

**【表紙】**

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年9月24日提出
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	つみたて全世界株式
【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】	(1)当初自己設定額 100万円を上限とします。 (2)継続申込額 1兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2020年2月19日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

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

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

&lt;更新後&gt;

当ファンドは、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

\* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

## 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
	海外	債券 不動産投信		
追加型	内外	その他資産 ( )	ETF	特殊型 ( )
		資産複合		

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般	年1回 年2回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ( )	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ( )	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX  その他 (MSCI オール・カン ントリー・ワールド・インデッ クス(配当込み、 円換算ベー ス))	条件付運用型  ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型  その他 ( )
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式一 般)) 資産複合 ( )						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

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います。

#### 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	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います。
	追加型	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います。
投資対象地域	国内	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います。
	海外	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います。
	内外	信託約款において、国内およ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います。
投資対象資産	株式	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います。
	債券	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います。
	不動産投信（リート）	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およ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います。
	その他資産	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、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他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います。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	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号および第2号に規定する証券投資信託なら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います。
補足分類	インデックス型	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またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）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います。

上記定義は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」を基に委託会社が作成したものです。

#### 属性区分の定義

投資対象資産	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います。
		大型株	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います。
		中小型株	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います。

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います。
	公債	信託約款において、日本国また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、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	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います。
	その他債券	信託約款において、公債また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います。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BBB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。	
決算頻度	年1回	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います。
	年2回	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います。
	年4回	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います。
	年6回（隔月）	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います。
	年12回（毎月）	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います。
	日々	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います。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	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います。
	日本	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います。
	北米	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います。
	欧州	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います。
	アジア	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います。
	オセアニア	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います。
	中南米	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います。
	アフリカ	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います。
	中近東（中東）	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います。
	エマージング	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（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	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きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「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・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまた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います。
	なし	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または為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	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・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	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います。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型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います。

上記定義は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」を基に委託会社が作成したものです。

#### [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的


日本を含む先進国および新興国の株式市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

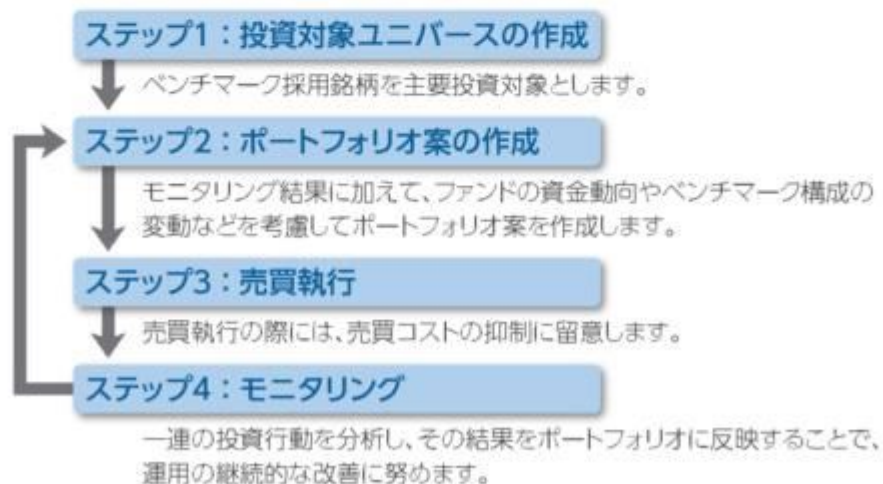
特色 1

MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。


- MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)をベンチマーク(以下「対象インデックス」という場合があります。)とします。
- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

 MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の先進国・新興国の株式で構成されています。  
MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。  
MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

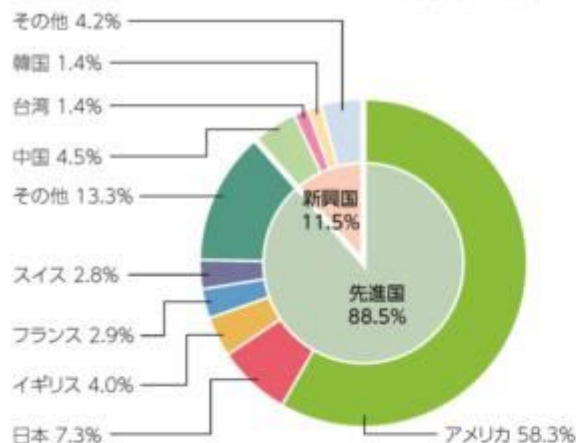
### <運用プロセスのイメージ>



 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

 委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

### <対象インデックスの国・地域別構成比率>



- ・表示桁未満の数値がある場合、四捨五入しています。
- ・MSCI Inc.のデータを基に三菱UFJ国際投信作成(2020年5月末現在)

#### 先進国・地域 (23カ国・地域)

アメリカ	オランダ	ベルギー
日本	香港	アイルランド
イギリス	スウェーデン	イスラエル
フランス	スペイン	ノルウェー
スイス	デンマーク	ニュージーランド
カナダ	イタリア	ポルトガル
ドイツ	シンガポール	オーストリア
オーストラリア	フィンランド	

#### 新興国・地域 (26カ国・地域)

中国	メキシコ	ペルー
台湾	マレーシア	ハンガリー
韓国	インドネシア	コロンビア
インド	カタール	ギリシャ
ブラジル	フィリピン	アルゼンチン
南アフリカ	ポーランド	エジプト
ロシア	チリ	チェコ
サウジアラビア	アラブ首長国連邦	パキスタン
タイ	トルコ	

## 特色2

主として対象インデックスに採用されている日本を含む先進国および新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます。)への投資を行います。

- 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。
  - DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。
  - ※実際の運用は外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、日本株式インデックスマザーファンドを通じて行います。



## 特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。





年1回の決算時(6月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■ファンドの仕組み

運用は主に外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、日本株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む先進国および新興国の株式等に投資を行うファミリーファンド方式により行います。



- ・外国株式インデックスマザーファンドは、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。
- ・新興国株式インデックスマザーファンドは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。
- ・日本株式インデックスマザーファンドは、MSCI ジャパン・インデックス(配当込み)に連動する投資成果をめざします。

## ■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

### <訂正前>

2020年3月6日 設定日、信託契約締結、運用開始（予定）

### <訂正後>

2020年3月6日 設定日、信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

### <訂正前>

#### 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
--	----

委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況(2019年11月末現在)

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更  
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更  
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

## &lt;訂正後&gt;

## 委託会社と関係法人との契約の概要

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

## 委託会社の概況(2020年6月末現在)

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始

2004年10月	東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
2015年7月	三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

### 3【投資リスク】

<更新後>

#### (1) 投資リスク

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

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

#### 価格変動 リスク

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

#### 為替変動 リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性 リスク

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

#### カントリー・ リスク

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

#### 留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な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。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。

また、定期的に関催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

### <流動性リスクに対する管理体制>

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

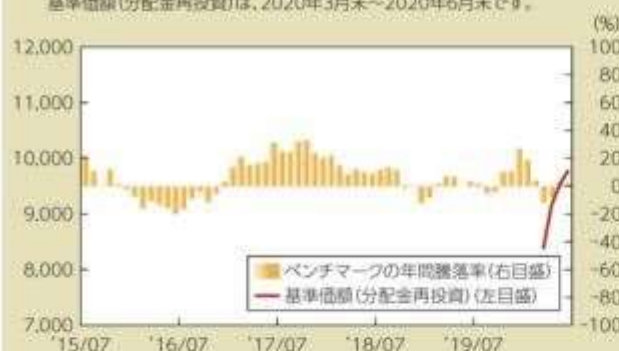
\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

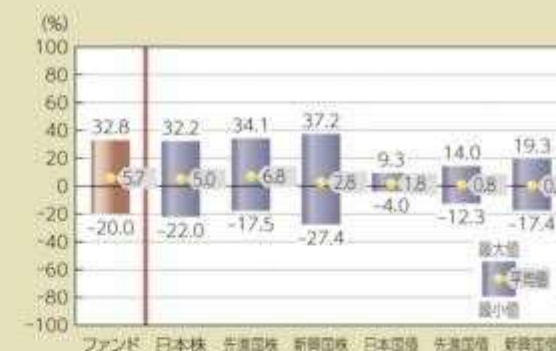
ファンドの年間騰落率はありません。  
ベンチマークの年間騰落率は、2015年7月～2020年6月です。  
基準価額(分配金再投資)は、2020年3月末～2020年6月末です。



### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2015年7月末～2020年6月末)

ファンドの年間騰落率にはベンチマークを用いています。



(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したのものとして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

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

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

- (\*) 確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

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。

## 収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、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また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、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。

なお、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。

上記は2019年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## <訂正後>

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

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

#### 1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

#### 2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。ファンドは「つみたてNISA（非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISA、ジュニアNISAおよびつみたてNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

（\*）確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。な



お、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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

#### 個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

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。

#### 収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、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また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、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。

なお、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。

上記は2020年6月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

### 【つみたて全世界株式】

#### （1）【投資状況】

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	3,178,602	99.48
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		16,574	0.52
純資産総額		3,195,176	100.00

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

令和2年6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	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	897,819	2.8319	2,542,536	2.8547	2,563,003	80.21
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	167,253	2.3484	392,783	2.3320	390,033	12.21
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスマザーファンド	225,206	1.0024	225,750	1.0016	225,566	7.06

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和2年6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.48
合計	99.48

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和2年6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位:円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (令和2年6月25日)	3,144,556	3,144,556	9,714	9,714
令和2年3月末日	1,022,971		8,387	
4月末日	1,938,666		9,160	
5月末日	2,723,608		9,531	
6月末日	3,195,176		9,767	

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	2.86

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

## （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	3,414,888	177,744	3,237,144

## （参考）

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	313,270,928,432	66.30
	イギリス	21,848,577,960	4.62
	スイス	16,074,902,770	3.40
	フランス	15,827,632,218	3.35
	カナダ	15,372,319,920	3.25
	ドイツ	14,159,716,750	3.00
	オーストラリア	9,713,861,606	2.06
	オランダ	7,940,411,230	1.68
	香港	4,810,922,579	1.02
	スウェーデン	4,787,170,894	1.01
	スペイン	3,779,750,005	0.80
	デンマーク	3,662,171,513	0.78
	イタリア	3,011,690,764	0.64
	フィンランド	1,584,585,807	0.34

	シンガポール	1,460,465,683	0.31
	ベルギー	1,420,659,266	0.30
	アイルランド	1,026,505,477	0.22
	ノルウェー	811,875,257	0.17
	ニュージーランド	501,879,314	0.11
	イスラエル	478,490,706	0.10
	ルクセンブルグ	348,426,562	0.07
	オーストリア	265,344,082	0.06
	ポルトガル	264,328,842	0.06
	小計	442,422,617,637	93.64
投資証券	アメリカ	9,330,722,928	1.97
	オーストラリア	615,565,057	0.13
	シンガポール	266,024,173	0.06
	イギリス	263,162,200	0.06
	香港	204,462,258	0.04
	フランス	176,400,774	0.04
	オランダ	99,640,248	0.02
	カナダ	84,452,718	0.02
	小計	11,040,430,356	2.34
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		19,032,662,241	4.02
純資産総額		472,495,710,234	100.00

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

#### その他の資産の投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,706,197,455	2.48
	買建	カナダ	538,278,072	0.11
	買建	ドイツ	2,122,251,494	0.45
	買建	オーストラリア	568,453,037	0.12
	買建	イギリス	764,360,745	0.16
	買建	スイス	579,327,492	0.12

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### a 評価額上位30銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	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	484,116	34,083.54	16,500,391,407	38,978.17	18,869,959,233	3.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	799,398	20,136.60	16,097,162,563	21,379.92	17,091,069,765	3.62
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	46,814	260,576.73	12,198,639,122	288,784.14	13,519,140,786	2.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	46,060	151,675.29	6,986,164,070	150,531.09	6,933,462,273	1.47
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	266,185	23,113.46	6,152,456,936	23,771.75	6,327,684,232	1.34
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	291,479	16,057.56	4,680,444,330	14,980.16	4,366,404,855	0.92
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	329,283	11,942.44	3,932,444,315	11,879.04	3,911,566,719	0.83
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	188,724	19,894.19	3,754,511,302	20,619.28	3,891,353,225	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	273,163	12,439.66	3,398,054,953	12,676.68	3,462,802,233	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	339,976	9,773.09	3,322,617,881	10,019.81	3,406,498,324	0.72
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	104,969	31,253.21	3,280,619,166	31,218.74	3,277,000,171	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	120,665	25,613.03	3,090,596,289	26,516.96	3,199,670,040	0.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	21,055	151,300.82	3,185,638,860	150,294.06	3,164,441,598	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	98,984	30,513.04	3,020,303,286	31,560.27	3,123,962,577	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	473,171	6,501.03	3,076,099,623	6,278.00	2,970,572,175	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	153,306	18,988.09	2,910,989,291	19,090.45	2,926,680,620	0.62
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	77,764	38,917.11	3,026,350,188	37,526.76	2,918,231,664	0.62
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	457,189	6,087.31	2,783,051,172	5,892.30	2,693,895,019	0.57
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	67,715	35,278.38	2,388,875,881	39,648.32	2,684,785,989	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	793,287	3,179.40	2,522,182,558	3,222.50	2,556,370,055	0.54
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	53,346	40,219.34	2,145,541,019	45,703.30	2,438,088,669	0.52
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	199,715	11,714.57	2,339,575,387	12,015.16	2,399,608,638	0.51
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	48,543	47,323.71	2,297,235,223	48,185.63	2,339,075,406	0.50
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	469,395	4,706.08	2,209,011,923	4,972.20	2,333,926,288	0.49

アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	280,717	8,420.95	2,363,906,179	8,201.16	2,302,207,502	0.49
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	237,885	9,467.45	2,252,165,866	9,439.15	2,245,432,531	0.48
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	123,297	15,626.60	1,926,714,084	18,138.02	2,236,364,562	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	468,161	4,943.11	2,314,171,882	4,775.03	2,235,486,003	0.47
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	868,844	2,445.69	2,124,930,033	2,520.03	2,189,520,417	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	153,672	14,463.01	2,222,560,840	14,122.55	2,170,241,917	0.46

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 6月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	3.32
	素材	4.12
	資本財	5.94
	商業・専門サービス	1.17
	運輸	1.77
	自動車・自動車部品	1.12
	耐久消費財・アパレル	1.68
	消費者サービス	1.41
	メディア・娯楽	6.26
	小売	5.74
	食品・生活必需品小売り	1.48
	食品・飲料・タバコ	4.42
	家庭用品・パーソナル用品	2.09
	ヘルスケア機器・サービス	5.09
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.64
	銀行	5.25
	各種金融	4.14
	保険	3.06
	不動産	0.47
	ソフトウェア・サービス	11.77
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.48
	電気通信サービス	2.12
	公益事業	3.36
半導体・半導体製造装置	3.73	
	小計	93.64

投資証券		2.34
合計		95.97

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

令和 2年 6月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2009	買建	713	アメリカドル	109,742,349.24	11,823,640,707	108,652,287.5	11,706,197,455	2.48
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602009	買建	37	カナダドル	6,808,645.75	536,521,285	6,830,940	538,278,072	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2009	買建	544	ユーロ	17,465,706.6	2,114,747,755	17,527,680	2,122,251,494	0.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2009	買建	53	オーストラリアドル	7,851,645.75	580,079,588	7,694,275	568,453,037	0.12
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2009	買建	93	イギリスポンド	5,749,516.6	761,868,444	5,768,325	764,360,745	0.16
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2009	買建	51	スイスフラン	5,129,394.35	580,750,028	5,116,830	579,327,492	0.12

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

#### 新興国株式インデックスマザーファンド

#### 投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（％）
株式	香港	28,318,324,877	22.93
	アメリカ	19,041,448,089	15.42
	台湾	14,500,055,369	11.74
	韓国	13,768,526,625	11.15
	インド	9,615,400,462	7.78
	ブラジル	6,254,796,375	5.06
	中国	5,288,808,731	4.28
	南アフリカ	4,426,292,009	3.58
	サウジアラビア	3,210,567,619	2.60
	タイ	2,677,255,960	2.17

	マレーシア	2,087,676,406	1.69
	メキシコ	2,014,085,437	1.63
	インドネシア	1,756,112,137	1.42
	フィリピン	983,313,247	0.80
	カタール	978,307,280	0.79
	ポーランド	850,657,158	0.69
	チリ	707,637,242	0.57
	アラブ首長国連邦	611,938,200	0.50
	トルコ	538,502,994	0.44
	ハンガリー	276,645,300	0.22
	コロンビア	221,475,100	0.18
	ギリシャ	162,655,560	0.13
	チェコ	136,960,086	0.11
	イギリス	91,312,101	0.07
	小計	118,518,754,364	95.96
投資証券	メキシコ	52,880,981	0.04
	南アフリカ	46,842,208	0.04
	小計	99,723,189	0.08
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		4,893,458,086	3.96
純資産総額		123,511,935,639	100.00

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

#### その他の資産の投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,671,349,978	3.78

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### a 評価額上位30銘柄

令和 2年 6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	357,887	22,223.67	7,953,562,729	23,166.25	8,290,901,432	6.71
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	1,091,800	6,061.66	6,618,122,730	6,755.40	7,375,545,720	5.97



