224,128,540
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,885,931,187		14,224,128,540
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,222,488,284		9,600,471,617
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,222,488,284		9,600,471,617
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		40,493,108,163		50,820,256,668

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

	第11期 (2020年 1月20日現在)	第12期 (2021年 1月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,106,957,352口	31,955,196,547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) 2.4407円 (24,407円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5904円 (25,904円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日			第12期 自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,631,901,715円	費用控除後の配当等収益額	A	1,529,008,680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	1,790,158,391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	4,174,482,902円
収益調整金額	C	33,305,403,907円	収益調整金額	C	39,368,174,117円
分配準備積立金額	D	3,765,644,150円	分配準備積立金額	D	5,748,590,969円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	40,493,108,163円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	50,820,256,668円
当ファンドの期末残存口数	F	28,106,957,352口	当ファンドの期末残存口数	F	31,955,196,547口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,406円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	15,903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12期 自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (2021年 1月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第11期	第12期
	自 2019年 1月22日 至 2020年 1月20日	自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	27,442,149,381円	28,106,957,352円
期中追加設定元本額	8,633,804,962円	10,639,014,321円
期中一部解約元本額	7,968,996,991円	6,790,775,126円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2020年 1月20日現在)	第12期 (2021年 1月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	8,272,210,382	5,676,261,043
合計	8,272,210,382	5,676,261,043

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	3,807,169,006	13,804,414,098	
	国内株式インデックス マザーファンド	2,427,866,961	4,289,069,773	
	外国株式インデックス マザーファンド	7,977,519,035	25,649,319,201	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,150,688,122	3,028,168,875	
	外国債券インデックス マザーファンド	7,995,940,591	23,833,500,119	
	新興国債券インデックス マザーファンド	6,525,530,343	11,259,802,606	
合計		30,884,714,058	81,864,274,672	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

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

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>
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 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	431,157,941,659口
2. 担保資産	<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 101,369,000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 1.4080円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,080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 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	389,894,814,663円
期中追加設定元本額	78,209,607,894円
期中一部解約元本額	36,946,480,898円
期末元本額	431,157,941,659円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,640,927,523円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,000,136円
S M T 国内債券インデックス・オープン	19,289,847,114円
世界経済インデックスファンド	2,150,688,122円
D C マイセレクション 2 5	22,943,582,789円
D C マイセレクション 5 0	25,531,084,360円
D C マイセレクション 7 5	6,835,411,171円
D C 日本債券インデックス・オープン	438,397,196円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,324,962,718円
D C 日本債券インデックス・オープン P	69,176,349,668円
D C マイセレクション S 2 5	10,236,481,569円
D C マイセレクション S 5 0	10,967,335,318円
D C マイセレクション S 7 5	2,123,452,715円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,025,525,689円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,620,797,230円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	567,576,494円
D C 世界経済インデックスファンド	2,747,542,695円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,085,130円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,850,843円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	39,578,284円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,325,153円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	944,620円

区分	2021年 1月20日現在
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	137,898,512円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	194,655,179円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	47,443,354円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	48,798,841円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,596,454,411円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	830,238,693円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,302,536,140円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	713,286,066円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	82,926,220円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,111,742,446円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,302,968,951円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,571,410,021円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	153,008,680円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,214,601,146円
日本債券ファンド・シリーズ1	12,936,352,249円
分散投資コア戦略ファンドA	24,846,858,931円
分散投資コア戦略ファンドS	24,412,449,633円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	101,667,748円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,064,394,365円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	47,502,646円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,749,767円
SMT インデックスバランス・オープン	54,699,397円
SMT 世界経済インデックス・オープン	19,242,748円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	32,281,825円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	48,369,597円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,319,469円
グローバル経済コア	199,062,924円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	19,358,011円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,238,391円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	757,291円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	529,169円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	177,772円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	109,621円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	76,288,559,747円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	32,317,921円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



第14回道路債券	100,000,000	103,649,000	
第17回道路債券	100,000,000	102,941,000	
第21回道路債券	100,000,000	130,014,000	
第28回道路債券	200,000,000	263,880,000	
第33回道路債券	200,000,000	267,810,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,217,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,275,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,981,000	
第42回道路債券	100,000,000	109,089,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,692,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,233,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	143,252,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,046,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,704,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,380,000	
第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,812,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	913,608,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,210,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,632,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,036,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,926,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,669,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,687,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,724,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,622,000	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,048,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,500,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,516,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,325,000	

第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,330,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,410,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,160,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,744,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,151,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,876,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	616,692,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	305,732,720	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	636,980,400	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,310,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	151,189,400	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,941,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	270,884,754	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,070,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,624,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,042,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,724,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,217,480	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,192,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,101,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	230,182,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,019,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,813,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,813,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,171,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,002,000	
	200,000,000	203,170,000	

第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,664,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,922,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,936,870	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,311,400	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,232,050	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,804,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,502,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,891,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,479,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,688,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,873,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	216,884,720	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	379,350,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,533,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	214,615,800	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,381,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	395,577,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,920,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,369,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	42,831,200	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	130,369,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	235,226,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	194,154,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	234,840,000	
第21回地方公共団体金融機構債券（5年）	400,000,000	400,024,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,618,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	506,300,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,476,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,436,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,132,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,692,000	