台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	4,691,000	1,099.45	5,157,559,496	1,138.80	5,342,110,800	4.33
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	909,180	4,381.39	3,983,474,589	4,716.00	4,287,692,880	3.47
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	84,574	19,071.56	1,612,958,371	19,396.98	1,640,480,220	1.33
香港	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	677,300	1,914.74	1,296,858,819	2,386.63	1,616,464,499	1.31
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	18,295,550	86.40	1,580,814,391	86.59	1,584,339,743	1.28
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	543,157	2,252.53	1,223,481,283	2,481.33	1,347,755,018	1.09
香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,132,000	1,099.93	1,245,122,582	1,081.42	1,224,167,440	0.99
アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	小売	161,934	5,281.64	855,277,682	6,419.14	1,039,478,507	0.84
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	1,171,000	818.64	958,630,417	720.02	843,143,420	0.68
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	314,092	2,402.01	754,452,417	2,507.25	787,509,052	0.64
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	103,648	7,623.92	790,204,317	7,524.00	779,847,552	0.63
ブラジル	株式	VALE SA	素材	699,330	970.71	678,848,418	1,108.70	775,351,297	0.63
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	11,604,350	71.60	830,975,221	66.02	766,177,209	0.62
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	2,376,272	288.12	684,658,402	310.98	738,973,067	0.60
アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	15,543	39,510.10	614,105,558	46,612.63	724,500,164	0.59
アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	52,385	10,816.16	566,604,815	13,067.78	684,555,896	0.55
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	649,044	985.82	639,842,901	1,053.72	683,910,644	0.55
アメリカ	株式	GAZPROM PJSC-SPON ADR	エネルギー	1,130,722	540.31	610,945,571	597.52	675,635,839	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	156,279	3,756.24	587,021,557	4,144.50	647,698,316	0.52
アメリカ	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	498,104	1,129.10	562,413,359	1,249.24	622,254,081	0.50
アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	76,498	7,253.32	554,864,588	8,117.13	620,944,333	0.50
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	15,203,000	40.58	617,037,004	40.17	610,719,713	0.49
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	287,236	1,519.43	436,435,243	2,062.25	592,352,441	0.48
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	23,495	19,478.71	457,652,482	23,760.00	558,241,200	0.45
アメリカ	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	73,261	5,902.02	432,388,595	7,265.98	532,313,371	0.43
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	172,110	2,796.93	481,380,502	3,026.37	520,869,573	0.42
韓国	株式	CELLTRION INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	18,115	19,246.98	348,659,170	27,990.00	507,038,850	0.41
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	157,131	2,954.88	464,304,467	3,143.44	493,933,128	0.40

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 6月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	5.81
	素材	6.61
	資本財	2.71
	商業・専門サービス	0.27
	運輸	1.47
	自動車・自動車部品	1.84
	耐久消費財・アパレル	1.16
	消費者サービス	1.60
	メディア・娯楽	9.12
	小売	12.09
	食品・生活必需品小売り	1.48
	食品・飲料・タバコ	3.50
	家庭用品・パーソナル用品	1.19
	ヘルスケア機器・サービス	1.25
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.89
	銀行	13.17
	各種金融	1.98
	保険	3.25
	不動産	2.42
	ソフトウェア・サービス	1.86
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.74
	電気通信サービス	3.73
公益事業	2.20	
半導体・半導体製造装置	6.63	
	小計	95.96
投資証券		0.08
合計		96.04

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

令和 2年 6月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額 (円)	評価金額	評価金額 (円)	投資比率 (%)
-------	----	------	-------	----	----	----	------	----------	------	----------	----------

株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 2009	買建	876	アメリカドル	43,250,324.6	4,659,789,972	43,357,620	4,671,349,978	3.78
----------	------	-------------	--------------	----	-----	--------	--------------	---------------	------------	---------------	------

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

## 日本株式インデックスマザーファンド

### 投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	2,432,369,910	99.16
投資証券	日本	35,178,300	1.43
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		14,588,351	0.59
純資産総額		2,452,959,859	100.00

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

### その他の資産の投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	31,170,000	1.27

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

令和 2年 6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	14,600	6,655.56	97,171,302	6,762.00	98,725,200	4.02
日本	株式	ソニー	電気機器	8,700	6,838.70	59,496,750	7,384.00	64,240,800	2.62
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	10,800	4,658.69	50,313,940	5,450.00	58,860,000	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	39,085.97	50,811,770	45,030.00	58,539,000	2.39
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	10,800	3,994.66	43,142,418	3,848.00	41,558,400	1.69
日本	株式	任天堂	その他製品	800	46,705.12	37,364,100	48,010.00	38,408,000	1.57

日本	株式	KDDI	情報・通信業	11,300	3,192.26	36,072,556	3,234.00	36,544,200	1.49
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	84,000	424.48	35,656,540	421.60	35,414,400	1.44
日本	株式	第一三共	医薬品	3,900	7,724.80	30,126,730	8,806.00	34,343,400	1.40
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	8,700	3,054.92	26,577,884	3,682.00	32,033,400	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	11,200	2,565.64	28,735,170	2,755.50	30,861,600	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	2,400	11,892.08	28,541,010	12,595.00	30,228,000	1.23
日本	株式	ダイキン工業	機械	1,700	13,833.29	23,516,600	17,335.00	29,469,500	1.20
日本	株式	花王	化学	3,300	8,745.00	28,858,520	8,540.00	28,182,000	1.15
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	9,000	2,803.66	25,232,957	3,032.00	27,288,000	1.11
日本	株式	HOYA	精密機器	2,600	9,950.95	25,872,480	10,260.00	26,676,000	1.09
日本	株式	中外製薬	医薬品	4,600	4,504.16	20,719,180	5,765.00	26,519,000	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,000	21,985.74	21,985,743	26,440.00	26,440,000	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	1,300	16,906.52	21,978,480	19,260.00	25,038,000	1.02
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	400	49,984.75	19,993,900	61,700.00	24,680,000	1.01
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,900	5,885.92	22,955,115	6,316.00	24,632,400	1.00
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	8,000	3,227.59	25,820,782	2,882.00	23,056,000	0.94
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	12,800	1,807.05	23,130,284	1,799.50	23,033,600	0.94
日本	株式	日立製作所	電気機器	6,600	3,114.81	20,557,810	3,403.00	22,459,800	0.92
日本	株式	日本電産	電気機器	3,100	5,885.06	18,243,700	7,196.00	22,307,600	0.91
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	8,800	2,507.37	22,064,910	2,515.50	22,136,400	0.90
日本	株式	S M C	機械	400	50,732.50	20,293,000	55,180.00	22,072,000	0.90
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	165,700	124.64	20,652,930	132.20	21,905,540	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	9,300	2,182.62	20,298,410	2,321.50	21,589,950	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	9,300	2,262.71	21,043,240	2,270.00	21,111,000	0.86

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 6月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	鉱業	0.19
	建設業	1.69
	食料品	3.52
	繊維製品	0.28
	パルプ・紙	0.12
	化学	7.08
	医薬品	7.94
	石油・石炭製品	0.45
	ゴム製品	0.62
	ガラス・土石製品	0.59
	鉄鋼	0.46
	非鉄金属	0.53

金属製品	0.30
機械	4.99
電気機器	17.53
輸送用機器	8.20
精密機器	2.91
その他製品	2.51
電気・ガス業	1.60
陸運業	4.04
海運業	0.07
空運業	0.14
倉庫・運輸関連業	0.06
情報・通信業	9.68
卸売業	3.92
小売業	4.45
銀行業	4.68
証券、商品先物取引業	0.76
保険業	2.28
その他金融業	1.01
不動産業	1.74
サービス業	4.81
小計	99.16
投資証券	1.43
合計	100.59

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

令和 2年 6月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 20年09月限	買建	2	円	32,361,100	31,170,000	1.27

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

#### 参考情報

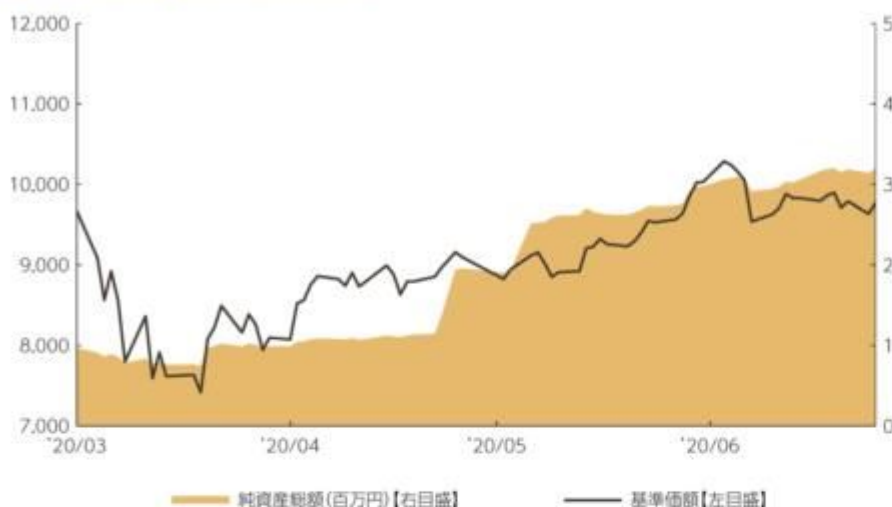


## 運用実績



2020年6月30日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2020年3月6日(設定日)～2020年6月30日



- ・基準価額は10,000を起点として表示
- ・基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

### ■基準価額・純資産

基準価額	9,767円
純資産総額	3.1百万円

### ■分配の推移

2020年6月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万円当たり、税引前

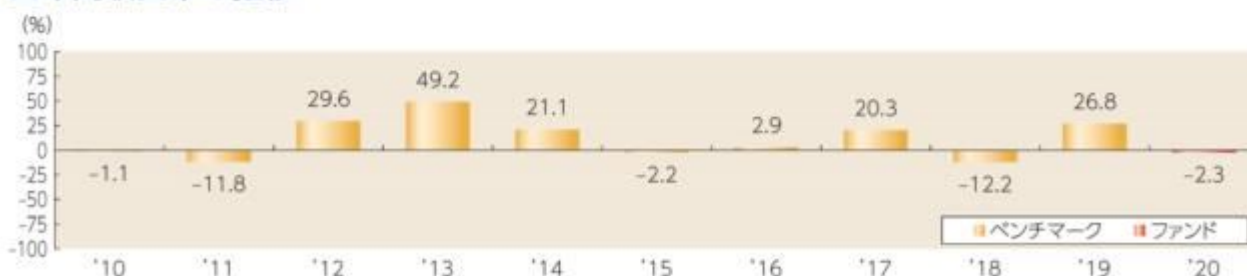
### ■主要な資産の状況

組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 アメリカドル	59.0%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェア・機器	アメリカ	3.2%
2 ユーロ	8.8%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	2.9%
3 円	8.1%	3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	2.3%
4 イギリスポンド	3.9%	4 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.2%
5 香港ドル	3.7%	5 FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.1%
6 スイスフラン	2.8%	6 ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	アメリカ	0.8%
7 カナダドル	2.7%	7 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフ	アメリカ	0.7%
8 オーストラリアドル	1.8%	8 TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	香港	0.7%
9 ニュー台湾ドル	1.4%	9 NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.7%
10 韓国ウォン	1.4%	10 VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.7%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	3.3%

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

### ■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2020年は設定日から6月30日までの収益率を表示
- ・2019年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

## 第3【ファンドの経理状況】

- 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、令和2年3月6日から令和2年6月25日までとしております。
- 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（令和2年3月6日から令和2年6月25日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【つみたて全世界株式】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)	
第1期	
[ 令和2年6月25日現在 ]	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	32,985
親投資信託受益証券	3,128,365
未収入金	258
流動資産合計	3,161,608
<b>資産合計</b>	<b>3,161,608</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	15,859
未払受託者報酬	139
未払委託者報酬	1,053
その他未払費用	1
流動負債合計	17,052
<b>負債合計</b>	<b>17,052</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	3,237,144
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	92,588
(分配準備積立金)	140,459
元本等合計	3,144,556
<b>純資産合計</b>	<b>3,144,556</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>3,161,608</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)	
第1期	
自 令和2年3月6日	
至 令和2年6月25日	
営業収益	

	第1期 自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日
有価証券売買等損益	143,431
営業収益合計	143,431
営業費用	
受託者報酬	139
委託者報酬	1,053
その他費用	1
営業費用合計	1,193
営業利益又は営業損失（ ）	142,238
経常利益又は経常損失（ ）	142,238
当期純利益又は当期純損失（ ）	142,238
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,779
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,129
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,129
剰余金減少額又は欠損金増加額	247,176
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	247,176
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	92,588

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第1期 [令和 2年 6月25日現在]
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	2,414,888円
期中一部解約元本額	177,744円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	92,588円
3. 受益権の総数	3,237,144口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

	第1期 自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日
1. 分配金の計算過程	



第1期 自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	13,790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	126,669円
収益調整金額	C	1,551円
分配準備積立金額	D	円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	142,010円
当ファンドの期末残存口数	F	3,237,144口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	438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

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [ 令和 2年 6月25日現在 ]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p>

区分	第1期 [ 令和 2年 6月25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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期 [ 令和 2年 6月25日現在 ]
	当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	144,204
合計	144,204

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第1期 [ 令和 2年 6月25日現在 ]
1口当たり純資産額	0.9714円
(1万口当たり純資産額)	(9,714円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	165,663	389,076	
	日本株式インデックスマザーファンド	222,050	222,582	
	外国株式インデックスマザーファンド	888,668	2,516,707	
合計		1,276,381	3,128,365	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 2年 6月25日現在 ]

資産の部	
流動資産	
預金	12,692,363,809
コール・ローン	1,525,562,396
株式	438,870,368,860
投資証券	10,950,452,444
派生商品評価勘定	6,095,376
未収入金	20,610,284
未収配当金	479,715,190
差入委託証拠金	5,908,518,302
流動資産合計	470,453,686,661
資産合計	470,453,686,661
負債の部	

[ 令和 2年 6月25日現在 ]

流動負債	
派生商品評価勘定	188,971,836
未払解約金	209,818,059
未払利息	2,237
流動負債合計	398,792,132
負債合計	398,792,132
純資産の部	
元本等	
元本	165,977,747,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	304,077,147,266
元本等合計	470,054,894,529
純資産合計	470,054,894,529
負債純資産合計	470,453,686,661

## 注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 貸借対照表に関する注記 )

	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1. 期首	令和 2年 3月 6日
期首元本額	167,672,520,165円
期中追加設定元本額	47,804,789,276円
期中一部解約元本額	49,499,562,178円
元本の内訳	
MAXIS 海外株式 (MSCI コクサイ) 上場投信	3,253,127,535円
MAXIS 全世界株式 (オール・カントリー) 上場投信	699,561,721円
ファンド・マネジャー (海外株式)	52,228,523円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,307,688,714円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	1,305,208,260円
eMAXIS バランス (波乗り型)	212,756,784円
コアバランス	159,412円

[令和 2年 6月25日現在]

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	36,675,852円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	60,930,659円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	43,931,280円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	36,679,987,915円
海外株式セレクション(ラップ向け)	1,041,076,896円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,369,537,495円
つみたて先進国株式	4,711,372,485円
つみたて8資産均等バランス	966,190,240円
つみたて4資産均等バランス	272,563,629円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,582,912円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,143,039円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,422,595円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	26,579,108円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	23,199,354円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	11,378,845円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	6,219,782,636円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	208,822,467円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	9,017,925,872円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	12,362,617円
先進国株式インデックスファンド(ラップ向け)	117,749,827円
つみたて全世界株式	888,668円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	17,106,437,760円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,638,159,898円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	587,302,109円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	1,009,318,427円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	415,143,515円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	204,830,698円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	335,488,826円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	207,253,120円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	62,035,083円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	77,864,318円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	284,896,775円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	201,730,820円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	431,116,817円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	31,005,905円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,844,927,974円

[令和 2年 6月25日現在]

三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	134,229,377円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,518,920,598円
MUAM 外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	18,523,208,048円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	2,063,462円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,239,819,580円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	8,098,774,077円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	23,715,417円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	120,635,807円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	1,110,601,694円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	444,222,326円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	737,230,088円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	52,619,336円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,000,167,268円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	65,754,581円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	2,361,938,144円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	693,812,173円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド(適格機関投資家限定)	6,289,418,433円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	173,310円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,049,858,090円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	1,325,042円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	5,026,361円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	3,038,600円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	5,415,865円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	50,615,459円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	7,985,585円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	64,545,213円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	11,467,378円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	73,119,428円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	5,244,567,093円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定型)	166,083,889円

	[令和 2年 6月25日現在]
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	620,537,955円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	610,193,833円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	551,316,368円
合計	165,977,747,263円
2. 受益権の総数	165,977,747,263口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	( 1 ) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 ( 2 ) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 ( 3 ) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	17,711,888,645
投資証券	319,908,095
合計	18,031,796,740

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

[ 令和 2年 6月25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	20,409,255,061		20,222,134,475	187,120,586
	合計	20,409,255,061		20,222,134,475	187,120,586

## （注）時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
 原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。



上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

[ 令和 2年 6月25日現在 ]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	1,029,436,048		1,034,103,000	4,666,952
	カナダドル	42,482,394		42,427,800	54,594
	オーストラリアドル	39,902,130		39,717,000	185,130
	イギリスポンド	69,369,280		69,175,600	193,680
	スイスフラン	43,991,220		44,038,800	47,580
	香港ドル	13,474,412		13,533,800	59,388
	シンガポールドル	4,600,200		4,614,000	13,800
	スウェーデンクローネ	24,319,740		24,252,800	66,940
	ノルウェークローネ	11,080,100		11,070,000	10,100
	デンマーククローネ	16,500,700		16,493,400	7,300
ユーロ	96,443,200		96,416,000	27,200	
売建					
ユーロ	36,157,350		36,156,000	1,350	
合計		1,427,756,774		1,431,998,200	4,244,126

### （注）時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
 （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

### （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

### （1口当たり情報）

		[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1口当たり純資産額		2.8320円
(1万口当たり純資産額)		(28,320円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	71,005	14.31	1,016,081.55	
	CABOT OIL & GAS CORP	44,274	17.92	793,390.08	
	CHENIERE ENERGY INC	25,546	46.62	1,190,954.52	
	CHEVRON CORP	207,934	87.64	18,223,335.76	
	CONCHO RESOURCES INC	21,930	51.61	1,131,807.30	
	CONOCOPHILLIPS	119,782	40.99	4,909,864.18	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	17,170	41.90	719,423.00	
	EOG RESOURCES INC	64,552	48.95	3,159,820.40	
	EXXON MOBIL CORP	468,161	44.50	20,833,164.50	
	HALLIBURTON CO	95,360	11.86	1,130,969.60	
	HESS CORP	30,590	48.96	1,497,686.40	
	HOLLYFRONTIER CORP	16,085	29.58	475,794.30	
	KINDER MORGAN INC	226,085	14.81	3,348,318.85	
	MARATHON PETROLEUM CORP	71,964	36.23	2,607,255.72	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	43,849	11.19	490,670.31	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,204	18.00	1,785,672.00	
	ONEOK INC	45,913	32.30	1,482,989.90	
	PHILLIPS 66	48,705	69.99	3,408,862.95	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,395	92.16	1,695,283.20	
	SCHLUMBERGER LTD	154,596	17.86	2,761,084.56	
	VALERO ENERGY CORP	45,359	58.02	2,631,729.18	
	WILLIAMS COS INC	134,671	18.84	2,537,201.64	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,432	233.14	5,696,076.48	
	ALBEMARLE CORP	11,163	73.32	818,471.16	
	AMCOR PLC	177,674	9.96	1,769,633.04	
	AVERY DENNISON CORP	9,205	112.29	1,033,629.45	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	23,266	21.44	498,823.04		
BALL CORP	36,048	68.98	2,486,591.04		
CELANESE CORP	14,056	82.96	1,166,085.76		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,432	27.84	624,506.88		

CORTEVA INC	82,944	26.07	2,162,350.08
CROWN HOLDINGS INC	14,764	62.29	919,649.56
DOW INC	82,149	38.45	3,158,629.05
DUPONT DE NEMOURS INC	81,929	51.54	4,222,620.66
EASTMAN CHEMICAL CO	14,286	66.85	955,019.10
ECOLAB INC	28,224	196.67	5,550,814.08
FMC CORP	14,131	96.63	1,365,478.53
FREEMPORT-MCMORAN INC	160,438	10.57	1,695,829.66
INTERNATIONAL PAPER CO	41,079	33.58	1,379,432.82
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,024	122.07	1,101,559.68
LINDE PLC	59,062	206.07	12,170,906.34
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,571	60.64	1,793,185.44
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,758	206.49	1,395,459.42
MOSAIC CO/THE	42,586	11.97	509,754.42
NEWMONT CORP	88,802	58.41	5,186,924.82
NUCOR CORP	33,406	40.67	1,358,622.02
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,156	97.94	1,092,618.64
PPG INDUSTRIES INC	26,119	101.88	2,661,003.72
RPM INTERNATIONAL INC	13,623	73.10	995,841.30
SEALED AIR CORP	16,288	31.41	511,606.08
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,187	566.65	5,205,813.55
STEEL DYNAMICS INC	23,112	25.87	597,907.44
VULCAN MATERIALS CO	14,657	118.06	1,730,405.42
WESTROCK CO	27,540	26.20	721,548.00
3M CO	63,639	152.22	9,687,128.58
AERCAP HOLDINGS NV	13,398	30.66	410,782.68
ALLEGION PLC	10,785	97.83	1,055,096.55
AMETEK INC	25,529	85.84	2,191,409.36
BOEING CO/THE	59,220	176.69	10,463,581.80
CARRIER GLOBAL CORP	90,930	21.82	1,984,092.60
CATERPILLAR INC	60,858	122.06	7,428,327.48
CUMMINS INC	16,711	166.61	2,784,219.71
DEERE & CO	32,964	150.49	4,960,752.36
DOVER CORP	15,749	91.89	1,447,175.61
EATON CORP PLC	45,797	84.01	3,847,405.97
EMERSON ELECTRIC CO	67,797	59.63	4,042,735.11
FASTENAL CO	63,681	41.34	2,632,572.54
FORTIVE CORP	33,605	66.01	2,218,266.05
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	14,546	59.30	862,577.80
GENERAL DYNAMICS CORP	27,251	146.45	3,990,908.95
GENERAL ELECTRIC CO	967,087	6.53	6,315,078.11
HD SUPPLY HOLDINGS INC	19,592	33.29	652,315.64

HEICO CORP	4,520	98.97	447,344.40
HEICO CORP-CLASS A	7,903	82.05	648,441.15
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	78,884	138.35	10,913,601.40
HOWMET AEROSPACE INC	40,938	14.62	598,513.56
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,873	167.22	814,863.06
IDEX CORP	8,293	148.76	1,233,666.68
ILLINOIS TOOL WORKS	35,252	169.03	5,958,645.56
INGERSOLL-RAND INC	39,321	27.50	1,081,327.50
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,703	82.88	1,218,584.64
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	24,600	41.66	1,024,836.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	23,100	21.96	507,276.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	84,468	33.29	2,811,939.72
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24,503	168.24	4,122,384.72
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,546	225.43	799,374.78
LOCKHEED MARTIN CORP	28,065	359.82	10,098,348.30
MASCO CORP	30,727	47.73	1,466,599.71
NORDSON CORP	6,495	184.69	1,199,561.55
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,627	301.91	5,321,767.57
OTIS WORLDWIDE CORP	45,415	55.54	2,522,349.10
OWENS CORNING	11,721	52.95	620,626.95
PACCAR INC	38,374	72.52	2,782,882.48
PARKER HANNIFIN CORP	14,262	173.72	2,477,594.64
PENTAIR PLC	17,292	36.29	627,526.68
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	167,720	61.72	10,351,678.40
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,922	205.03	2,649,397.66
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,757	386.93	4,549,136.01
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,056	35.17	564,689.52
SMITH (A.O.) CORP	14,381	45.11	648,726.91
SNAP-ON INC	5,594	130.82	731,807.08
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,118	131.09	2,243,998.62
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,106	307.65	1,263,210.90
TEXTRON INC	24,591	32.43	797,486.13
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,364	86.04	2,268,358.56
TRANSDIGM GROUP INC	5,662	433.90	2,456,741.80
UNITED RENTALS INC	7,877	142.43	1,121,921.11
WABTEC CORP	20,330	58.30	1,185,239.00
WW GRAINGER INC	5,045	294.79	1,487,215.55
XYLEM INC	19,937	62.45	1,245,065.65
CINTAS CORP	9,757	261.63	2,552,723.91
COPART INC	23,310	81.31	1,895,336.10
COSTAR GROUP INC	4,312	691.42	2,981,403.04
EQUIFAX INC	13,418	166.17	2,229,669.06

IHS MARKIT LTD	42,210	71.74	3,028,145.40
NIELSEN HOLDINGS PLC	40,926	14.13	578,284.38
REPUBLIC SERVICES INC	24,655	79.38	1,957,113.90
ROBERT HALF INTL INC	13,010	49.47	643,604.70
ROLLINS INC	15,543	41.10	638,817.30
TRANSUNION	20,876	84.62	1,766,527.12
VERISK ANALYTICS INC	17,168	163.69	2,810,229.92
WASTE CONNECTIONS INC	29,244	89.30	2,611,489.20
WASTE MANAGEMENT INC	46,950	101.37	4,759,321.50
AMERCO	901	294.34	265,200.34
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,264	78.54	1,120,294.56
CSX CORP	85,644	67.50	5,780,970.00
DELTA AIR LINES INC	17,365	27.34	474,759.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	18,454	73.62	1,358,583.48
FEDEX CORP	27,466	135.09	3,710,381.94
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9,802	117.04	1,147,226.08
KANSAS CITY SOUTHERN	10,566	142.58	1,506,500.28
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,834	41.56	533,381.04
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,555	169.15	4,830,078.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,505	163.34	1,715,886.70
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,232	32.25	491,232.00
UBER TECHNOLOGIES INC	105,216	30.46	3,204,879.36
UNION PACIFIC CORP	76,341	165.55	12,638,252.55
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	77,645	109.50	8,502,127.50
XPO LOGISTICS INC	10,923	75.51	824,795.73
APTIV PLC	29,682	74.62	2,214,870.84
AUTOLIV INC	8,580	62.88	539,510.40
BORGWARNER INC	22,366	33.18	742,103.88
FORD MOTOR CO	431,024	5.95	2,564,592.80
GENERAL MOTORS CO	142,122	25.28	3,592,844.16
LEAR CORP	6,934	107.21	743,394.14
TESLA INC	16,319	960.85	15,680,111.15
DR HORTON INC	38,501	54.09	2,082,519.09
GARMIN LTD	15,361	95.29	1,463,749.69
HASBRO INC	14,309	70.94	1,015,080.46
LENNAR CORP-A	30,418	59.04	1,795,878.72
LULULEMON ATHLETICA INC	13,698	295.22	4,043,923.56
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,344	99.29	729,185.76
NEWELL BRANDS INC	43,987	15.09	663,763.83
NIKE INC -CL B	137,307	100.08	13,741,684.56
NVR INC	381	3,186.84	1,214,186.04
PULTEGROUP INC	31,738	33.84	1,074,013.92

RALPH LAUREN CORP	5,268	70.65	372,184.20
VF CORP	37,124	59.03	2,191,429.72
WHIRLPOOL CORP	6,479	123.49	800,091.71
ARAMARK	26,004	22.68	589,770.72
CARNIVAL CORP	52,265	16.00	836,240.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,925	1,047.95	3,065,253.75
DARDEN RESTAURANTS INC	14,313	70.81	1,013,503.53
DOMINO'S PIZZA INC	4,252	375.48	1,596,540.96
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	30,813	73.19	2,255,203.47
LAS VEGAS SANDS CORP	38,079	44.94	1,711,270.26
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	30,621	85.00	2,602,785.00
MCDONALD'S CORP	82,451	184.29	15,194,894.79
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	21,705	15.84	343,807.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	50,663	16.93	857,724.59
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,022	48.24	917,621.28
STARBUCKS CORP	129,825	73.64	9,560,313.00
VAIL RESORTS INC	4,861	180.00	874,980.00
WYNN RESORTS LTD	10,693	75.21	804,220.53
YUM! BRANDS INC	33,315	86.56	2,883,746.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	85,017	75.58	6,425,584.86
ALPHABET INC-CL A	46,060	1,432.70	65,990,162.00
ALPHABET INC-CL C	21,055	1,431.97	30,150,128.35
ALTICE USA INC- A	39,800	23.55	937,290.00
CABLE ONE INC	541	1,753.15	948,454.15
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16,243	507.99	8,251,281.57
COMCAST CORP-CLASS A	502,436	38.56	19,373,932.16
DISCOVERY INC - A	13,916	21.71	302,185.94
DISCOVERY INC-C	39,779	19.68	782,850.72
DISH NETWORK CORP-A	26,666	34.41	917,577.06
ELECTRONIC ARTS INC	32,066	130.87	4,196,477.42
FACEBOOK INC-CLASS A	266,185	234.02	62,292,613.70
FOX CORP - CLASS A	36,914	27.38	1,010,705.32
FOX CORP - CLASS B	20,364	27.01	550,031.64
IAC/INTERACTIVECORP	8,748	302.00	2,641,896.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	39,684	16.44	652,404.96
LIBERTY BROADBAND-A	2,794	122.70	342,823.80
LIBERTY BROADBAND-C	11,838	123.99	1,467,793.62
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	9,306	34.32	319,381.92
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	18,469	33.86	625,360.34
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,539	31.55	711,105.45
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	19,071	44.18	842,556.78
MATCH GROUP INC	5,376	98.02	526,955.52

NETFLIX INC	48,543	457.85	22,225,412.55
NEWS CORP - CLASS A	40,789	11.67	476,007.63
OMNICOM GROUP	24,044	52.45	1,261,107.80
PINTEREST INC- CLASS A	43,202	23.17	1,000,990.34
ROKU INC	10,395	123.35	1,282,223.25
SIRIUS XM HOLDINGS INC	131,106	5.78	757,792.68
SNAP INC - A	96,875	23.63	2,289,156.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,437	139.87	1,739,563.19
TWITTER INC	86,804	31.73	2,754,290.92
VIACOMCBS INC - CLASS B	62,239	23.58	1,467,595.62
WALT DISNEY CO/THE	199,715	112.07	22,382,060.05
ZILLOW GROUP INC - C	15,539	59.30	921,462.70
ADVANCE AUTO PARTS INC	7,660	143.00	1,095,380.00
AMAZON.COM INC	46,814	2,734.40	128,008,201.60
AUTOZONE INC	2,616	1,100.21	2,878,149.36
BEST BUY CO INC	25,827	83.82	2,164,819.14
BOOKING HOLDINGS INC	4,543	1,610.33	7,315,729.19
BURLINGTON STORES INC	7,305	203.61	1,487,371.05
CARMAX INC	18,166	89.45	1,624,948.70
DOLLAR GENERAL CORP	28,186	191.85	5,407,484.10
DOLLAR TREE INC	26,260	90.10	2,366,026.00
EBAY INC	88,110	48.77	4,297,124.70
EXPEDIA GROUP INC	14,543	81.24	1,181,473.32
GENUINE PARTS CO	16,210	84.67	1,372,500.70
HOME DEPOT INC	120,665	246.13	29,699,276.45
LKQ CORP	32,537	24.78	806,266.86
LOWE'S COS INC	84,797	131.98	11,191,508.06
MERCADOLIBRE INC	4,956	953.77	4,726,884.12
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,301	413.92	3,435,949.92
ROSS STORES INC	39,777	87.05	3,462,587.85
TARGET CORP	56,075	119.72	6,713,299.00
TIFFANY & CO	11,860	121.44	1,440,278.40
TJX COMPANIES INC	133,196	51.53	6,863,589.88
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,035	131.34	1,712,016.90
ULTA BEAUTY INC	6,041	200.00	1,208,200.00
WAYFAIR INC- CLASS A	6,907	200.71	1,386,303.97
COSTCO WHOLESALE CORP	48,872	298.02	14,564,833.44
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,900	4.60	211,140.00
KROGER CO	88,718	32.82	2,911,724.76
SYSCO CORP	53,494	54.88	2,935,750.72
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	83,437	41.17	3,435,101.29
WALMART INC	156,923	120.30	18,877,836.90

ALTRIA GROUP INC	205,591	39.43	8,106,453.13
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	61,861	39.32	2,432,374.52
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	34,216	63.81	2,183,322.96
BUNGE LTD	17,109	41.19	704,719.71
CAMPBELL SOUP CO	21,449	48.86	1,047,998.14
COCA-COLA CO/THE	450,790	44.65	20,127,773.50
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	22,468	37.77	848,616.36
CONAGRA BRANDS INC	53,686	33.79	1,814,049.94
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,556	171.66	3,185,322.96
GENERAL MILLS INC	67,015	60.29	4,040,334.35
HERSHEY CO/THE	16,439	127.98	2,103,863.22
HORMEL FOODS CORP	32,746	47.76	1,563,948.96
INGREDION INC	7,111	82.17	584,310.87
JM SMUCKER CO/THE	12,237	106.24	1,300,058.88
KELLOGG CO	28,462	64.88	1,846,614.56
KEURIG DR PEPPER INC	36,810	28.40	1,045,404.00
KRAFT HEINZ CO/THE	74,405	32.13	2,390,632.65
LAMB WESTON HOLDINGS INC	16,942	63.05	1,068,193.10
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,736	172.27	2,366,300.72
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	20,500	36.50	748,250.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	158,562	50.64	8,029,579.68
MONSTER BEVERAGE CORP	44,648	68.07	3,039,189.36
PEPSICO INC	153,672	129.56	19,909,744.32
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	172,073	70.09	12,060,596.57
TYSON FOODS INC-CL A	32,740	59.44	1,946,065.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,271	76.25	2,079,413.75
CLOROX COMPANY	13,850	212.03	2,936,615.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	89,748	72.03	6,464,548.44
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	24,594	187.75	4,617,523.50
KIMBERLY-CLARK CORP	37,791	137.91	5,211,756.81
PROCTER & GAMBLE CO/THE	273,163	116.42	31,801,636.46
ABBOTT LABORATORIES	195,097	87.30	17,031,968.10
ABIOMED INC	4,821	241.66	1,165,042.86
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,295	257.65	2,137,206.75
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,897	98.84	1,670,099.48
ANTHEM INC	27,939	257.31	7,188,984.09
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,486	82.47	4,658,400.42
BECTON DICKINSON AND CO	30,000	232.81	6,984,300.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	154,433	33.85	5,227,557.05
CARDINAL HEALTH INC	32,347	52.01	1,682,367.47
CENTENE CORP	65,102	61.88	4,028,511.76
CERNER CORP	34,653	68.65	2,378,928.45