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

第 5 9 回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	505,435,000	
第 5 9 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,992,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,022,000	12,368,353	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,470,000	12,846,344	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,741,000	13,171,645	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	185,850,000	185,809,113	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	132,220,000	132,278,176	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,542,000	12,923,402	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,505,000	13,991,044	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	238,923,000	238,380,644	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,930,000	11,068,483	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	22,724,000	23,186,433	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,308,000	13,783,627	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	256,617,000	255,734,237	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	91,410,000	91,384,405	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,995,000	12,311,668	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,004,000	14,561,779	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	293,154,000	292,986,902	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,958,000	12,275,126	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,025,000	14,600,866	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,077,000	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	9,930,000	9,959,492	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,144,000	10,174,330	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,374,000	19,510,248	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,759,000	20,010,225	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,059,000	22,632,949	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,632,000	24,153,323	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,071,000	26,903,690	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,793,000	27,619,660	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,444,000	59,359,455	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,133,000	12,434,626	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,393,000	26,902,613	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,299,000	12,611,271	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,112,000	12,492,559	

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

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

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



	第 8 3 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,032,000	
	第 2 7 回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,417,000	
	第 2 8 回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,444,000	
	第 6 0 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,785,000	
	第 9 2 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,916,000	
	第 1 2 7 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,156,000	
	特殊債券合計	38,322,324,000	39,860,565,417	
社債券	第 2 4 回フランス相互信用連合銀行（ B F C M ）円貨社債	100,000,000	100,355,000	
	第 2 9 回フランス相互信用連合銀行（ B F C M ）円貨社債	300,000,000	298,995,000	
	第 2 回 B ・ P ・ C ・ E ・ S ・ A 円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,239,000	
	第 2 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,391,000	
	第 1 4 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,486,000	
	第 1 5 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,348,000	
	第 1 7 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,962,000	
	第 1 2 回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,992,000	
	第 1 3 回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,362,000	
	第 1 2 回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	400,048,000	
	第 8 回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,988,000	
	第 3 9 回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,162,000	
	第 2 4 回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,008,000	
	第 1 5 回株式会社社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,828,000	
	第 7 回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,922,000	
	第 7 回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,199,000	
	第 9 回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,804,000	
	第 1 1 回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,185,000	
	第 1 3 回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,866,000	
	第 1 0 回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,827,000	
	第 2 4 回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,131,000	
	第 1 0 回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,374,000	
	第 5 回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,175,000	
	第 6 回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,255,000	

第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,990,000	
第11回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,740,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,689,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	200,666,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,065,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,880,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,686,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,298,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,458,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,482,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,428,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,181,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,752,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,684,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,173,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,662,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,090,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,009,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,890,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,760,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,229,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,288,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,300,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,668,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,177,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,387,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,894,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,996,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,559,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,084,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,116,000	

第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,096,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,477,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,256,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,583,000	
第29回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,845,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,180,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,296,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,468,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,198,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,091,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	96,005,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,816,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,137,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,758,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,785,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,414,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,265,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,710,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	99,778,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	118,780,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	113,096,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,473,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,212,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,462,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	304,311,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,907,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,854,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,666,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,406,000	
第29回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
	100,000,000	99,614,000	

第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債			
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,790,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,179,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,096,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,295,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,502,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,934,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,173,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,226,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,040,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,420,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,138,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,126,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,339,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,790,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,282,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,516,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,820,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,265,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,142,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,043,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,223,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,675,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,043,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,406,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,733,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,568,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,894,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,312,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,898,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,154,000	

第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	233,986,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,698,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,160,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,350,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,648,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,505,780	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,027,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,238,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,071,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,760,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,568,600	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,802,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,294,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,976,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,131,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,515,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,141,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	192,684,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,675,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,942,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,879,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,458,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,931,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,340,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,300,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,115,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	97,712,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,356,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,072,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,014,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,508,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,525,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,657,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,444,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,889,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,507,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,388,000	

第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,552,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,758,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,078,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	200,978,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,871,980	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,947,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,200,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,921,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,568,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,233,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,014,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,942,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,652,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,884,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,265,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,218,000	
第317回北海道電力株式会社社債	200,000,000	205,834,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,954,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,447,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,281,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,521,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,371,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,161,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,590,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	404,132,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,811,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,129,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,608,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,364,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	199,990,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,886,000	
第6回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	99,952,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,807,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	201,450,000	
社債券合計	25,665,000,000	25,983,464,360	
合計		605,790,231,084	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	2021年 1月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 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> <p>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。</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 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 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 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	211,981,845,770口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7666円 (1万口当たり純資産額) (17,666円)

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

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



	2021年 1月20日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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 1月20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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	203,008,903,193円
期中追加設定元本額	61,313,272,877円
期中一部解約元本額	52,340,330,300円
期末元本額	211,981,845,770円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	469,053,291円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,914,606,315円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,081,785円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,634,966,009円
世界経済インデックスファンド	2,427,866,961円
日本株式インデックス・オープン	3,751,401,116円
D C マイセレクション 2 5	6,685,894,628円
D C マイセレクション 5 0	18,683,708,272円
D C マイセレクション 7 5	17,771,178,469円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,748,228,227円
D C マイセレクション S 2 5	2,686,557,145円
D C マイセレクション S 5 0	8,150,003,857円
D C マイセレクション S 7 5	5,456,238,584円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,199,967,849円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	313,012,120円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	714,081,173円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	489,910,345円
D C 世界経済インデックスファンド	3,076,833,535円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,601,702,591円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	7,524,205円