CIGNA CORP	41,274	183.97	7,593,177.78
COOPER COS INC/THE	5,459	281.39	1,536,108.01
CVS HEALTH CORP	144,328	63.18	9,118,643.04
DANAHER CORP	69,315	171.46	11,884,749.90
DAVITA INC	10,182	77.18	785,846.76
DENTSPLY SIRONA INC	25,680	42.86	1,100,644.80
DEXCOM INC	10,138	394.30	3,997,413.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	69,391	67.49	4,683,198.59
HCA HEALTHCARE INC	30,006	93.73	2,812,462.38
HENRY SCHEIN INC	15,663	56.18	879,947.34
HOLOGIC INC	29,198	53.67	1,567,056.66
HUMANA INC	14,630	371.80	5,439,434.00
IDEXX LABORATORIES INC	9,437	319.38	3,013,989.06
INSULET CORP	6,857	192.11	1,317,298.27
INTUITIVE SURGICAL INC	12,829	554.96	7,119,581.84
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,799	157.09	1,696,414.91
MASIMO CORP	5,474	222.07	1,215,611.18
MCKESSON CORP	17,923	150.56	2,698,486.88
MEDTRONIC PLC	148,197	88.93	13,179,159.21
MOLINA HEALTHCARE INC	6,399	172.88	1,106,259.12
QUEST DIAGNOSTICS INC	14,829	104.55	1,550,371.95
RESMED INC	16,014	181.86	2,912,306.04
STERIS PLC	9,391	149.04	1,399,634.64
STRYKER CORP	37,271	176.30	6,570,877.30
TELADOC HEALTH INC	7,595	197.01	1,496,290.95
TELEFLEX INC	5,139	355.31	1,825,938.09
UNITEDHEALTH GROUP INC	104,969	289.18	30,354,935.42
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,579	89.30	766,104.70
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,075	115.41	1,162,755.75
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14,667	234.31	3,436,624.77
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,194	216.51	1,774,082.94
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,846	118.22	2,700,854.12
ABBVIE INC	195,379	95.14	18,588,358.06
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34,530	86.56	2,988,916.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	24,556	111.95	2,749,044.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,505	151.76	1,897,758.80
AMGEN INC	65,238	232.51	15,168,487.38
AVANTOR INC	51,253	16.91	866,688.23
BEIGENE LTD-ADR	4,162	186.15	774,756.30
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,502	432.42	1,081,914.84
BIOGEN INC	19,270	263.04	5,068,780.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,963	120.63	2,408,136.69

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	249,885	57.76	14,433,357.60
CATALENT INC	16,500	70.47	1,162,755.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	44,433	21.40	950,866.20
ELI LILLY & CO	95,275	157.03	14,961,033.25
EXACT SCIENCES CORP	16,444	82.56	1,357,616.64
GILEAD SCIENCES INC	139,834	75.93	10,617,595.62
ILLUMINA INC	16,287	358.94	5,846,055.78
INCYTE CORP	20,395	104.33	2,127,810.35
IONIS PHARMACEUTICALS INC	15,180	59.10	897,138.00
IQVIA HOLDINGS INC	21,415	136.47	2,922,505.05
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,176	109.03	673,369.28
JOHNSON & JOHNSON	291,479	139.82	40,754,593.78
MERCK & CO. INC.	280,717	75.87	21,297,998.79
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,671	784.04	2,094,170.84
MODERNA INC	30,140	64.84	1,954,277.60
MYLAN NV	54,778	16.02	877,543.56
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,757	125.36	1,223,137.52
PERKINELMER INC	11,949	95.97	1,146,745.53
PERRIGO CO PLC	14,301	53.95	771,538.95
PFIZER INC	612,559	32.19	19,718,274.21
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,168	605.04	6,757,086.72
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,797	163.63	1,275,823.11
SEATTLE GENETICS INC	13,386	164.80	2,206,012.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	121,191	12.64	1,531,854.24
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	44,150	347.96	15,362,434.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,723	291.18	8,363,563.14
WATERS CORP	6,643	177.36	1,178,202.48
ZOETIS INC	52,584	134.30	7,062,031.20
BANK OF AMERICA CORP	868,844	23.81	20,687,175.64
CITIGROUP INC	232,945	50.81	11,835,935.45
CITIZENS FINANCIAL GROUP	47,066	24.08	1,133,349.28
COMERICA INC	15,052	37.45	563,697.40
EAST WEST BANCORP INC	16,395	35.05	574,644.75
FIFTH THIRD BANCORP	78,833	19.89	1,567,988.37
FIRST REPUBLIC BANK/CA	19,033	105.57	2,009,313.81
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,145	9.54	1,088,943.30
JPMORGAN CHASE & CO	339,976	94.66	32,182,128.16
KEYCORP	108,548	12.49	1,355,764.52
M & T BANK CORP	14,593	102.92	1,501,911.56
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	50,100	11.14	558,114.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	47,941	103.38	4,956,140.58
REGIONS FINANCIAL CORP	104,419	11.28	1,177,846.32
SIGNATURE BANK	5,429	101.29	549,903.41

SVB FINANCIAL GROUP	5,751	207.98	1,196,092.98
TRUIST FINANCIAL CORP	148,734	37.66	5,601,322.44
US BANCORP	151,626	36.87	5,590,450.62
WELLS FARGO & CO	430,668	26.12	11,249,048.16
ZIONS BANCORP NA	16,956	33.22	563,278.32
AGNC INVESTMENT CORP	58,318	12.82	747,636.76
ALLY FINANCIAL INC	41,566	18.31	761,073.46
AMERICAN EXPRESS CO	75,883	95.48	7,245,308.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,667	142.96	1,953,834.32
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	159,309	6.61	1,053,032.49
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,900	49.51	886,229.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	88,651	37.23	3,300,476.73
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	153,306	177.53	27,216,414.18
BLACKROCK INC	16,852	538.57	9,075,981.64
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	74,544	55.19	4,114,083.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	50,500	65.46	3,305,730.00
CARLYLE GROUP INC/THE	16,600	28.39	471,274.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,287	93.76	1,152,029.12
CME GROUP INC	39,654	167.47	6,640,855.38
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	34,107	50.81	1,732,976.67
E*TRADE FINANCIAL CORP	33,164	48.31	1,602,152.84
EQUITABLE HOLDINGS INC	45,959	18.81	864,488.79
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,196	297.21	1,247,093.16
FRANKLIN RESOURCES INC	33,923	20.82	706,276.86
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36,298	198.02	7,187,729.96
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	61,226	90.71	5,553,810.46
INVESCO LTD	42,877	10.72	459,641.44
KKR & CO INC	55,728	30.31	1,689,115.68
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,204	505.19	2,123,818.76
MOODY'S CORP	18,654	265.53	4,953,196.62
MORGAN STANLEY	132,554	46.95	6,223,410.30
MSCI INC	9,392	328.36	3,083,957.12
NASDAQ INC	12,754	115.28	1,470,281.12
NORTHERN TRUST CORP	22,049	77.18	1,701,741.82
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,818	68.41	945,289.38
S&P GLOBAL INC	26,947	317.97	8,568,337.59
SCHWAB (CHARLES) CORP	128,131	33.80	4,330,827.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	15,024	53.30	800,779.20
STATE STREET CORP	39,227	61.63	2,417,560.01
SYNCHRONY FINANCIAL	61,090	22.09	1,349,478.10
T ROWE PRICE GROUP INC	26,139	121.04	3,163,864.56
TD AMERITRADE HOLDING CORP	30,044	36.48	1,096,005.12

TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,686	60.85	589,393.10
VOYA FINANCIAL INC	14,125	45.33	640,286.25
AFLAC INC	75,957	35.17	2,671,407.69
ALLEGHANY CORP	1,594	467.08	744,525.52
ALLSTATE CORP	35,034	92.95	3,256,410.30
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,675	60.34	523,449.50
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	96,614	30.30	2,927,404.20
AON PLC-CLASS A	25,612	187.53	4,803,018.36
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,012	28.45	1,280,591.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,851	94.78	1,976,257.78
ASSURANT INC	7,109	100.68	715,734.12
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	17,062	31.01	529,092.62
BROWN & BROWN INC	26,416	40.05	1,057,960.80
CHUBB LTD	49,971	126.17	6,304,841.07
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,189	62.01	1,065,889.89
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,491	183.41	456,874.31
EVEREST RE GROUP LTD	4,537	206.00	934,622.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	32,377	30.37	983,289.49
GLOBE LIFE INC	11,395	71.19	811,210.05
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,672	37.86	1,501,981.92
LINCOLN NATIONAL CORP	21,525	36.04	775,761.00
LOEWS CORP	30,087	33.17	997,985.79
MARKEL CORP	1,532	895.15	1,371,369.80
MARSH & MCLENNAN COS	55,728	103.93	5,791,811.04
METLIFE INC	85,971	35.53	3,054,549.63
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	30,428	39.54	1,203,123.12
PROGRESSIVE CORP	64,755	77.29	5,004,913.95
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	43,924	59.70	2,622,262.80
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	7,809	76.63	598,403.67
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,351	172.22	921,549.22
TRAVELERS COS INC/THE	28,207	112.86	3,183,442.02
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,260	190.85	2,721,521.00
WR BERKLEY CORP	15,903	55.74	886,433.22
CBRE GROUP INC - A	36,795	42.75	1,572,986.25
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	123,100	4.13	508,403.00
JONES LANG LASALLE INC	6,176	100.76	622,293.76
ACCENTURE PLC-CL A	70,219	201.84	14,173,002.96
ADOBE INC	53,346	431.68	23,028,401.28
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	18,009	100.97	1,818,368.73
ANSYS INC	9,533	285.25	2,719,288.25
AUTODESK INC	24,347	233.44	5,683,563.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	47,774	144.84	6,919,586.16

AVALARA INC	8,809	131.13	1,155,124.17
BLACK KNIGHT INC	16,202	71.07	1,151,476.14
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15,141	77.20	1,168,885.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	12,522	122.70	1,536,449.40
CADENCE DESIGN SYS INC	31,097	91.99	2,860,613.03
CDK GLOBAL INC	13,633	39.89	543,820.37
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12,879	105.02	1,352,552.58
CITRIX SYSTEMS INC	12,844	142.17	1,826,031.48
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	60,760	53.80	3,268,888.00
COUPA SOFTWARE INC	7,346	257.91	1,894,606.86
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,895	103.70	1,129,811.50
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,822	96.75	369,778.50
DATADOG INC - CLASS A	12,513	88.50	1,107,400.50
DOCUSIGN INC	18,895	163.91	3,097,079.45
DROPBOX INC-CLASS A	26,831	22.64	607,453.84
DYNATRACE INC	15,534	42.34	657,709.56
EPAM SYSTEMS INC	6,152	247.50	1,522,620.00
FAIR ISAAC CORP	3,141	409.06	1,284,857.46
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	68,236	132.30	9,027,622.80
FISERV INC	64,003	96.61	6,183,329.83
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9,464	246.39	2,331,834.96
FORTINET INC	16,260	134.33	2,184,205.80
GARTNER INC	9,943	115.66	1,150,007.38
GLOBAL PAYMENTS INC	33,203	166.91	5,541,912.73
GODADDY INC - CLASS A	19,332	75.59	1,461,305.88
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,877	106.81	1,054,962.37
INTL BUSINESS MACHINES CORP	98,221	116.42	11,434,888.82
INTUIT INC	28,819	286.13	8,245,980.47
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,300	179.69	1,491,427.00
LEIDOS HOLDINGS INC	14,969	93.25	1,395,859.25
MASTERCARD INC - A	98,984	294.01	29,102,285.84
MICROSOFT CORP	799,398	197.84	158,152,900.32
MONGODB INC	4,869	217.84	1,060,662.96
NORTONLIFELOCK INC	63,188	19.74	1,247,331.12
OKTA INC	12,594	195.82	2,466,157.08
ORACLE CORP	248,300	54.44	13,517,452.00
PALO ALTO NETWORKS INC	11,061	223.40	2,471,027.40
PAYCHEX INC	35,778	71.46	2,556,695.88
PAYCOM SOFTWARE INC	5,557	312.57	1,736,951.49
PAYPAL HOLDINGS INC	123,297	168.00	20,713,896.00
PTC INC	12,907	76.92	992,806.44
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,059	267.58	2,156,427.22

SALESFORCE.COM INC	93,259	185.55	17,304,207.45
SERVICENOW INC	21,013	392.93	8,256,638.09
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	32,203	31.97	1,029,529.91
SPLUNK INC	17,284	190.61	3,294,503.24
SQUARE INC - A	39,311	100.88	3,965,693.68
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25,624	55.49	1,421,875.76
SYNOPSYS INC	16,672	189.20	3,154,342.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	4,474	396.37	1,773,359.38
TWILIO INC - A	13,147	212.17	2,789,398.99
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,388	338.47	1,485,206.36
VERISIGN INC	11,630	202.73	2,357,749.90
VISA INC-CLASS A SHARES	188,724	191.41	36,123,660.84
VMWARE INC-CLASS A	9,063	152.73	1,384,191.99
WESTERN UNION CO	45,586	20.95	955,026.70
WIX.COM LTD	5,418	241.28	1,307,255.04
WORKDAY INC-CLASS A	18,527	180.07	3,336,156.89
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,971	255.90	3,063,378.90
AMPHENOL CORP-CL A	33,180	94.61	3,139,159.80
APPLE INC	484,116	360.06	174,310,806.96
ARISTA NETWORKS INC	6,143	209.25	1,285,422.75
ARROW ELECTRONICS INC	8,551	64.81	554,190.31
CDW CORP/DE	15,886	111.49	1,771,130.14
CISCO SYSTEMS INC	469,395	44.75	21,005,426.25
COGNEX CORP	18,701	57.89	1,082,600.89
CORNING INC	84,678	25.81	2,185,539.18
DELL TECHNOLOGIES -C	25,732	53.10	1,366,369.20
F5 NETWORKS INC	6,713	135.01	906,322.13
FLIR SYSTEMS INC	15,771	38.94	614,122.74
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	139,430	9.27	1,292,516.10
HP INC	158,902	16.20	2,574,212.40
IPG PHOTONICS CORP	3,916	157.21	615,634.36
JUNIPER NETWORKS INC	36,520	22.38	817,317.60
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20,963	101.23	2,122,084.49
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,943	139.30	2,638,759.90
NETAPP INC	23,155	40.97	948,660.35
SEAGATE TECHNOLOGY	25,795	47.62	1,228,357.90
TE CONNECTIVITY LTD	37,112	78.07	2,897,333.84
TRIMBLE INC	27,774	42.67	1,185,116.58
WESTERN DIGITAL CORP	33,281	42.25	1,406,122.25
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6,019	250.50	1,507,759.50
AT&T INC	793,287	29.42	23,338,503.54
CENTURYLINK INC	107,816	9.74	1,050,127.84

LIBERTY GLOBAL PLC- C	43,975	21.43	942,384.25
LIBERTY GLOBAL PLC-A	20,125	22.01	442,951.25
T-MOBILE US INC	47,535	108.43	5,154,220.05
T-MOBILE US INC - RIGHTS	47,535	0.37	17,587.95
VERIZON COMMUNICATIONS INC	457,189	53.93	24,656,202.77
AES CORP	73,988	13.84	1,023,993.92
ALLIANT ENERGY CORP	27,248	47.12	1,283,925.76
AMEREN CORPORATION	27,283	69.46	1,895,077.18
AMERICAN ELECTRIC POWER	54,586	80.71	4,405,636.06
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,027	124.40	2,491,358.80
ATMOS ENERGY CORP	13,053	98.96	1,291,724.88
CENTERPOINT ENERGY INC	57,809	18.33	1,059,638.97
CMS ENERGY CORP	31,456	57.40	1,805,574.40
CONSOLIDATED EDISON INC	36,952	71.53	2,643,176.56
DOMINION ENERGY INC	92,651	82.58	7,651,119.58
DTE ENERGY COMPANY	21,305	105.27	2,242,777.35
DUKE ENERGY CORP	80,964	80.47	6,515,173.08
EDISON INTERNATIONAL	40,127	54.37	2,181,704.99
ENTERGY CORP	22,147	93.51	2,070,965.97
ESSENTIAL UTILITIES INC	23,727	41.43	983,009.61
EVERGY INC	25,160	59.04	1,485,446.40
EVERSOURCE ENERGY	36,514	82.42	3,009,483.88
EXELON CORP	107,805	36.47	3,931,648.35
FIRSTENERGY CORP	59,951	37.78	2,264,948.78
NEXTERA ENERGY INC	54,054	241.67	13,063,230.18
NISOURCE INC	40,974	22.40	917,817.60
NRG ENERGY INC	26,152	32.57	851,770.64
OGE ENERGY CORP	24,702	30.34	749,458.68
PINNACLE WEST CAPITAL	12,778	71.62	915,160.36
PPL CORP	84,952	25.52	2,167,975.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55,919	48.16	2,693,059.04
SEMPRA ENERGY	32,331	120.04	3,881,013.24
SOUTHERN CO/THE	116,433	52.38	6,098,760.54
UGI CORP	23,063	30.82	710,801.66
VISTRA ENERGY CORP	52,196	18.61	971,367.56
WEC ENERGY GROUP INC	34,915	86.79	3,030,272.85
XCEL ENERGY INC	58,037	63.68	3,695,796.16
ADVANCED MICRO DEVICES	129,462	52.39	6,782,514.18
ANALOG DEVICES INC	40,811	119.47	4,875,690.17
APPLIED MATERIALS INC	101,702	59.97	6,099,068.94
BROADCOM INC	44,200	306.97	13,568,074.00
INTEL CORP	473,171	59.09	27,959,674.39

	KLA CORP	17,384	188.62	3,278,970.08
	LAM RESEARCH CORP	16,133	305.78	4,933,148.74
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	74,380	33.63	2,501,399.40
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	29,361	59.91	1,759,017.51
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,569	101.08	2,685,594.52
	MICRON TECHNOLOGY INC	123,079	48.29	5,943,484.91
	NVIDIA CORP	67,715	369.42	25,015,275.30
	NXP SEMICONDUCTORS NV	30,916	113.06	3,495,362.96
	ON SEMICONDUCTOR CORP	45,431	19.29	876,363.99
	QORVO INC	12,862	108.52	1,395,784.24
	QUALCOMM INC	126,432	89.14	11,270,148.48
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,862	126.41	2,384,345.42
	TERADYNE INC	18,691	81.36	1,520,699.76
	TEXAS INSTRUMENTS INC	103,289	123.99	12,806,803.11
	XILINX INC	27,595	92.89	2,563,299.55
	アメリカドル 小計	32,867,208		2,903,369,463.81 (310,834,734,795)
カナダドル	CAMECO CORP	38,400	13.20	506,880.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	131,500	23.42	3,079,730.00
	CENOVUS ENERGY INC	105,800	6.22	658,076.00
	ENBRIDGE INC	224,100	40.99	9,185,859.00
	IMPERIAL OIL LTD	28,300	21.49	608,167.00
	INTER PIPELINE LTD	47,200	12.30	580,560.00
	KEYERA CORP	23,600	20.58	485,688.00
	PARKLAND CORP	15,800	33.38	527,404.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	59,832	32.66	1,954,113.12
	SUNCOR ENERGY INC	170,200	22.75	3,872,050.00
	TC ENERGY CORP	104,000	58.75	6,110,000.00
	AGNICO EAGLE MINES LTD	26,100	83.85	2,188,485.00
	B2GOLD CORP	125,100	7.28	910,728.00
	BARRICK GOLD CORP	195,300	35.05	6,845,265.00
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	18,800	44.50	836,600.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	75,600	9.67	731,052.00
	FRANCO-NEVADA CORP	20,700	183.58	3,800,106.00
	KINROSS GOLD CORP	136,000	9.13	1,241,680.00
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	28,500	52.33	1,491,405.00
	LUNDIN MINING CORP	62,100	6.75	419,175.00
	NUTRIEN LTD	63,259	45.71	2,891,568.89
	PAN AMERICAN SILVER CORP	25,000	37.86	946,500.00
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	53,700	13.92	747,504.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	48,600	56.58	2,749,788.00
	YAMANA GOLD INC	114,800	6.99	802,452.00



CAE INC	28,400	21.73	617,132.00
WSP GLOBAL INC	11,800	81.85	965,830.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13,100	55.20	723,120.00
THOMSON REUTERS CORP	19,332	90.93	1,757,858.76
AIR CANADA	12,400	17.19	213,156.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	78,900	116.47	9,189,483.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	15,200	334.62	5,086,224.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,100	58.80	1,887,480.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	22,200	20.82	462,204.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	31,210	74.07	2,311,724.70
QUEBECOR INC -CL B	18,300	28.99	530,517.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	54,700	22.31	1,220,357.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,800	117.95	684,110.00
DOLLARAMA INC	34,700	45.39	1,575,033.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	96,200	42.36	4,075,032.00
EMPIRE CO LTD 'A'	17,200	32.29	555,388.00
LOBLAW COMPANIES LTD	21,500	66.13	1,421,795.00
METRO INC/CN	27,700	55.69	1,542,613.00
WESTON (GEORGE) LTD	8,411	97.40	819,231.40
SAPUTO INC	27,600	32.46	895,896.00
BAUSCH HEALTH COS INC	37,600	25.27	950,152.00
CANOPY GROWTH CORP	21,700	22.77	494,109.00
CRONOS GROUP INC	25,600	8.74	223,744.00
BANK OF MONTREAL	71,000	73.95	5,250,450.00
BANK OF NOVA SCOTIA	134,300	55.64	7,472,452.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,400	92.64	4,576,416.00
NATIONAL BANK OF CANADA	37,400	61.98	2,318,052.00
ROYAL BANK OF CANADA	157,400	91.71	14,435,154.00
TORONTO-DOMINION BANK	200,300	60.29	12,076,087.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	148,050	44.72	6,620,796.00
CI FINANCIAL CORP	21,000	16.92	355,320.00
IGM FINANCIAL INC	8,800	32.41	285,208.00
ONEX CORPORATION	9,400	58.79	552,626.00
TMX GROUP LTD	6,700	129.52	867,784.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,000	421.17	1,263,510.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	30,400	24.16	734,464.00
IA FINANCIAL CORP INC	11,700	45.88	536,796.00
INTACT FINANCIAL CORP	15,800	130.13	2,056,054.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	215,100	18.20	3,914,820.00
POWER CORP OF CANADA	62,600	24.83	1,554,358.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	65,000	48.82	3,173,300.00
BLACKBERRY LTD	52,200	6.69	349,218.00

	CGI INC	26,800	84.25	2,257,900.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,200	1,500.00	3,300,000.00	
	OPEN TEXT CORP	30,300	57.85	1,752,855.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	11,600	1,220.97	14,163,252.00	
	BCE INC	17,700	56.52	1,000,404.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	39,000	55.28	2,155,920.00	
	TELUS CORP	50,100	22.83	1,143,783.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	54,800	17.96	984,208.00	
	ALTAGAS LTD	28,700	15.63	448,581.00	
	ATCO LTD -CLASS I	10,400	39.14	407,056.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	13,400	32.49	435,366.00	
	EMERA INC	26,400	52.84	1,394,976.00	
	FORTIS INC	51,400	51.04	2,623,456.00	
	HYDRO ONE LTD	36,100	25.57	923,077.00	
	カナダドル 小計	4,302,394		193,756,724.87 (15,225,403,440)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	28,939	28.50	824,761.50	
	OIL SEARCH LTD	220,605	3.29	725,790.45	
	ORIGIN ENERGY LTD	181,897	6.00	1,091,382.00	
	SANTOS LTD	184,286	5.36	987,772.96	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,472	19.62	342,800.64	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	106,087	21.58	2,289,357.46	
	BHP GROUP LTD	325,647	35.90	11,690,727.30	
	BLUESCOPE STEEL LTD	52,559	11.63	611,261.17	
	EVOLUTION MINING LTD	192,818	5.61	1,081,708.98	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	187,082	14.24	2,664,047.68	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	46,413	27.60	1,280,998.80	
	NEWCREST MINING LTD	88,999	31.56	2,808,808.44	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	87,919	14.10	1,239,657.90	
	ORICA LTD	42,434	16.72	709,496.48	
	RIO TINTO LTD	40,987	98.68	4,044,597.16	
	SOUTH32 LTD	583,896	2.05	1,196,986.80	
	CIMIC GROUP LTD	14,688	24.28	356,624.64	
	BRAMBLES LTD	171,486	10.76	1,845,189.36	
	AURIZON HOLDINGS LTD	221,393	4.82	1,067,114.26	
	QANTAS AIRWAYS LTD	76,723	4.19	321,469.37	
	SYDNEY AIRPORT	126,628	5.82	736,974.96	
	TRANSURBAN GROUP	302,975	14.30	4,332,542.50	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	67,759	26.19	1,774,608.21	
CROWN RESORTS LTD	38,274	9.89	378,529.86		
TABCORP HOLDINGS LTD	209,211	3.46	723,870.06		
REA GROUP LTD	5,181	107.00	554,367.00		

	SEEK LTD	35,923	21.81	783,480.63
	WESFARMERS LTD	125,614	43.89	5,513,198.46
	COLES GROUP LTD	148,017	16.60	2,457,082.20
	WOOLWORTHS GROUP LTD	139,702	36.12	5,046,036.24
	COCA-COLA AMATIL LTD	51,988	8.98	466,852.24
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,600	10.85	863,660.00
	COCHLEAR LTD	7,156	193.18	1,382,396.08
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,946	67.06	1,270,518.76
	SONIC HEALTHCARE LTD	47,805	30.33	1,449,925.65
	CSL LTD	50,213	292.36	14,680,272.68
	AUST AND NZ BANKING GROUP	314,070	18.83	5,913,938.10
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	195,750	69.24	13,553,730.00
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	354,059	18.55	6,567,794.45
	WESTPAC BANKING CORP	399,948	18.06	7,223,060.88
	AMP LTD	432,472	1.85	800,073.20
	ASX LTD	20,986	85.01	1,784,019.86
	MACQUARIE GROUP LTD	37,336	121.59	4,539,684.24
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	13,707	58.08	796,102.56
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	253,310	5.88	1,489,462.80
	MEDIBANK PRIVATE LTD	290,951	3.06	890,310.06
	QBE INSURANCE GROUP LTD	161,295	8.86	1,429,073.70
	SUNCORP GROUP LTD	138,978	9.62	1,336,968.36
	LENDLEASE GROUP	80,199	12.92	1,036,171.08
	AFTERPAY LTD	25,400	59.38	1,508,252.00
	COMPUTERSHARE LTD	50,087	13.33	667,659.71
	WISETECH GLOBAL LTD	11,584	22.11	256,122.24
	TELSTRA CORP LTD	457,264	3.16	1,444,954.24
	TPG TELECOM LTD	34,115	9.02	307,717.30
	AGL ENERGY LTD	73,209	17.19	1,258,462.71
	APA GROUP	130,000	11.74	1,526,200.00
	AUSNET SERVICES	190,003	1.72	326,805.16
	オーストラリアドル 小計	7,992,045		134,251,431.53 (9,875,535,303)
イギリスポンド	BP PLC	2,241,723	3.07	6,889,935.64
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	456,296	13.24	6,045,009.40
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	411,403	12.68	5,216,590.04
	ANGLO AMERICAN PLC	135,257	18.28	2,472,497.96
	ANTOFAGASTA PLC	39,469	9.05	357,273.38
	BHP GROUP PLC	233,416	16.22	3,786,941.18
	CRODA INTERNATIONAL PLC	14,607	51.24	748,462.68
	EVRAZ PLC	56,606	2.98	169,025.51
	GLENCORE PLC	1,101,388	1.66	1,835,793.51

JOHNSON MATTHEY PLC	23,710	20.75	491,982.50
MONDI PLC	52,780	15.05	794,339.00
RIO TINTO PLC	123,830	44.95	5,566,158.50
ASHTED GROUP PLC	49,475	26.80	1,325,930.00
BAE SYSTEMS PLC	354,749	4.79	1,701,376.20
BUNZL PLC	39,884	20.62	822,408.08
DCC PLC	11,203	67.56	756,874.68
FERGUSON PLC	24,942	63.46	1,582,819.32
MELROSE INDUSTRIES PLC	565,432	1.14	648,833.22
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	213,636	3.00	641,335.27
SMITHS GROUP PLC	47,981	12.45	597,603.35
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,618	97.30	838,531.40
EXPERIAN PLC	100,294	28.06	2,814,249.64
INTERTEK GROUP PLC	18,273	53.84	983,818.32
RELX PLC	213,454	18.58	3,967,042.59
RENTOKIL INITIAL PLC	215,505	4.91	1,059,853.59
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	111,911	4.92	551,385.49
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	13,870	43.46	602,790.20
BURBERRY GROUP PLC	43,565	15.07	656,742.37
PERSIMMON PLC	34,819	22.59	786,561.21
TAYLOR WIMPEY PLC	418,238	1.42	595,152.67
COMPASS GROUP PLC	197,479	11.13	2,197,941.27
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,970	111.20	663,864.00
GVC HOLDINGS PLC	62,983	7.68	483,835.40
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	18,865	36.47	688,006.55
WHITBREAD PLC	17,823	22.04	392,818.92
AUTO TRADER GROUP PLC	100,945	5.25	530,768.81
INFORMA PLC	158,442	4.63	734,695.55
ITV PLC	385,089	0.74	285,736.03
PEARSON PLC	86,984	5.58	485,370.72
WPP PLC	143,982	6.25	900,751.39
JD SPORTS FASHION PLC	45,700	6.12	279,684.00
KINGFISHER PLC	231,025	2.13	492,314.27
NEXT PLC	15,223	49.00	745,927.00
OCADO GROUP PLC	49,758	19.87	988,691.46
SAINSBURY (J) PLC	185,058	2.05	379,924.07
TESCO PLC	1,083,761	2.27	2,463,388.75
WM MORRISON SUPERMARKETS	263,276	1.90	502,725.52
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	40,366	18.85	760,899.10
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	253,733	30.55	7,751,543.15
COCA-COLA HBC AG-DI	22,214	20.72	460,274.08
DIAGEO PLC	258,300	27.03	6,981,849.00

	IMPERIAL BRANDS PLC	104,736	15.20	1,592,510.88	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	78,502	71.28	5,595,622.56	
	UNILEVER PLC	129,106	44.80	5,783,948.80	
	SMITH & NEPHEW PLC	96,649	14.90	1,440,070.10	
	ASTRAZENECA PLC	145,200	83.44	12,115,488.00	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	554,959	16.34	9,071,359.81	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,313	23.00	398,199.00	
	BARCLAYS PLC	1,915,391	1.11	2,142,556.37	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,246,649	3.80	8,555,239.39	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,772,549	0.31	2,456,902.73	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	577,894	1.19	691,739.11	
	STANDARD CHARTERED PLC	300,113	4.20	1,262,575.39	
	3I GROUP PLC	112,735	7.88	888,351.80	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	37,749	16.17	610,590.07	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	34,805	80.14	2,789,272.70	
	M&G PLC	312,047	1.59	497,870.98	
	SCHRODERS PLC	13,260	28.62	379,501.20	
	ST JAMES'S PLACE PLC	60,295	9.25	558,211.11	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	253,774	2.54	646,362.37	
	ADMIRAL GROUP PLC	20,702	23.05	477,181.10	
	AVIVA PLC	431,668	2.69	1,161,618.58	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	152,128	2.68	408,007.29	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	658,823	2.13	1,404,610.63	
	PRUDENTIAL PLC	287,400	11.78	3,385,572.00	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	116,152	4.13	479,940.06	
	AVEVA GROUP PLC	6,135	40.99	251,473.65	
	SAGE GROUP PLC/THE	117,215	6.70	786,043.79	
	HALMA PLC	40,999	22.43	919,607.57	
	BT GROUP PLC	982,218	1.16	1,143,301.75	
	VODAFONE GROUP PLC	2,955,650	1.25	3,695,744.76	
	NATIONAL GRID PLC	387,080	9.60	3,719,064.64	
	SEVERN TRENT PLC	26,963	24.90	671,378.70	
	SSE PLC	113,590	13.57	1,541,416.30	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	80,912	9.55	772,871.42	
	イギリスボンド 小計	32,144,671		162,772,530.55 (21,655,257,464)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	20,025	18.07	361,851.75	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	891	719.00	640,629.00	
	GIVAUDAN-REG	1,025	3,386.00	3,470,650.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	58,022	40.31	2,338,866.82	
	SIKA AG-REG	15,753	181.05	2,852,080.65	
	ABB LTD-REG	204,339	20.81	4,252,294.59	

	GEBERIT AG-REG	4,115	466.30	1,918,824.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,238	221.00	494,598.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,544	222.70	1,011,948.80
	ADECCO GROUP AG-REG	18,283	43.80	800,795.40
	SGS SA-REG	672	2,271.00	1,526,112.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6,079	157.30	956,226.70
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	57,814	60.86	3,518,560.04
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	3,350	187.20	627,120.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	6,832	36.60	250,051.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	331	1,826.00	604,406.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	114	7,640.00	870,960.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	11	80,500.00	885,500.00
	NESTLE SA-REG	329,283	104.78	34,502,272.74
	ALCON INC	54,485	54.68	2,979,239.80
	SONOVA HOLDING AG-REG	6,125	188.90	1,157,012.50
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,117	757.80	846,462.60
	LONZA GROUP AG-REG	8,286	492.00	4,076,712.00
	NOVARTIS AG-REG	237,885	84.41	20,079,872.85
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	77,764	332.20	25,833,200.80
	VIFOR PHARMA AG	4,879	149.05	727,214.95
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,582	91.50	327,753.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	269,457	9.49	2,558,224.75
	JULIUS BAER GROUP LTD	24,273	39.78	965,579.94
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,892	71.10	276,721.20
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,065	838.00	1,730,470.00
	UBS GROUP AG-REG	405,528	10.45	4,237,767.60
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,758	140.40	668,023.20
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,563	345.20	1,229,947.60
	SWISS RE AG	32,555	72.02	2,344,611.10
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,537	327.50	5,415,867.50
	SWISS PRIME SITE-REG	7,995	88.15	704,759.25
	TEMENOS AG - REG	7,007	140.30	983,082.10
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17,242	59.22	1,021,071.24
	SWISSCOM AG-REG	2,817	492.50	1,387,372.50
	スイスフラン 小計	1,925,533		141,434,714.67 (15,970,807,980)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	300,868	50.65	15,238,964.20
	NWS HOLDINGS LTD	214,500	6.68	1,432,860.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	153,000	75.80	11,597,400.00
	MTR CORP	178,500	40.40	7,211,400.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	241,000	53.15	12,809,150.00
	SANDS CHINA LTD	272,800	31.35	8,552,280.00