区分	2021年 1月20日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	29,040,518円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	30,422,250円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	243,293,045円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,499,588円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	60,074,262円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	206,737,607円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	40,102,374円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	139,178,306円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,308,258,062円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	566,394,048円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,473,913,135円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	468,307,874円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	30,612,180円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	637,590,766円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	335,589,822円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	439,450,781円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	43,585,582円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	727,508,160円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,229,085,115円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,797,148,357円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,117,954,573円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,995,370,687円
分散投資コア戦略ファンドA	2,126,539,021円
分散投資コア戦略ファンドS	7,599,494,108円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	359,877,970円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	369,379,069円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,246,595,330円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	202,448,918円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,458,875円
SMT インデックスバランス・オープン	61,681,242円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	26,402,806,618円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	711,059,384円
SMT 世界経済インデックス・オープン	29,511,971円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	92,443,907円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	16,169,532円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,938,806円
グローバル経済コア	240,117,845円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,223,329円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	96,529,375円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,942,364円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,205,588,025円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	113,342,689円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	516,288円

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	2,668,760,200	-	2,733,560,000	64,799,800
	合計	2,668,760,200	-	2,733,560,000	64,799,800

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 外国債券インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

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

##### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2021年 1月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2021年 1月20日現在
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>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 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 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,925,048,586口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.9807円 (1万口当たり純資産額) (29,807円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項



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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

	2021年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	141,679,824,519円
期中追加設定元本額	14,849,798,334円
期中一部解約元本額	61,604,574,267円
期末元本額	94,925,048,586円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,500,223,211円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	610,426,540円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,028,498,942円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,351,531円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,768,826,444円
世界経済インデックスファンド	7,995,940,591円
D C マイセレクション 2 5	1,780,880,906円
D C マイセレクション 5 0	1,511,585,087円
D C マイセレクション 7 5	888,075,363円

区分	2021年 1月20日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	2,099,179,869円
D C マイセレクション S 2 5	806,052,108円
D C マイセレクション S 5 0	652,534,388円
D C マイセレクション S 7 5	288,760,461円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	40,101,678円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	72,755,348円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	35,685,929円
D C 世界経済インデックスファンド	10,258,551,164円
外国債券インデックス・オープン (SMA 専用)	687,748,406円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA 専用)	8,378,767円
マイセレクション 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,345,183円
マイセレクション 7 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	1,584,618円
外国債券インデックス・オープン V A 1 (適格機関投資家専用)	36,047,112円
バランス 3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	74,244,377円
バランス 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	111,242,865円
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	111,547,647円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	131,876,590円
バランス A ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,661,409,117円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	501,420,198円
バランス C ( 5 0 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,868,211,535円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	701,489,725円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	62,050,768円
バランス D ( 3 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	522,889,523円
バランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	201,384,458円
バランス F ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	242,341,497円
F O F s 用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	832,589,391円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1 (適格機関投資家専用)	932,040,597円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	797,530,803円
外国債券ファンド・シリーズ 1	591,164,700円
コア投資戦略ファンド (安定型)	1,005,426,797円
コア投資戦略ファンド (成長型)	2,530,527,298円
分散投資コア戦略ファンド A	1,090,641,754円
分散投資コア戦略ファンド S	2,217,866,231円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	384,859,624円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	3,320,640,417円
コア投資戦略ファンド (切替型)	824,670,942円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	209,234,971円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	98,435,250円
S M T グローバル債券インデックス・オープン (為替ヘッジあり)	1,167,487,537円
S M T インデックスバランス・オープン	185,501,748円
外国債券 S M T B セレクション (SMA 専用)	20,374,211,261円
S M T 世界経済インデックス・オープン	146,048,388円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	142,671,388円

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2021年 1月20日現在）

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

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2021年 1月20日現在）

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

### (注)時価の算定方法

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

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% 05/15/23	7,500,000.00	7,496,191.42	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,051,184.37	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,990,000.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,244,160.17	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,174,582.08	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,019,062.48	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	994,296.88	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,936,718.80	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,443,164.10	

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

## 有価証券明細表注記

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

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



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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

2021年 1月20日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 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 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</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 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	146,425,163,104口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.2152円 (1万口当たり純資産額) (32,152円)

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

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

	2021年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	141,149,497,764円
期中追加設定元本額	37,481,916,113円
期中一部解約元本額	32,206,250,773円
期末元本額	146,425,163,104円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,156,944,255円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,547,093円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,782,550,586円
世界経済インデックスファンド	7,977,519,035円
外国株式インデックス・オープン	809,421,038円
D C マイセレクション 2 5	999,966,840円
D C マイセレクション 5 0	4,474,533,401円
D C マイセレクション 7 5	4,977,762,434円
D C 外国株式インデックス・オープン	10,183,507,261円

区分	2021年 1月20日現在
DCマイセレクションS25	372,884,325円
DCマイセレクションS50	1,911,022,928円
DCマイセレクションS75	1,520,713,172円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	83,976,129円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	190,001,810円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	130,410,781円
DC世界経済インデックスファンド	10,160,358,713円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,988,260,711円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	6,962,856円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,576,295円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	31,817,267円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	32,637,613円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	114,000,710円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	22,118,223円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	78,476,616円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	501,080,040円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	275,357,716円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,905,628,627円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,343,689,462円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	50,932,284円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	267,446,094円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	79,851,944円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,573,648,640円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,670,419,511円
外国株式ファンド・シリーズ1	976,806,740円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,660,911,949円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,365,375,756円
分散投資コア戦略ファンドA	2,223,777,748円
分散投資コア戦略ファンドS	10,615,329,847円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,210,061,402円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,152,976,112円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,264,165,010円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	678,099,567円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,146,110円
SMT インデックスバランス・オープン	189,655,943円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	922,726,017円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,603,779,981円
SMT 世界経済インデックス・オープン	146,907,039円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	465,938,928円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	81,413,486円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,863,499円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	86,097,219円
グローバル経済コア	797,272,014円

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	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	7,270,936,672	-	7,457,238,691
	合計	7,270,936,672	-	7,457,238,691

## (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 1月20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	35,938,760	-	35,939,200	440
	カナダドル	35,938,760	-	35,939,200	440
合計		35,938,760	-	35,939,200	440

## (注)時価の算定方法

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,091,500.02	
		LENLEASE GROUP	64,786	822,782.20	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	765,988.65	
		オーストラリアドル 小計	303,750	2,680,270.87	(214,689,696)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,680,210.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,750,000.00	
		香港ドル 小計	595,500	5,430,210.00	(72,819,116)
		投資信託受益証券合計	899,250	287,508,812	(287,508,812)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	730,445.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,030	2,003,115.30	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	40,627	8,811,183.76	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,031,441.21	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,167,361.45	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,215,475.41	

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

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

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

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

ユーロ	株式	236銘柄	99.5%			10.6%
	投資証券	4銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式	85銘柄	98.8%			4.7%
	投資証券	3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%			3.2%
スウェーデンクローナ	株式	38銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式	19銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式	55銘柄	92.1%			2.2%
	投資信託受益証券	3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券	7銘柄			6.0%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	31銘柄	95.0%			1.1%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.6%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	85.1%			0.3%
	投資証券	5銘柄			14.9%	0.1%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

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



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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

	2021年 1月20日現在
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>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月21日
期首元本額	33,299,525,287円
期中追加設定元本額	6,058,481,425円
期中一部解約元本額	2,572,915,579円
期末元本額	36,785,091,133円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,262,849,121円
世界経済インデックスファンド	6,525,530,343円
DC 新興国債券インデックス・オープン	4,730,704,751円
DC 世界経済インデックスファンド	8,330,432,420円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,811,418,507円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	84,790,266円
分散投資コア戦略ファンドA	251,578,523円
分散投資コア戦略ファンドS	592,208,542円

区分	2021年 1月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	312,684,810円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,869,937,278円
コア投資戦略ファンド（切替型）	86,647,214円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	182,271,675円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	85,841,744円
S M T インデックスバランス・オープン	152,071,261円
外国債券S M T Bセクション（S M A専用）	3,142,450,568円
S M T 世界経済インデックス・オープン	183,826,780円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	175,945,663円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	297,749,660円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,477,993円
グローバル経済コア	639,011,517円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	28,048,658円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,598,606円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	737,126円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	675,039円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	306,085円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	422,878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）	85,899,881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）	183,502,199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）	300,211,439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）	313,596,985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）	302,592,728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）	298,009,298円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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



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

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

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	10.0%
ブラジルリアル	国債証券 10銘柄	100.0%	8.4%
チリペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	2.7%
コロンビアペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	5.5%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.8%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 13銘柄	100.0%	1.9%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	4.0%
ハンガリーフォリント	国債証券 15銘柄	100.0%	4.2%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	8.5%
ロシアルーブル	国債証券 20銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリングgit	国債証券 16銘柄	100.0%	7.2%
タイバーツ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.0%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券 26銘柄	100.0%	9.7%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	7.4%
香港・オフショア人民元	国債証券 17銘柄	100.0%	10.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 1月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,326,857,261
金銭信託	83,362

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

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

	2021年 1月20日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,6259円 (36,259円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

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

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2021年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	2,663,937,917	-	2,733,233,244	69,295,327
	合計	2,663,937,917	-	2,733,233,244	69,295,327



## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2021年 1月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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	74,168	-	73,968	200
	アメリカドル	74,168	-	73,968	200
	売建	197,522,168	-	197,521,524	644
	アメリカドル	197,448,000	-	197,448,000	-
	ブラジルリアル	74,168	-	73,524	644
合計		197,596,336	-	197,595,492	444

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

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

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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



(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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13期中間計算期間(2021年1月21日から2021年7月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【世界経済インデックスファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第12期 ( 2021年 1月20日現在 )	第13期中間計算期間 ( 2021年 7月20日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	54,244	-
コール・ローン	1,059,406,955	1,433,337,306
親投資信託受益証券	81,864,274,672	101,640,842,617
未収入金	368,070,000	60,000,000
流動資産合計	83,291,805,871	103,134,179,923
資産合計	83,291,805,871	103,134,179,923
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	304,937,633	199,367,007
未払受託者報酬	20,954,168	25,295,077
未払委託者報酬	188,587,520	227,655,651
未払利息	719	2,299
その他未払費用	1,872,616	989,219
流動負債合計	516,352,656	453,309,253
負債合計	516,352,656	453,309,253
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	31,955,196,547	37,242,735,180
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	50,820,256,668	65,438,135,490
( 分配準備積立金 )	11,452,082,551	10,515,205,466
元本等合計	82,775,453,215	102,680,870,670
純資産合計	82,775,453,215	102,680,870,670
負債純資産合計	83,291,805,871	103,134,179,923