	SJM HOLDINGS LTD	210,000	8.90	1,869,000.00	
	WYNN MACAU LTD	205,600	13.84	2,845,504.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	205,300	22.70	4,660,310.00	
	WH GROUP LTD	1,037,000	6.81	7,061,970.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	129,420	17.74	2,295,910.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	407,500	24.50	9,983,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	84,500	134.40	11,356,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	132,800	317.80	42,203,840.00	
	AIA GROUP LTD	1,338,400	75.60	101,183,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	286,368	47.95	13,731,345.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	214,000	18.30	3,916,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	162,641	30.00	4,879,230.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	92,500	20.20	1,868,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	192,250	38.45	7,392,012.50	
	SINO LAND CO	317,400	9.71	3,081,954.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	144,000	100.40	14,457,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	52,000	43.50	2,262,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	110,600	19.52	2,158,912.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	135,000	37.90	5,116,500.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	96,000	61.30	5,884,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	395,000	11.28	4,455,600.00	
	PCCW LTD	446,000	4.53	2,020,380.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	70,000	41.45	2,901,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	183,000	76.80	14,054,400.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	300,000	8.08	2,424,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,189,808	12.10	14,396,676.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	164,000	43.40	7,117,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	30,500	84.70	2,583,350.00	
	香港ドル 小計	9,692,255		355,004,739.90 (4,902,615,458)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	167,100	6.04	1,009,284.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	169,300	3.37	570,541.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	321,300	0.95	305,235.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	161,040	3.90	628,056.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	820,900	0.76	627,988.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,500	20.88	281,880.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	199,700	4.09	816,773.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	197,500	21.10	4,167,250.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	362,600	9.04	3,277,904.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,200	20.63	2,665,396.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,100	8.10	705,510.00	
	CAPITALAND LTD	302,200	2.90	876,380.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,300	8.59	363,357.00	
	UOL GROUP LTD	44,000	7.00	308,000.00	
	VENTURE CORP LTD	28,400	16.34	464,056.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	896,260	2.53	2,267,537.80	
	シンガポールドドル 小計	3,942,400		19,335,148.30 (1,487,066,255)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	146,555	6.37	933,555.35	
	A2 MILK CO LTD	80,335	19.40	1,558,499.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	62,835	31.05	1,951,026.75	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	37,789	13.39	505,994.71	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	226,021	4.57	1,032,915.97	
	MERCURY NZ LTD	67,670	4.72	319,402.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	164,842	4.88	805,253.17	
	ニュージーランドドル 小計	786,047		7,106,647.35 (488,226,672)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN ENERGY AB	21,146	226.10	4,781,110.60	
	BOLIDEN AB	30,803	204.90	6,311,534.70	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	72,147	112.50	8,116,537.50	
	ALFA LAVAL AB	33,952	199.35	6,768,331.20	
	ASSA ABLOY AB-B	110,346	193.40	21,340,916.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	74,336	392.30	29,162,012.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,852	342.50	14,676,810.00	
	EPIROC AB-A	79,343	116.70	9,259,328.10	
	EPIROC AB-B	36,804	114.50	4,214,058.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	18,200	166.50	3,030,300.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	37,134	203.50	7,556,769.00	
	SANDVIK AB	124,632	161.65	20,146,762.80	
	SKANSKA AB-B SHS	39,585	180.10	7,129,258.50	
	SKF AB-B SHARES	44,526	167.90	7,475,915.40	
	VOLVO AB-B SHS	164,005	143.65	23,559,318.25	
	SECURITAS AB-B SHS	32,349	122.80	3,972,457.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	23,799	154.00	3,665,046.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	42,231	74.82	3,159,723.42	
	EVOLUTION GAMING GROUP	15,100	576.00	8,697,600.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	88,823	141.85	12,599,542.55	
	ICA GRUPPEN AB	12,550	441.80	5,544,590.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,495	635.60	11,755,422.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	66,842	292.90	19,578,021.80	
	NORDEA BANK ABP	355,934	65.06	23,157,066.04	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	178,690	79.02	14,120,083.80		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	171,237	89.20	15,274,340.40		
SWEDBANK AB - A SHARES	99,769	118.88	11,860,538.72		



	EQT AB	28,400	156.65	4,448,860.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,499	208.30	3,228,441.70	
	INVESTOR AB-B SHS	49,894	482.30	24,063,876.20	
	KINNEVIK AB - B	25,532	239.30	6,109,807.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,279	416.00	3,028,064.00	
	ERICSSON LM-B SHS	323,258	84.20	27,218,323.60	
	HEXAGON AB-B SHS	31,035	530.00	16,448,550.00	
	TELE2 AB-B SHS	57,289	120.80	6,920,511.20	
	TELIA CO AB	273,487	34.44	9,418,892.28	
	スウェーデンクローネ 小計	2,847,303		407,798,721.76 (4,665,217,376)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	110,894	140.05	15,530,704.70	
	NORSK HYDRO ASA	134,189	27.16	3,644,573.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,588	352.30	6,900,852.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,712	226.20	2,196,854.40	
	MOWI ASA	53,156	178.00	9,461,768.00	
	ORKLA ASA	81,436	83.72	6,817,821.92	
	DNB ASA	104,752	130.00	13,617,760.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,100	175.80	3,885,180.00	
	TELENOR ASA	78,100	144.50	11,285,450.00	
	ノルウェークローネ 小計	613,927		73,340,964.66 (812,617,888)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	11,682	687.60	8,032,543.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	23,534	378.20	8,900,558.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	22,081	674.00	14,882,594.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	332	7,095.00	2,355,540.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	749	7,604.00	5,695,396.00	
	DSV PANALPINA A/S	23,456	803.60	18,849,241.60	
	PANDORA A/S	10,573	370.20	3,914,124.60	
	CARLSBERG AS-B	11,727	875.00	10,261,125.00	
	AMBU A/S-B	19,383	216.30	4,192,542.90	
	COLOPLAST-B	13,146	1,038.00	13,645,548.00	
	DEMANT A/S	11,895	184.00	2,188,680.00	
	GN STORE NORD A/S	15,298	361.90	5,536,346.20	
	GENMAB A/S	7,226	2,182.00	15,767,132.00	
	H LUNDBECK A/S	6,115	250.80	1,533,642.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	195,827	443.05	86,761,152.35	
	DANSKE BANK A/S	72,428	88.92	6,440,297.76	
	TRYG A/S	14,757	185.40	2,735,947.80	
ORSTED A/S	20,956	761.80	15,964,280.80		
	デンマーククローネ 小計	481,165		227,656,693.01 (3,681,208,725)	
	ICL GROUP LTD	96,941	10.65	1,032,421.65	

イスラエルシェケル	ELBIT SYSTEMS LTD	3,261	477.60	1,557,453.60
	BANK HAPOALIM BM	122,994	20.18	2,482,018.92
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	159,641	17.66	2,819,260.06
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	124,481	10.61	1,320,743.41
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	14,019	67.94	952,450.86
	AZRIELI GROUP LTD	5,293	160.00	846,880.00
	NICE LTD	6,902	668.40	4,613,296.80
イスラエルシェケル 小計		533,532		15,624,525.30 (485,766,491)
ユーロ	ENI SPA	283,711	8.47	2,403,599.59
	GALP ENERGIA SGPS SA	53,277	10.58	563,670.66
	NESTE OYJ	46,917	35.11	1,647,255.87
	OMV AG	15,544	29.46	457,926.24
	REPSOL SA	167,361	7.86	1,316,796.34
	REPSOL SA-RTS	167,361	0.43	72,668.14
	TENARIS SA	48,206	5.82	280,558.92
	TOTAL SA	273,685	34.93	9,559,817.05
	VOPAK	7,470	48.02	358,709.40
	AIR LIQUIDE SA	52,470	126.20	6,621,714.00
	AKZO NOBEL N.V.	22,145	78.50	1,738,382.50
	ARCELORMITTAL	87,018	9.02	785,163.41
	ARKEMA	7,399	81.68	604,350.32
	BASF SE	101,723	49.64	5,050,038.33
	COVESTRO AG	20,208	33.26	672,118.08
	CRH PLC	87,171	30.36	2,646,511.56
	EVONIK INDUSTRIES AG	22,571	22.13	499,496.23
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	9,295	35.12	326,440.40
	HEIDELBERGCEMENT AG	16,048	47.11	756,021.28
	KONINKLIJKE DSM NV	19,172	121.55	2,330,356.60
	LANXESS AG	8,472	46.02	389,881.44
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,267	28.70	725,162.90
	SOLVAY SA	8,657	69.60	602,527.20
	STORA ENSO OYJ-R SHS	68,929	11.00	758,219.00
	SYMRISE AG	14,313	98.36	1,407,826.68
	THYSSENKRUPP AG	41,124	6.10	250,856.40
	UMICORE	20,914	41.56	869,185.84
	UPM-KYMMENE OYJ	58,920	26.29	1,549,006.80
	VOESTALPINE AG	10,934	19.14	209,331.43
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	29,781	21.84	650,417.04
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	29,781	1.34	40,055.44
	AIRBUS SE	65,177	62.97	4,104,195.69
ALSTOM	20,160	41.92	845,107.20	

ANDRITZ AG	6,701	34.04	228,102.04
BOUYGUES SA	23,469	28.00	657,132.00
BRENTAG AG	18,754	46.03	863,246.62
CNH INDUSTRIAL NV	110,034	5.99	659,543.79
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	57,410	30.66	1,760,190.60
DASSAULT AVIATION SA	255	798.00	203,490.00
EIFFAGE	9,901	79.50	787,129.50
FERROVIAL SA	53,344	24.53	1,308,528.32
GEA GROUP AG	16,084	28.23	454,051.32
HOCHTIEF AG	2,413	75.65	182,543.45
KINGSPAN GROUP PLC	16,564	56.40	934,209.60
KION GROUP AG	6,458	52.64	339,949.12
KNORR-BREMSE AG	5,208	90.21	469,813.68
KONE OYJ-B	37,579	61.48	2,310,356.92
LEGRAND SA	29,741	65.48	1,947,440.68
LEONARDO SPA	41,656	6.03	251,185.68
METSO OYJ	10,209	30.76	314,028.84
MTU AERO ENGINES AG	5,589	150.00	838,350.00
PRYSMIAN SPA	25,986	20.35	528,815.10
SAFRAN SA	35,585	89.76	3,194,109.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	61,354	96.00	5,889,984.00
SIEMENS AG-REG	84,694	101.26	8,576,114.44
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	23,944	15.13	362,392.44
THALES SA	11,743	69.60	817,312.80
VINCI SA	57,253	81.10	4,643,218.30
WARTSILA OYJ ABP	46,974	7.12	334,642.77
BUREAU VERITAS SA	30,023	18.99	570,286.88
RANDSTAD NV	13,562	38.66	524,306.92
TELEPERFORMANCE	6,540	213.20	1,394,328.00
WOLTERS KLUWER	30,324	67.46	2,045,657.04
ADP	3,034	91.90	278,824.60
AENA SME SA	7,523	120.30	905,016.90
ATLANTIA SPA	54,988	14.28	785,228.64
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,484	8.95	201,411.67
DEUTSCHE POST AG-REG	109,653	31.58	3,462,841.74
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,842	39.86	153,142.12
GETLINK SE	47,878	12.75	610,444.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	36,383	56.18	2,043,996.94
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,381	43.38	233,427.78
CONTINENTAL AG	12,206	84.18	1,027,501.08
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	94,776	34.84	3,302,469.72
FAURECIA	6,804	32.63	222,014.52

FERRARI NV	13,974	149.55	2,089,811.70
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	127,348	8.66	1,103,470.42
MICHELIN (CGDE)	18,916	89.90	1,700,548.40
PEUGEOT SA	68,017	14.01	952,918.17
PIRELLI & C SPA	35,183	3.80	133,976.86
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	16,669	49.18	819,781.42
RENAULT SA	21,400	20.91	447,581.00
VALEO SA	27,895	21.94	612,016.30
VOLKSWAGEN AG	3,486	140.90	491,177.40
VOLKSWAGEN AG-PREF	20,630	129.62	2,674,060.60
ADIDAS AG	21,073	235.70	4,966,906.10
ESSILORLUXOTTICA	31,584	112.50	3,553,200.00
HERMES INTERNATIONAL	3,511	726.80	2,551,794.80
KERING	8,398	474.60	3,985,690.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	30,750	381.35	11,726,512.50
MONCLER SPA	21,058	34.79	732,607.82
PUMA SE	10,166	67.56	686,814.96
SEB SA	2,324	136.90	318,155.60
ACCOR SA	19,606	24.64	483,091.84
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,385	123.65	1,531,405.25
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,150	29.32	297,598.00
SODEXO SA	9,249	58.16	537,921.84
ALTICE EUROPE NV	63,237	3.66	231,637.13
BOLLORE	87,103	2.83	246,675.69
JCDECAUX SA	12,164	16.47	200,341.08
PUBLICIS GROUPE	26,010	28.02	728,800.20
SCOUT24 AG	12,799	69.25	886,330.75
SES	36,096	6.00	216,576.00
TELENET GROUP HOLDING NV	6,451	37.22	240,106.22
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,560	69.82	667,479.20
VIVENDI	92,463	22.88	2,115,553.44
DELIVERY HERO SE	13,753	91.30	1,255,648.90
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	120,772	23.99	2,897,320.28
JUST EAT TAKEAWAY	12,963	89.94	1,165,892.22
PROSUS NV	53,946	81.32	4,386,888.72
ZALANDO SE	15,956	62.98	1,004,908.88
CARREFOUR SA	66,266	14.31	948,266.46
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,376	32.95	111,239.20
COLRUYT SA	5,890	48.82	287,549.80
JERONIMO MARTINS	26,811	15.79	423,479.74
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	122,354	23.75	2,905,907.50
METRO AG	14,082	8.32	117,274.89

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	84,426	43.95	3,710,522.70
DANONE	68,508	63.38	4,342,037.04
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	63,159	7.64	483,040.03
HEINEKEN HOLDING NV	12,863	73.70	948,003.10
HEINEKEN NV	28,777	83.20	2,394,246.40
KERRY GROUP PLC-A	17,324	110.10	1,907,372.40
PERNOD RICARD SA	23,591	139.30	3,286,226.30
REMY COINTREAU	2,158	121.00	261,118.00
BEIERSDORF AG	11,229	98.84	1,109,874.36
HENKEL AG & CO KGAA	11,474	70.15	804,901.10
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,803	78.84	1,561,268.52
L'OREAL	27,813	279.00	7,759,827.00
UNILEVER NV	161,637	48.82	7,891,118.34
BIOMERIEUX	5,151	118.60	610,908.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,177	86.20	360,057.40
DIASORIN SPA	2,987	170.30	508,686.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	23,654	75.84	1,793,919.36
FRESENIUS SE & CO KGAA	46,456	43.97	2,042,670.32
KONINKLIJKE PHILIPS NV	99,356	41.23	4,096,944.66
ORPEA	6,192	102.65	635,608.80
SARTORIUS AG-VORZUG	3,953	297.00	1,174,041.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,005	41.99	672,129.97
BAYER AG-REG	108,782	69.99	7,613,652.18
EUROFINS SCIENTIFIC	1,567	558.20	874,699.40
GALAPAGOS NV	4,558	178.05	811,551.90
GRIFOLS SA	32,153	27.62	888,065.86
IPSEN	3,542	71.65	253,784.30
MERCK KGAA	13,999	99.62	1,394,580.38
ORION OYJ-CLASS B	10,472	43.49	455,427.28
QIAGEN N.V.	25,778	38.13	982,915.14
RECORDATI SPA	10,877	45.00	489,465.00
SANOFI	124,981	91.06	11,380,769.86
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,098	215.80	668,548.40
UCB SA	14,048	102.75	1,443,432.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	45,526	7.52	342,446.57
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	738,181	3.03	2,238,164.79
BANCO SANTANDER SA	1,838,810	2.13	3,925,859.35
BANKINTER SA	67,617	4.18	283,179.99
BNP PARIBAS	124,634	34.51	4,301,119.34
CAIXABANK SA	396,234	1.85	734,815.95
COMMERZBANK AG	106,972	3.78	404,568.10
CREDIT AGRICOLE SA	126,371	8.03	1,015,517.35

ERSTE GROUP BANK AG	33,121	20.27	671,362.67
FINECOBANK SPA	67,925	11.90	808,647.12
ING GROEP NV	432,460	6.10	2,640,168.30
INTESA SANPAOLO	1,658,878	1.66	2,765,017.85
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248		
KBC GROUP NV	27,164	49.76	1,351,680.64
MEDIOBANCA SPA	66,680	6.46	430,752.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	21,019	16.26	341,768.94
SOCIETE GENERALE SA	90,559	14.26	1,291,552.45
UNICREDIT SPA	237,062	8.06	1,912,853.27
AMUNDI SA	6,295	67.95	427,745.25
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	217,794	8.12	1,768,922.86
DEUTSCHE BOERSE AG	21,050	155.70	3,277,485.00
EURAZEO SE	4,128	45.18	186,503.04
EXOR NV	12,940	49.09	635,224.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,663	71.66	764,110.58
NATIXIS	93,734	2.26	212,588.71
SOFINA	1,799	230.50	414,669.50
WENDEL	2,701	83.45	225,398.45
AEGON NV	203,530	2.64	538,133.32
AGEAS	18,334	30.45	558,270.30
ALLIANZ SE-REG	46,130	178.02	8,212,062.60
ASSICURAZIONI GENERALI	122,183	13.26	1,620,757.49
AXA SA	214,658	18.40	3,951,424.46
CNP ASSURANCES	17,599	9.81	172,734.18
HANNOVER RUECK SE	6,718	151.50	1,017,777.00
MAPFRE SA	152,207	1.61	245,205.47
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,983	224.70	3,591,380.10
NN GROUP NV	32,738	29.35	960,860.30
POSTE ITALIANE SPA	57,979	7.84	455,019.19
SAMPO OYJ-A SHS	51,996	30.07	1,563,519.72
SCOR SE	17,251	23.38	403,328.38
AROUNDTOWN SA	136,350	5.18	707,383.80
DEUTSCHE WOHNEN SE	37,703	39.23	1,479,088.69
LEG IMMOBILIEN AG	8,173	114.46	935,481.58
VONOVIA SE	56,918	52.90	3,010,962.20
ADYEN NV	2,001	1,263.00	2,527,263.00
AMADEUS IT GROUP SA	47,787	46.56	2,224,962.72
ATOS SE	11,305	73.42	830,013.10
CAPGEMINI SE	17,915	98.80	1,770,002.00
DASSAULT SYSTEMES SA	14,639	150.05	2,196,581.95
EENREDDING	26,473	37.66	996,973.18

NEMETSCHKE SE	6,883	60.30	415,044.90
NEXI SPA	46,087	14.77	680,935.42
SAP SE	115,529	120.10	13,875,032.90
TEAMVIEWER AG	15,450	47.74	737,583.00
WIRECARD AG	7,229	12.30	88,931.15
WORLDLINE SA	14,484	69.58	1,007,796.72
INGENICO GROUP	6,326	130.75	827,124.50
NOKIA OYJ	627,998	3.77	2,369,750.45
CELLNEX TELECOM SA	27,526	52.88	1,455,574.88
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	368,404	14.63	5,389,750.52
ELISA OYJ	16,663	53.08	884,472.04
ILIAD SA	1,325	170.25	225,581.25
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,455	8.91	253,676.32
KONINKLIJKE KPN NV	384,763	2.34	900,345.42
ORANGE	221,500	10.34	2,291,417.50
PROXIMUS	15,448	18.46	285,170.08
TELECOM ITALIA SPA	949,339	0.36	343,660.71
TELECOM ITALIA-RSP	550,435	0.35	197,000.68
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	128,092	2.59	332,911.10
TELEFONICA SA	516,010	4.20	2,167,242.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,661	36.74	465,165.14
E.ON SE	248,694	9.92	2,469,034.03
EDF	63,459	7.80	495,107.11
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	283,668	4.12	1,168,995.82
ELIA GROUP SA/NV	3,662	94.70	346,791.40
ENAGAS SA	27,183	21.44	582,803.52
ENDESA SA	32,471	22.50	730,597.50
ENEL SPA	900,665	7.62	6,866,669.96
ENGIE	202,902	10.94	2,219,747.88
FORTUM OYJ	48,909	16.56	810,177.58
IBERDROLA SA	641,893	9.99	6,417,646.21
NATURGY ENERGY GROUP SA	33,187	16.29	540,616.23
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51,197	17.05	872,908.85
RWE AG	64,839	31.43	2,037,889.77
SNAM SPA	225,127	4.21	948,009.79
SUEZ	36,458	10.07	367,314.35
TERNA SPA	150,741	5.99	903,843.03
UNIPER SE	21,910	28.22	618,300.20
VEOLIA ENVIRONNEMENT	58,825	20.00	1,176,500.00
VERBUND AG	6,650	37.52	249,508.00
ASML HOLDING NV	47,122	321.75	15,161,503.50
INFINEON TECHNOLOGIES AG	138,763	20.42	2,833,540.46

STMICROELECTRONICS NV	71,096	23.71	1,685,686.16
ユーロ 小計	20,860,019		404,795,146.15 (48,785,911,013)
合 計	118,988,499		438,870,368,860 (438,870,368,860)

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,625	2,227,415.00	
		AMERICAN TOWER CORP	48,992	12,452,786.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,577	2,361,005.89	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,212	1,454,054.28	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,763	958,122.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	45,995	7,455,789.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	29,076	4,071,221.52	
		DUKE REALTY CORP	40,962	1,416,465.96	
		EQUINIX INC	9,456	6,521,141.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,251	1,190,096.82	
		EQUITY RESIDENTIAL	41,270	2,372,199.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,267	1,655,204.59	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	14,331	1,296,668.88	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,801	643,348.47	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	56,133	1,458,896.67	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	82,386	904,598.28	
		INVITATION HOMES INC	60,167	1,640,754.09	
		IRON MOUNTAIN INC	30,494	763,264.82	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	57,590	1,027,981.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,437	1,374,537.24	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	18,183	650,951.40	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27,133	770,577.20	
		PROLOGIS INC	81,723	7,338,725.40	
		PUBLIC STORAGE	17,405	3,297,377.25	
		REALTY INCOME CORP	36,999	2,199,960.54	
		REGENCY CENTERS CORP	18,384	815,514.24	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	12,383	3,563,455.91	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	33,964	2,211,396.04	
		SUN COMMUNITIES INC	10,038	1,382,935.26	
		UDR INC	32,769	1,192,463.91	



		VENTAS INC	40,833	1,404,246.87
		VEREIT INC	118,846	774,875.92
		VICI PROPERTIES INC	52,096	1,098,183.68
		VORNADO REALTY TRUST	18,373	694,131.94
		WELLTOWER INC	45,457	2,244,666.66
		WEYERHAEUSER CO	82,738	1,799,551.50
		WP CAREY INC	19,183	1,286,411.98
アメリカドル合計			1,286,292	85,970,978.91 (9,204,053,002)
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,700	419,862.00
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15,000	209,400.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,200	248,508.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,100	213,413.00
カナダドル合計			50,000	1,091,183.00 (85,745,160)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	118,796	1,199,839.60
		GOODMAN GROUP	182,706	2,788,093.56
		GPT GROUP	232,503	1,050,913.56
		MIRVAC GROUP	404,306	966,291.34
		SCENTRE GROUP	620,280	1,401,832.80
		STOCKLAND	238,162	862,146.44
		VICINITY CENTRES	348,844	512,800.68
オーストラリアドル合計			2,145,597	8,781,917.98 (645,997,886)
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	106,428	409,002.80
		LAND SECURITIES GROUP PLC	81,488	461,222.08
		SEGRO PLC	125,994	1,111,267.08
イギリスポンド合計			313,910	1,981,491.96 (263,617,690)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	231,100	14,778,845.00
香港ドル合計			231,100	14,778,845.00 (204,095,849)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	318,200	1,018,240.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	363,300	643,041.00
		CAPITALAND MALL TRUST	266,700	538,734.00
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	216,300	428,274.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	306,800	598,260.00
		SUNTEC REIT	194,300	285,621.00
シンガポールドル合計			1,665,600	3,512,170.00 (270,120,994)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	4,877	315,298.05
		GECINA SA	5,521	610,622.60
		ICADE	3,010	187,523.00

	KLEPIERRE	20,000	344,400.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,452	839,052.00	
ユーロ合計		49,860	2,296,895.65 (276,821,863)	
	合計		10,950,452,444 (10,950,452,444)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	592銘柄	97.12%	69.10%
	投資証券	37銘柄		2.05%
カナダドル	株式	81銘柄	99.44%	3.38%
	投資証券	4銘柄		0.02%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	93.86%	2.20%
	投資証券	7銘柄		0.14%
イギリスポンド	株式	85銘柄	98.80%	4.81%
	投資証券	3銘柄		0.06%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.00%	3.55%
香港ドル	株式	34銘柄	96.00%	1.09%
	投資証券	1銘柄		0.05%
シンガポールドル	株式	16銘柄	84.63%	0.33%
	投資証券	6銘柄		0.06%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.00%	0.11%
スウェーデンクローネ	株式	36銘柄	100.00%	1.04%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.00%	0.18%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.00%	0.82%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%	0.11%
ユーロ	株式	244銘柄	99.44%	10.85%
	投資証券	5銘柄		0.06%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 新興国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[ 令和 2年 6月25日現在 ]

資産の部	
流動資産	
預金	4,323,336,312
コール・ローン	171,167,685
株式	119,436,374,066
投資証券	104,748,997
派生商品評価勘定	30,548,102
未収入金	57,969,062
未収配当金	325,129,531
差入委託証拠金	1,769,753,089
流動資産合計	126,219,026,844
資産合計	
126,219,026,844	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,327,107
未払金	2,662,651,472
未払解約金	17,070,161
未払利息	251
流動負債合計	2,685,048,991
負債合計	
2,685,048,991	
純資産の部	
元本等	
元本	52,599,604,651
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	70,934,373,202
元本等合計	123,533,977,853
純資産合計	
123,533,977,853	
負債純資産合計	
126,219,026,844	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 2年 3月 6日
期首元本額	45,098,625,981円
期中追加設定元本額	8,936,287,126円
期中一部解約元本額	1,435,308,456円
元本の内訳	
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	130,212,176円
eMAXIS 新興国株式インデックス	12,510,210,618円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,633,149,028円
eMAXIS バランス（波乗り型）	146,988,396円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	396,050,751円
コアバランス	102,680円
海外株式セレクション（ラップ向け）	93,350,227円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	2,991,764,192円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	12,699,247,490円
つみたて新興国株式	2,280,199,368円
つみたて8資産均等バランス	1,214,384,890円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	781,172円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,136,150円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,734,863円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	1,159,668,206円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	258,734,496円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	1,681,267,818円
新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）	657,208,300円
つみたて全世界株式	165,663円
三菱UFJ DC 新興国株式インデックスファンド	10,812,748,903円
新興国株式インデックスオープン	417,712,434円
eMAXIS 全世界株式インデックス	491,890,525円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	552,404,607円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	873,793円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	25,649,156円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	141,048,461円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	118,118,966円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	486,723,014円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,493,840,108円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	2,287,022円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	11,673,338円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	13,661,775円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	84,051,970円
MUKAM バランスファンド2020-04（適格機関投資家限定）	89,564,095円

	[令和 2年 6月25日現在]
合計	52,599,604,651円
2. 受益権の総数	52,599,604,651口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

### 1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

### 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p>

区分	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2) デリバティブ取引            デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,226,575,055
投資証券	5,422,693
合計	9,231,997,748

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

[ 令和 2年 6月25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	4,033,271,380		4,057,382,362	24,110,982
	合計	4,033,271,380		4,057,382,362	24,110,982

## (注)時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
 原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
  - 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
  - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

[ 令和 2年 6月25日現在 ]

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	7,854,198		7,862,150	7,952
	香港ドル	607,622,400		607,640,000	17,600
	マレーシアリンギット	34,194,787		34,150,955	43,832
	タイバーツ	66,214,137		66,204,597	9,540
	フィリピンペソ	32,130,000		32,100,000	30,000
	インドネシアルピア	35,225,273		35,543,292	318,019
	メキシコペソ	44,234,050		44,180,000	54,050
	韓国ウォン	319,968,000		320,400,000	432,000
	ニュー台湾ドル	343,026,000		344,850,000	1,824,000
	チェココルナ	11,269,025		11,275,000	5,975
	ポーランドズロチ	10,813,240		10,808,000	5,240
	南アフリカランド	98,360,000		98,240,000	120,000
	トルコリラ	10,930,220		10,927,000	3,220
	売建				
アメリカドル	1,540,299,540		1,541,520,000	1,220,460	
オフショア元	7,854,198		7,863,389	9,191	
合計		3,169,995,068		3,173,564,383	1,110,013

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

- (イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- (ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1口当たり純資産額	2.3486円
(1万口当たり純資産額)	(23,486円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM PJSC-SPON ADR	1,130,722	5.47	6,187,310.78	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	156,900	0.65	102,455.70	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	76,498	76.50	5,852,097.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	17,803	154.40	2,748,783.20	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	227,420	5.43	1,236,334.69	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,337,800	0.57	773,800.24	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	1,299,900	0.51	664,111.89	
	TATNEFT PJSC	263,380	8.56	2,255,815.56	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	29,046	5.46	158,591.16	
	ALROSA PJSC	485,760	0.93	454,428.62	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	35,491	9.22	327,227.02	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	43,064	7.28	313,505.92	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	11,917	285.72	3,405,026.55	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	243,290	2.02	491,730.37	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,499	12.68	336,007.32	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	13,083	84.60	1,106,821.80	
	SEVERSTAL PJSC	43,990	12.68	558,175.77	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,381	37.48	613,959.88	
	51JOB INC-ADR	4,511	68.81	310,401.91	
	BEST INC - ADR	46,618	4.79	223,300.22	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	70,291	37.38	2,627,477.58	
	NIO INC - ADR	172,262	6.86	1,181,717.32	
	GSX TECHEDU INC- ADR	13,900	56.70	788,130.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	25,623	36.65	939,082.95	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	27,490	132.11	3,631,703.90	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	73,261	67.55	4,948,780.55	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	68,926	49.70	3,425,622.20	
	58.COM INC-ADR	18,576	54.01	1,003,289.76	
	AUTOHOME INC-ADR	10,694	73.78	789,003.32	
	BAIDU INC - SPON ADR	52,385	121.37	6,357,967.45	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	19,638	44.03	864,661.14		
HUYA INC-ADR	14,300	17.98	257,114.00		
IQIYI INC-ADR	40,409	22.92	926,174.28		



	JOYY INC	10,716	93.63	1,003,339.08	
	MOMO INC-SPON ADR	26,548	18.46	490,076.08	
	NETEASE INC-ADR	15,543	437.46	6,799,440.78	
	SINA CORP	11,600	35.83	415,628.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	66,284	13.51	895,496.84	
	WEIBO CORP-SPON ADR	9,514	32.96	313,581.44	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	357,887	226.22	80,961,197.14	
	BAOZUN INC-SPN ADR	8,747	39.85	348,567.95	
	JD.COM INC-ADR	161,934	59.84	9,690,130.56	
	PINDUODUO INC-ADR	49,317	84.50	4,167,286.50	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	91,047	25.81	2,349,923.07	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	82,033	20.24	1,660,347.92	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	67,457	13.31	897,852.67	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	23,091	35.02	808,646.82	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	15,480	25.00	387,000.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	10,600	78.59	833,054.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	283,222	4.13	1,171,122.97	
	CREDICORP LTD	13,150	139.77	1,837,975.50	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	498,104	11.75	5,852,722.00	
	VTB BANK PJSC	658,130,000	0.00	340,319.02	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	274,310	1.67	460,625.49	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	5,699	25.33	144,355.67	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	196,860	0.77	152,172.78	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	15,566	80.22	1,248,704.52	
	GLOBANT SA	6,884	145.36	1,000,658.24	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	83,893	9.36	785,238.48	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,804	9.28	137,381.12	
	INTER RAO UES PJSC	7,192,000	0.07	516,774.68	
	アメリカドル 小計	673,840,118		181,530,229.37 (19,434,626,356)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	43,353	15.83	686,277.99	
	イギリスポンド 小計	43,353		686,277.99 (91,302,423)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	394,000	7.25	2,856,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,626,000	3.33	15,404,580.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	625,000	12.20	7,625,000.00	
	CNOOC LTD	3,439,000	8.80	30,263,200.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	236,000	3.74	882,640.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	4,043,000	2.66	10,754,380.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	280,000	5.89	1,649,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	858,000	1.49	1,278,420.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	229,000	51.50	11,793,500.00	

CHINA HONGQIAO GROUP LTD	304,000	3.44	1,045,760.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	681,000	2.57	1,750,170.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	768,000	8.35	6,412,800.00
CHINA RESOURCES CEMENT	440,000	9.74	4,285,600.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	257,000	7.68	1,973,760.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	247,000	4.34	1,071,980.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	315,000	7.19	2,264,850.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	531,000	1.91	1,014,210.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	242,500	8.69	2,107,325.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,062,000	3.51	3,727,620.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	406,000	3.62	1,469,720.00
BOC AVIATION LTD	49,100	49.00	2,405,900.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	854,000	4.57	3,902,780.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	404,000	5.16	2,084,640.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	321,000	33.70	10,817,700.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	228,000	10.80	2,462,400.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	339,000	6.40	2,169,600.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	752,000	4.11	3,090,720.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	414,000	4.76	1,970,640.00
CITIC LTD	1,072,000	7.47	8,007,840.00
CRRG CORP LTD - H	816,550	3.24	2,645,622.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	457,000	9.95	4,547,150.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	118,000	16.06	1,895,080.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	428,000	2.23	954,440.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	80,000	12.20	976,000.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	431,500	3.38	1,458,470.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	116,000	20.30	2,354,800.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	400,800	14.28	5,723,424.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	117,200	7.45	873,140.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	105,900	21.25	2,250,375.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	219,400	5.90	1,294,460.00
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	76,250	42.60	3,248,250.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	749,111	4.12	3,086,337.32
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	247,000	36.65	9,052,550.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	316,000	9.42	2,976,720.00
AIR CHINA LTD-H	444,000	4.79	2,126,760.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	310,000	5.10	1,581,000.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	410,000	2.87	1,176,700.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	258,000	9.26	2,389,080.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	280,000	3.52	985,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	440,500	2.29	1,008,745.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	360,000	4.24	1,526,400.00

JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	268,000	9.32	2,497,760.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	106,000	8.13	861,780.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	189,500	12.48	2,364,960.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	238,000	5.67	1,349,460.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	262,000	3.61	945,820.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	562,000	7.44	4,181,280.00
BYD CO LTD-H	116,000	61.05	7,081,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	580,000	5.06	2,934,800.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	118,800	19.18	2,278,584.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,090,000	12.28	13,385,200.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	619,000	5.06	3,132,140.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	528,945	6.22	3,290,037.90
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	202,000	72.00	14,544,000.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	492,000	2.53	1,244,760.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	255,000	24.50	6,247,500.00
LI NING CO LTD	397,500	25.25	10,036,875.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	157,900	98.25	15,513,675.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	104,500	14.12	1,475,540.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	137,000	12.86	1,761,820.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	200,000	7.20	1,440,000.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	143,000	34.35	4,912,050.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	41,500	34.20	1,419,300.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	2,400,000	1.10	2,640,000.00
CHINA LITERATURE LTD	55,600	53.15	2,955,140.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,091,800	490.80	535,855,440.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,572,000	1.62	2,546,640.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	677,300	178.40	120,830,320.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	154,000	13.80	2,125,200.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	213,000	9.98	2,125,740.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	112,000	42.80	4,793,600.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	449,500	13.00	5,843,500.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	20,400	85.00	1,734,000.00
CHINA FEIHE LTD	161,000	15.44	2,485,840.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	372,000		
CHINA MENGNIU DAIRY CO	529,000	30.00	15,870,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	284,000	43.60	12,382,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	336,000	4.60	1,545,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	354,000	12.34	4,368,360.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	76,000	55.70	4,233,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	301,000	7.88	2,371,880.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	892,000	6.03	5,378,760.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	87,000	77.60	6,751,200.00