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2020年 1月21日 至 2020年 7月20日	第13期中間計算期間 自 2021年 1月21日 至 2021年 7月20日
営業収益		
受取利息	3,186	360
有価証券売買等損益	1,998,544,679	5,687,427,945
営業収益合計	1,998,541,493	5,687,428,305
営業費用		
支払利息	225,009	194,742
受託者報酬	17,826,795	25,295,077
委託者報酬	160,441,129	227,655,651
その他費用	918,262	989,219
営業費用合計	179,411,195	254,134,689
営業利益又は営業損失（ ）	2,177,952,688	5,433,293,616
経常利益又は経常損失（ ）	2,177,952,688	5,433,293,616
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,177,952,688	5,433,293,616
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	477,090,628	305,432,952
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	40,493,108,163	50,820,256,668
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,589,580,568	14,114,576,921
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,589,580,568	14,114,576,921
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,307,207,122	4,624,558,763
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,307,207,122	4,624,558,763
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	41,074,619,549	65,438,135,490

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2021年 1月20日現在)	第13期中間計算期間 (2021年 7月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	31,955,196,547口	37,242,735,180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) 2.5904円 (25,904円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7571円 (27,571円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2021年 7月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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。

	第13期中間計算期間 (2021年 7月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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12期 自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20日	第13期中間計算期間 自 2021年 1月21日 至 2021年 7月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	28,106,957,352円	31,955,196,547円
期中追加設定元本額	10,639,014,321円	8,184,439,049円
期中一部解約元本額	6,790,775,126円	2,896,900,416円

（デリバティブ取引に関する注記）

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、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	833,953,160
国債証券	534,805,743,750

	2021年 7月20日現在
項目	金額（円）
地方債証券	35,372,960,449
特殊債券	38,926,153,511
社債券	28,861,107,660
未収利息	1,008,503,007
前払費用	32,103,246
流動資産合計	639,840,524,783
資産合計	639,840,524,783
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	200,280,867
未払利息	1,337
流動負債合計	500,282,204
負債合計	500,282,204
純資産の部	
元本等	
元本	451,348,385,343
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	187,991,857,236
元本等合計	639,340,242,579
純資産合計	639,340,242,579
負債純資産合計	639,840,524,783

## 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20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>
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20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	451,348,385,343口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 101,580,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4165円 (1万口当たり純資産額) (14,165円)

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2021年 1月21日



区分	2021年 7月20日現在
期首元本額	431,157,941,659円
期中追加設定元本額	30,828,542,764円
期中一部解約元本額	10,638,099,080円
期末元本額	451,348,385,343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）	3,762,903,298円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,795,221円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,660,044,847円
世界経済インデックスファンド	2,600,532,725円
D C マイセレクション 2 5	24,431,425,844円
D C マイセレクション 5 0	27,667,129,376円
D C マイセレクション 7 5	8,054,238,953円
D C 日本債券インデックス・オープン	434,758,590円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,654,437,834円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,566,342,009円
D C マイセレクション S 2 5	11,505,083,065円
D C マイセレクション S 5 0	12,708,233,714円
D C マイセレクション S 7 5	2,670,468,931円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	983,568,807円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,935,011,122円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	694,613,092円
D C 世界経済インデックスファンド	2,972,221,189円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,114,499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
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	39,476,904円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,005,829円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,015,770円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	125,022,265円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	191,703,892円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	38,516,323円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	36,132,335円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,435,981,631円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	815,578,720円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,420,072,510円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	343,301,178円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	84,414,571円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,094,359,963円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,257,002,642円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,534,858,124円
国内バランス 2 5 V A 1（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

区分	2021年 7月20日現在
日本債券ファンド・シリーズ1	14,760,656,789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
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	133,479,853円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,249,090,634円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	56,687,767円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,639,855円
S M T インデックスバランス・オープン	57,885,650円
S M T 世界経済インデックス・オープン	24,589,363円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	44,157,809円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	70,461,578円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,761,539円
グローバル経済コア	194,211,268円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	22,296,786円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	12,490,399円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,479,042円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,154,499円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	965,348円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	443,345円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	78,298,290,164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）	45,652,073円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,175,562,604
株式	454,933,866,430
派生商品評価勘定	28,350
未収配当金	576,953,149
前払金	96,447,600
差入委託証拠金	99,074,000
流動資産合計	458,881,932,133
資産合計	458,881,932,133
負債の部	
流動負債	

	2021年 7月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	96,513,350
未払金	1,232,200
未払解約金	250,092,922
未払利息	5,094
流動負債合計	347,843,566
負債合計	347,843,566
純資産の部	
元本等	
元本	251,363,612,494
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	207,170,476,073
元本等合計	458,534,088,567
純資産合計	458,534,088,567
負債純資産合計	458,881,932,133

## 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20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20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		251,363,612,494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)	1.8242円 (18,242円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

		2021年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<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>	

## （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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 7月20日現在
期首	2021年 1月21日
期首元本額	211,981,845,770円
期中追加設定元本額	57,407,655,390円
期中一部解約元本額	18,025,888,666円
期末元本額	251,363,612,494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）	424,097,885円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,879,073,798円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,499,608円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,646,048,898円
世界経済インデックスファンド	2,850,072,955円
日本株式インデックス・オープン	3,479,329,032円
DCマイセレクション25	6,093,396,711円
DCマイセレクション50	18,011,489,808円
DCマイセレクション75	17,712,663,916円
DC日本株式インデックス・オープン	5,820,610,874円
DCマイセレクションS25	2,954,532,469円
DCマイセレクションS50	8,447,836,608円
DCマイセレクションS75	6,034,063,203円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,691,331,101円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	252,165,986円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	683,934,849円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	481,331,599円
DC世界経済インデックスファンド	3,249,618,882円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,549,330,653円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	25,865,412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）	194,956,327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）	170,946,035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）	1,143,337,987円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	480,209,406円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,035,311,282円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	214,132,649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）	550,988,658円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	316,465,819円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	398,099,011円

区分	2021年 7月20日現在
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	41,816,544円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	646,421,749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	1,961,631,847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
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	416,912,413円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	392,310,921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）	206,807,996円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,373,147円
S M T インデックスバランス・オープン	59,809,808円
国内株式 S M T B セレクション（S M A 専用）	24,966,394,062円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	604,397,930円
S M T 世界経済インデックス・オープン	35,272,838円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	119,255,125円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	21,770,793円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	6,110,606円
グローバル経済コア	235,044,908円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	22,689,258円
i - S M T T O P I X インデックス（ノーロード）	63,092,337円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	18,082,777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）	135,987,668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	4,307,127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	2,935,755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	1,365,394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	1,235,340円
F O F s 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）	42,592,009,568円
F O F s 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）	1,169,838,436円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	175,566,400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）	27,324,506円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,637,784,786円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 7月20日現在）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,594,797,600	-	3,498,350,000	96,447,600
	合計	3,594,797,600	-	3,498,350,000	96,447,600

## (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。

## 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20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	191,680,163
コール・ローン	3,931,535,263
国債証券	303,574,750,987
派生商品評価勘定	60,124,023
未収利息	1,741,823,729
前払費用	55,918,677
差入委託証拠金	501,814,172
流動資産合計	310,057,647,014
資産合計	310,057,647,014
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	45,908,770
前受金	60,050,004
未払金	309,752
未払解約金	40,282,861
未払利息	6,307
流動負債合計	146,557,694
負債合計	146,557,694
純資産の部	
元本等	
元本	100,839,279,332
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	209,071,809,988
元本等合計	309,911,089,320
純資産合計	309,911,089,320
負債純資産合計	310,057,647,014

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 7月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,839,279,332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 3.0733円 (1万口当たり純資産額) (30,733円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項



	2021年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

(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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月21日
期首元本額	94,925,048,586円
期中追加設定元本額	9,920,429,112円
期中一部解約元本額	4,006,198,366円
期末元本額	100,839,279,332円
期末元本額の内訳	

区分	2021年 7月20日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	1,419,143,674円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	608,398,568円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,076,072,648円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,241,968円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	7,343,610,802円
世界経済インデックスファンド	9,956,682,669円
DCマイセレクション25	1,908,051,746円
DCマイセレクション50	1,607,156,995円
DCマイセレクション75	1,094,494,104円
DC外国債券インデックス・オープン	2,180,897,446円
DCマイセレクションS25	891,852,728円
DCマイセレクションS50	685,927,926円
DCマイセレクションS75	364,485,158円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	38,576,254円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	85,400,582円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	42,670,756円
DC世界経済インデックスファンド	11,370,348,881円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	676,598,337円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	3,958,504円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,313,752円
マイセレクション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）	32,043,733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）	106,853,703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）	1,565,872,341円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	478,928,793円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,885,882,696円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	328,476,156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）	498,196,115円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	189,633,417円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	229,852,819円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	791,894,513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）	1,741,498,036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	628,341,387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

区分	2021年 7月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	473,790,669円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,710,234,750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)	229,711,798円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	101,190,581円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,260,554,535円
S M T インデックスバランス・オープン	195,020,874円
外国債券S M T Bセクション(S M A専用)	20,880,259,904円
S M T 世界経済インデックス・オープン	184,555,498円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	204,443,721円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	330,466,249円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,462,701円
グローバル経済コア	765,176,267円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	12,351,362円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	1,244,985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)	31,055,758円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	4,688,382円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,649,964円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,909,893円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,859,279円
F O F s 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)	510,203,586円
F O F s 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)	10,573,696,248円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	337,276,081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)	340,149,493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)	191,819,223円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2021年 7月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	4,772,286,123	-	4,832,336,127	60,050,004
	合計	4,772,286,123	-	4,832,336,127	60,050,004

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

## 4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2021年 7月20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	4,778,323,062	-	4,732,488,311	45,834,751
	アメリカドル	2,219,121,304	-	2,206,214,146	12,907,158
	カナダドル	211,554,512	-	206,310,240	5,244,272
	ユーロ	2,007,208,629	-	1,985,968,128	21,240,501
	イギリスポンド	340,438,617	-	333,995,797	6,442,820
合計		4,778,323,062	-	4,732,488,311	45,834,751

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,343,131,946
コール・ローン	958,864,504
株式	491,751,040,829
投資信託受益証券	308,963,927
投資証券	11,645,032,693
派生商品評価勘定	11,366,577
未収入金	1,485,768
未収配当金	334,657,615
前払金	114,293,559
差入委託証拠金	3,146,453,103
流動資産合計	517,615,290,521
資産合計	517,615,290,521
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	125,750,606
未払解約金	771,420,827
未払利息	1,538
流動負債合計	897,172,971

	2021年 7月20日現在
項目	金額（円）
負債合計	897,172,971
純資産の部	
元本等	
元本	137,538,722,510
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	379,179,395,040
元本等合計	516,718,117,550
純資産合計	516,718,117,550
負債純資産合計	517,615,290,521

## 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20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2021年 7月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2021年 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,538,722,510口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 3.7569円
	(1万口当たり純資産額) (37,569円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

	2021年 7月20日現在
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>

(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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月21日
期首元本額	146,425,163,104円
期中追加設定元本額	6,463,350,885円
期中一部解約元本額	15,349,791,479円
期末元本額	137,538,722,510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）	2,001,120,796円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,216,484円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,969,185,513円
世界経済インデックスファンド	8,567,547,558円
外国株式インデックス・オープン	824,561,864円

区分	2021年 7月20日現在
D Cマイセレクション2 5	845,555,556円
D Cマイセレクション5 0	4,034,556,633円
D Cマイセレクション7 5	4,507,489,054円
D C外国株式インデックス・オープン	11,147,861,136円
D CマイセレクションS 2 5	408,092,953円
D CマイセレクションS 5 0	1,888,128,511円
D CマイセレクションS 7 5	1,490,345,872円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	68,699,251円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	185,474,143円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	130,694,267円
D C世界経済インデックスファンド	9,950,188,686円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,851,679,272円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,165,982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）	30,700,212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）	384,913,042円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	214,448,853円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,554,656,192円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	521,809,874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）	208,210,918円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	72,529,639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）	1,362,461,530円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,128,393,360円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,219,251,563円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,561,834,296円
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	9,325,182,835円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,280,172,707円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,123,641,876円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,010,458,792円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	635,600,294円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,777,177円
S M T インデックスバランス・オープン	171,810,402円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	688,758,232円
外国株式S M T Bセレクション（SMA専用）	26,838,352,891円
S M T 世界経済インデックス・オープン	162,332,144円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	555,734,743円



区分	2021年 7月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	102,608,435円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,384,572円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	114,132,747円
グローバル経済コア	681,726,727円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,708,402円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,618,318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）	75,693,587円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	12,888,600円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	8,820,170円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,137,326円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,806,146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）	573,459,966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）	868,678,235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）	1,292,437,652円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	822,131,630円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	126,144,413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）	4,941,026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

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2021年 7月20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	13,889,757,169	-	13,775,463,610	114,293,559
合計		13,889,757,169	-	13,775,463,610	114,293,559

#### （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20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	1,016,167,500	-	1,016,077,030	90,470
	アメリカドル	848,130,800	-	848,029,020	101,780
	ユーロ	168,036,700	-	168,048,010	11,310
	合計	1,016,167,500	-	1,016,077,030	90,470

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	472,753,860
コール・ローン	339,920,676
国債証券	70,794,593,674
派生商品評価勘定	1,144,089
未収利息	869,317,779
前払費用	103,662,879
流動資産合計	72,581,392,957
資産合計	72,581,392,957
負債の部	
流動負債	
未払金	377,350,903
未払解約金	7,720,758
未払利息	545
流動負債合計	385,072,206
負債合計	385,072,206
純資産の部	
元本等	
元本	41,327,686,244
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	30,868,634,507
元本等合計	72,196,320,751
純資産合計	72,196,320,751
負債純資産合計	72,581,392,957

## 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20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <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20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,327,686,244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 1.7469円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,469円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<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>

(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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月21日
期首元本額	36,785,091,133円
期中追加設定元本額	5,394,226,327円
期中一部解約元本額	851,631,216円
期末元本額	41,327,686,244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	4,471,260,097円
世界経済インデックスファンド	8,302,784,021円

区分	2021年 7月20日現在
D C 新興国債券インデックス・オープン	4,950,053,939円
D C 世界経済インデックスファンド	9,446,159,945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）	1,808,081,708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）	80,575,850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
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	386,538,953円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,148,827,601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）	187,242,008円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	86,438,510円
S M T インデックスバランス・オープン	160,089,994円
外国債券S M T Bセクション（SMA専用）	3,521,060,121円
S M T 世界経済インデックス・オープン	233,168,467円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	257,843,829円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	418,790,797円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,975,050円
グローバル経済コア	637,430,990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
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,720,274円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,207,265円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,875,347円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,627,794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）	77,018,126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）	246,427,535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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 7月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	174,116,298	-	174,720,184	603,886
	インドネシアルピア	174,116,298	-	174,720,184	603,886
	売建	174,116,298	-	173,576,095	540,203
	アメリカドル	174,116,298	-	173,576,095	540,203
	合計	348,232,596	-	348,296,279	1,144,089

## (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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 7月20日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	6,565,797,660
コール・ローン	46,521,328
株式	90,410,247,301
投資信託受益証券	242,801,520
投資証券	68,327,100
派生商品評価勘定	140,117
未収入金	25,978,881
未収配当金	276,978,385
前払金	323,372,845
差入委託証拠金	564,867,170
流動資産合計	98,525,032,307
資産合計	98,525,032,307
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	323,592,174
未払解約金	9,537,436
未払利息	74
流動負債合計	333,129,684
負債合計	333,129,684
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	26,626,188,047
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,565,714,576
元本等合計	98,191,902,623
純資産合計	98,191,902,623
負債純資産合計	98,525,032,307

## 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20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 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>

	2021年 7月20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20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,626,188,047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 3.6878円 (1万口当たり純資産額) (36,878円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>



	2021年 7月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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>

## （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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月21日
期首元本額	25,006,661,411円
期中追加設定元本額	2,466,086,550円
期中一部解約元本額	846,559,914円
期末元本額	26,626,188,047円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,533,000,134円
世界経済インデックスファンド	4,194,007,066円
DC 新興国株式インデックス・オープン	5,034,896,761円
DC 世界経済インデックスファンド	4,783,644,267円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	197,717,964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
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	637,574,355円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	557,645,219円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	314,427,173円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	15,515,488円
SMT インデックスバランス・オープン	83,426,195円
SMT 世界経済インデックス・オープン	117,564,310円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	403,917,944円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	71,958,099円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,055,925円

区分	2021年 7月20日現在
グローバル経済コア	348,360,942円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	30,665,030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	6,474,789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	4,400,282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	2,069,060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	1,860,738円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	597,907,632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)	92,128,640円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2021年 7月20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	7,847,120,709	-	7,523,747,864	323,372,845
	合計	7,847,120,709	-	7,523,747,864	323,372,845

(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20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	83,349,300	-	83,270,088	79,212
	アメリカドル	83,349,300	-	83,270,088	79,212
	合計	83,349,300	-	83,270,088	79,212

(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【世界経済インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

(2021年 8月31日現在)

資産総額	111,274,133,766円
負債総額	171,471,972円
純資産総額（ - ）	111,102,661,794円
発行済口数	39,407,645,662口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8193円
（1万口当たり純資産額）	（28,193円）

(参考)

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 8月31日現在)

資産総額	681,147,318,672円
負債総額	16,682,562,907円
純資産総額（ - ）	664,464,755,765円
発行済口数	469,604,183,414口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4149円
（1万口当たり純資産額）	（14,149円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 8月31日現在)

資産総額	481,576,382,884円
負債総額	1,854,910,042円
純資産総額（ - ）	479,721,472,842円
発行済口数	253,261,545,128口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8942円
（1万口当たり純資産額）	（18,942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 8月31日現在)

資産総額	299,092,321,231円
負債総額	48,812,665円
純資産総額（ - ）	299,043,508,566円
発行済口数	96,855,265,837口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0875円
（1万口当たり純資産額）	（30,875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 8月31日現在)

資産総額	537,462,583,123円
負債総額	557,571,456円
純資産総額（ - ）	536,905,011,667円
発行済口数	134,120,963,321口
1口当たり純資産額（ / ）	4.0031円
（1万口当たり純資産額）	（40,031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 8月31日現在)

資産総額	76,372,528,663円
負債総額	1,920,987円
純資産総額（ - ）	76,370,607,676円
発行済口数	43,117,063,399口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7712円
（1万口当たり純資産額）	（17,712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 8月31日現在)

資産総額	99,347,199,194円
負債総額	127,394,054円
純資産総額（ - ）	99,219,805,140円
発行済口数	27,358,080,288口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6267円
（1万口当たり純資産額）	（36,267円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2021年 8月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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



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

#### [ 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20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	538	14,713,325
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	77	281,704
単位型公社債投資信託	50	311,772
合計	665	15,306,802

## 3【委託会社等の経理状況】

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

なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位: 百万円)

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

(単位: 百万円)

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

## (2) 【損益計算書】

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

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

効性を判定しております。

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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



当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

##### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

##### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	21,589	21,589	-
（2）金銭の信託	10,857	10,857	-
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	-
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
（6）未払金	(7,572)	(7,572)	-
（7）デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 投資有価証券 その他有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:百万円)

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-

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

## （有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建			
	米ドル	2,889	-	41
	英ポンド	128	-	0
	カナダドル	21	-	0
	スイスフラン	51	-	0
	香港ドル	128	-	1
	ユーロ	246	-	0
	買建			
	米ドル	99	-	1
	香港ドル	2	-	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
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20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

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
ソニー銀行株式会社	36,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。

auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みちのく銀行	36,986	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社栃木銀行	27,408	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北都銀行	12,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	10,857	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。
GMOクリック証券株式会社	4,346	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社福井銀行	17,965	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000 1	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社東邦銀行	23,519	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
とうほう証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社琉球銀行	56,967	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社きらぼし銀行	43,734	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社イオン銀行	51,250	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社広島銀行	54,573	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社池田泉州銀行	61,385	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社千葉興業銀行	62,120	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
東海東京証券株式会社	6,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
P a y P a y 銀行株式会社	37,250	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社筑邦銀行	8,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
きらぼしライフデザイン証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
京都信用金庫	12,021 2	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
株式会社名古屋銀行	25,090	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

1：資本金の額は2021年10月1日現在です。

2：資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

## 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【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

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  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

**監査意見**

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2021年3月19日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンドの2020年1月21日から2021年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年9月16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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンドの2021年1月21日から2021年7月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、世界経済インデックスファンドの2021年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年1月21日から2021年7月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。