HENGAN INTL GROUP CO LTD	131,000	62.05	8,128,550.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	27.40	1,753,600.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	66,000	24.70	1,630,200.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	698,000	23.70	16,542,600.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	74,600	115.00	8,579,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	496,000	16.36	8,114,560.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	156,600	12.82	2,007,612.00
SINOPHARM GROUP CO-H	258,400	19.56	5,054,304.00
3SBIO INC	260,000	9.68	2,516,800.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,600	225.00	2,385,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	281,000	9.50	2,669,500.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	235,000	4.36	1,024,600.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	596,000	3.71	2,211,160.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	920,000	14.20	13,064,000.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT-NEW	172,400	14.20	2,448,080.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	200,000	16.24	3,248,000.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	92,000	37.50	3,450,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	178,000	57.90	10,306,200.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	412,500	5.05	2,083,125.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	115,000	26.30	3,024,500.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,331,000	14.88	19,805,280.00
SSY GROUP LTD	328,000	5.07	1,662,960.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	39,984	101.80	4,070,371.20
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	170,500	145.50	24,807,750.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,279,000	3.16	16,681,640.00
BANK OF CHINA LTD-H	15,203,000	2.90	44,088,700.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,728,900	4.78	8,264,142.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,794,000	3.40	6,099,600.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	18,295,550	6.22	113,798,321.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	626,000	2.93	1,834,180.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	747,550	36.10	26,986,555.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,121,820	5.38	6,035,391.60
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	570,000	3.11	1,772,700.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	11,604,350	4.81	55,816,923.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,931,000	4.52	8,728,120.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,673,000	1.58	2,643,340.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	186,000	11.52	2,142,720.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	657,500	4.34	2,853,550.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2,024,000	0.78	1,578,720.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	249,200	15.10	3,762,920.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	414,500	15.66	6,491,070.00
FAR EAST HORIZON LTD	373,000	6.38	2,379,740.00

GF SECURITIES CO LTD-H	227,800	8.53	1,943,134.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	126,600	11.14	1,410,324.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	524,400	6.50	3,408,600.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	285,400	13.10	3,738,740.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,404,000	15.92	22,351,680.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	535,400	21.10	11,296,940.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	783,000	0.85	665,550.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	309,200	12.46	3,852,632.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	151,700	26.25	3,982,125.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,665,000	2.49	4,145,850.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,262,000	7.43	9,376,660.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,132,000	79.15	89,597,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	60,200	35.20	2,119,040.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	198,000	9.01	1,783,980.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	264,000	9.79	2,584,560.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	366,000	19.50	7,137,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	962,000	5.49	5,281,380.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	740,000	24.85	18,389,000.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	220,000	8.07	1,775,400.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	618,000	30.75	19,003,500.00
CHINA VANKE CO LTD-H	322,951	24.65	7,960,742.15
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	632,000	6.24	3,943,680.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,477,232	9.89	14,609,824.48
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	211,200	9.18	1,938,816.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	406,000	3.00	1,218,000.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	273,000	12.44	3,396,120.00
LOGAN GROUP CO LTD	270,000	13.70	3,699,000.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	344,500	37.65	12,970,425.00
POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	20,400	76.80	1,566,720.00
SEAZEN GROUP LTD	370,000	6.90	2,553,000.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	542,000	2.33	1,262,860.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	226,000	32.50	7,345,000.00
SHUI ON LAND LTD	717,000	1.30	932,100.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	497,500	1.88	935,300.00
SOHO CHINA LTD	317,500	2.78	882,650.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	480,000	33.75	16,200,000.00
WHARF HOLDINGS LTD	275,000	16.56	4,554,000.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,500,000	1.41	2,115,000.00
YUZHOU PROPERTIES CO	336,000	3.37	1,132,320.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	386,000	4.88	1,883,680.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	429,000	16.92	7,258,680.00
KINGSOFT CORP LTD	149,000	34.20	5,095,800.00

	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	178,000	14.66	2,609,480.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	143,000	49.45	7,071,350.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	126,000	18.22	2,295,720.00	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	237,000	3.37	798,690.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	149,500	21.40	3,199,300.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	183,500	8.15	1,495,525.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	136,200	8.82	1,201,284.00	
	LENOVO GROUP LTD	1,468,000	4.35	6,385,800.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	136,200	119.80	16,316,760.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,963,600	13.88	27,254,768.00	
	ZTE CORP-H	144,931	23.60	3,420,371.60	
	CHINA MOBILE LTD	1,171,000	55.00	64,405,000.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	2,628,000	2.27	5,965,560.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	8,338,000	1.46	12,173,480.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	1,258,000	4.44	5,585,520.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	96,500	26.95	2,600,675.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	812,000	3.01	2,444,120.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,943,000	1.66	3,225,380.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	489,600	27.55	13,488,480.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	562,000	4.56	2,562,720.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	705,000	1.46	1,029,300.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	176,000	40.35	7,101,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	394,000	9.08	3,577,520.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	149,900	91.80	13,760,820.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	558,000	13.88	7,745,040.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	678,000	2.94	1,993,320.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	708,000	5.12	3,624,960.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	89,000	26.10	2,322,900.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	649,400	27.45	17,826,030.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	806,000	7.31	5,891,860.00	
	香港ドル 小計	170,363,324		2,073,381,131.75 (28,633,393,429)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	782,180	3.63	2,839,313.40	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	56,300	21.64	1,218,332.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	461,900	6.43	2,970,017.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	241,700	4.55	1,099,735.00	
	GAMUDA BHD	282,700	3.53	997,931.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	133,100	8.55	1,138,005.00	
	IJM CORP BHD	457,600	1.84	841,984.00	
	SIME DARBY BERHAD	493,200	2.08	1,025,856.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	241,800	5.72	1,383,096.00	

	MISC BHD	228,100	7.80	1,779,180.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	148,400	3.76	557,984.00	
	GENTING BHD	441,700	4.27	1,886,059.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	628,000	2.63	1,651,640.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	27,500	24.10	662,750.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	24,500	32.48	795,760.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	39,200	10.10	395,920.00	
	IOI CORP BHD	455,200	4.40	2,002,880.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	82,700	22.34	1,847,518.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	14,400	139.30	2,005,920.00	
	PPB GROUP BERHAD	134,440	17.98	2,417,231.20	
	QL RESOURCES BHD	150,100	9.19	1,379,419.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	390,700	4.95	1,933,965.00	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	319,600	12.10	3,867,160.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	436,300	5.40	2,356,020.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	290,400	15.60	4,530,240.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	271,500	3.23	876,945.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,282,900	3.62	4,644,098.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	123,700	14.20	1,756,540.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	33,300	13.78	458,874.00	
	MALAYAN BANKING BHD	747,500	7.64	5,710,900.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	552,300	16.48	9,101,904.00	
	RHB BANK BHD	319,249	4.80	1,532,395.20	
	AXIATA GROUP BERHAD	545,100	3.48	1,896,948.00	
	DIGI.COM BHD	567,300	4.21	2,388,333.00	
	MAXIS BHD	474,300	5.33	2,528,019.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	214,800	4.00	859,200.00	
	PETRONAS GAS BHD	137,800	17.10	2,356,380.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	439,700	11.74	5,162,078.00	
	YTL CORP BHD	769,263	0.81	623,103.03	
	マレーシアリングット 小計	13,440,432		83,479,632.83 (2,088,660,413)	
タイパーツ	IRPC PCL - NVDR	2,038,500	2.66	5,422,410.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	277,800	92.75	25,765,950.00	
	PTT PCL-NVDR	2,222,100	37.50	83,328,750.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	238,100	43.75	10,416,875.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	293,000	27.25	7,984,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	457,061	45.75	20,910,540.75	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	149,650	353.00	52,826,450.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	818,700	59.75	48,917,325.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	1,300,300	9.70	12,612,910.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,517,200	11.40	17,296,080.00	

ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	1,173,700	4.04	4,741,748.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	509,900	20.90	10,656,910.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	385,017	32.75	12,609,306.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	1,156,301	15.40	17,807,035.40	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	243,700	38.75	9,443,375.00	
CP ALL PCL-NVDR	1,134,500	67.25	76,295,125.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	744,400	31.25	23,262,500.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	110,500	38.75	4,281,875.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	552,100	12.30	6,790,830.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,743,000	22.30	38,868,900.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	93,100	114.00	10,613,400.00	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	101,200	107.50	10,879,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	308,100	90.25	27,806,025.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	791,400	10.30	8,151,420.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	176,700	72.75	12,854,925.00	
TMB BANK PCL-NVDR	3,393,200	1.06	3,596,792.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	315,500	24.50	7,729,750.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	135,500	30.25	4,098,875.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	154,600	53.00	8,193,800.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	142,800	52.50	7,497,000.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	398,900	50.25	20,044,725.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	1,350,100	7.70	10,395,770.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	232,000	188.00	43,616,000.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	411,500	55.50	22,838,250.00	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	118,000	40.75	4,808,500.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	2,045,076	3.56	7,280,470.56	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	167,500	51.50	8,626,250.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	58,900	251.00	14,783,900.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	274,600	38.75	10,640,750.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	145,900	75.00	10,942,500.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	372,900	35.25	13,144,725.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	154,300	63.50	9,798,050.00	
タイパーツ 小計	28,407,305		768,580,023.46 (2,666,972,681)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	342,280	46.75	16,001,590.00	
AYALA CORPORATION	57,085	786.00	44,868,810.00	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	15,054	470.40	7,081,401.60	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	508,020	61.00	30,989,220.00	
SM INVESTMENTS CORP	48,350	937.00	45,303,950.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	211,940	100.80	21,363,552.00	
JOLLIBEE FOODS CORP	85,240	143.90	12,266,036.00	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	183,600	44.75	8,216,100.00	



	UNIVERSAL ROBINA CORP	174,900	128.10	22,404,690.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	211,341	72.00	15,216,552.00	
	BDO UNIBANK INC	389,750	100.10	39,013,975.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	402,156	38.00	15,281,928.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,266,500	3.88	8,794,020.00	
	AYALA LAND INC	1,581,520	34.05	53,850,756.00	
	MEGAWORLD CORP	1,793,000	3.06	5,486,580.00	
	ROBINSONS LAND CO	304,700	17.24	5,253,028.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,855,900	31.00	57,532,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	6,260	2,094.00	13,108,440.00	
	PLDT INC	14,760	1,213.00	17,903,880.00	
	ABOITIZ POWER CORP	249,500	26.70	6,661,650.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	50,740	266.80	13,537,432.00	
	フィリピンベソ 小計	10,752,596		460,136,490.60 (984,692,089)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	3,549,400	1,045.00	3,709,123,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	328,100	16,725.00	5,487,472,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	5,284,700	1,190.00	6,288,793,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	438,900	5,600.00	2,457,840,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	310,600	12,300.00	3,820,380,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	640,400	9,475.00	6,067,790,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,777,200	5,000.00	18,886,000,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	1,063,000	1,535.00	1,631,705,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,481,700	5,650.00	8,371,605,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	96,000	47,700.00	4,579,200,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	1,631,300	1,710.00	2,789,523,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	385,700	9,075.00	3,500,227,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	743,900	6,525.00	4,853,947,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,405,600	8,075.00	11,350,220,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	3,583,600	1,460.00	5,232,056,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,863,700	28,525.00	53,162,042,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,450,600	5,150.00	17,770,590,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,612,700	4,740.00	7,644,198,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	10,740,300	3,120.00	33,509,736,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	9,517,900	3,180.00	30,266,922,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	514,700	2,690.00	1,384,543,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	1,707,300	1,130.00	1,929,249,000.00	
	インドネシアルピア 小計	54,127,300		234,693,163,000.00 (1,783,668,038)	
メキシコベソ	CEMEX SAB-CPO	3,002,268	6.26	18,794,197.68	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	561,570	52.61	29,544,197.70	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	22,650	220.61	4,996,816.50	

	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	198,398	34.48	6,840,763.04	
	ALFA S.A.B. -A	661,400	12.78	8,452,692.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	72,700	46.55	3,384,185.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	77,800	166.27	12,935,806.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	41,515	259.15	10,758,612.25	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	38,620	167.58	6,471,939.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	420,800	25.08	10,553,664.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	51,600	67.44	3,479,904.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,002,300	55.48	55,607,604.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	89,966	100.43	9,035,285.38	
	BECL E SAB DE CV	104,800	43.00	4,506,400.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	106,000	102.05	10,817,300.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	372,100	143.35	53,340,535.00	
	GRUMA S.A.B. -B	46,275	243.94	11,288,323.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	327,600	38.99	12,773,124.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	316,600	35.26	11,163,316.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	494,100	81.94	40,486,554.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	367,500	16.70	6,137,250.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	6,385,200	15.08	96,288,816.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	99,600	64.00	6,374,400.00	
	メキシコペソ 小計	14,861,362		434,031,685.65 (2,044,289,239)	
ブラジルリアル	COSAN SA	33,600	68.79	2,311,344.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	701,600	21.91	15,372,056.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	913,000	21.00	19,173,000.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,600	18.49	2,803,084.00	
	BRASKEM SA-PREF A	32,300	23.79	768,417.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	149,600	11.08	1,657,568.00	
	GERDAU SA-PREF	187,000	15.74	2,943,380.00	
	KLABIN SA - UNIT	117,400	20.48	2,404,352.00	
	SUZANO SA	110,722	38.60	4,273,869.20	
	VALE SA	699,330	55.39	38,735,888.70	
	WEG SA	155,844	46.05	7,176,616.20	
	CCR SA	215,600	14.40	3,104,640.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	116,513	40.98	4,774,702.74	
	RUMO SA	211,400	23.08	4,879,112.00	
	COGNA EDUCACAO	384,192	6.76	2,597,137.92	
	B2W CIA DIGITAL	38,000	106.27	4,038,260.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	150,961	31.80	4,800,559.80	
	LOJAS RENNER S.A.	153,620	41.05	6,306,101.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	141,100	69.80	9,848,780.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	138,000	21.49	2,965,620.00	

	ATACADAO SA	74,700	19.63	1,466,361.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	30,300	69.28	2,099,184.00	
	RAIA DROGASIL SA	39,700	108.00	4,287,600.00	
	AMBEV SA	915,300	13.68	12,521,304.00	
	BRF SA	115,200	21.87	2,519,424.00	
	JBS SA	209,300	21.83	4,569,019.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	138,400	41.30	5,715,920.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	45,600	60.71	2,768,376.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	93,200	65.17	6,073,844.00	
	HYPERA SA	73,900	34.40	2,542,160.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	252,241	19.22	4,848,072.02	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	861,558	20.85	17,963,484.30	
	BANCO DO BRASIL S.A.	158,400	32.22	5,103,648.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	74,100	28.75	2,130,375.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	926,630	25.84	23,944,119.20	
	ITAUSA SA	860,707	9.77	8,409,107.39	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	395,675	52.65	20,832,288.75	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	48,400	76.70	3,712,280.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	127,100	28.37	3,605,827.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	119,900	11.06	1,326,094.00	
	PORTO SEGURO SA	15,400	52.85	813,890.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	56,658	44.26	2,507,683.08	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	127,554	10.34	1,318,908.36	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,300	21.40	969,420.00	
	CIELO SA	207,121	4.70	973,468.70	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	89,375	48.82	4,363,287.50	
	TIM PARTICIPACOES SA	149,377	13.99	2,089,784.23	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	49,300	30.80	1,518,440.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	62,200	29.43	1,830,546.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	163,773	11.04	1,808,053.92	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	18,700	61.78	1,155,286.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	60,800	60.07	3,652,256.00	
	CPFL ENERGIA SA	44,600	30.27	1,350,042.00	
	ENERGISA SA-UNITS	40,100	47.67	1,911,567.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	42,050	42.38	1,782,079.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	163,800	22.18	3,633,084.00	
	ブラジルリアル 小計	11,697,801		309,050,772.01 (6,187,196,455)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	78,409	5,794.00	454,301,746.00	
	EMPRESAS CMPC SA	237,271	1,727.00	409,767,017.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,539	21,050.00	453,395,950.00	
	FALABELLA SA	141,135	2,580.00	364,128,300.00	

	CENCOSUD SA	308,874	1,215.00	375,281,910.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,576	6,225.00	140,535,600.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	57,088	2,060.00	117,601,280.00	
	BANCO DE CHILE	8,408,646	75.50	634,852,773.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	9,439	28,231.00	266,472,409.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,826,505	34.30	405,649,121.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	94,600	1,580.00	149,468,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	26,107	5,350.10	139,675,060.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	472,237	272.00	128,448,464.00	
	COLBUN SA	1,351,330	130.00	175,672,900.00	
	ENEL AMERICAS SA	6,844,035	127.01	869,260,885.00	
	ENEL CHILE SA	6,014,289	62.88	378,178,492.00	
	チリペソ 小計	35,914,080		5,462,689,907.00 (713,973,570)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	10,450	37,500.00	391,875,000.00	
	S-OIL CORP	8,232	66,800.00	549,897,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,802	136,500.00	1,474,473,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	23,378	19,450.00	454,702,100.00	
	HYUNDAI STEEL CO	17,295	21,450.00	370,977,750.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,657	351,000.00	581,607,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2,964	77,500.00	229,710,000.00	
	LG CHEM LTD	8,840	516,000.00	4,561,440,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,367	273,500.00	373,874,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	3,322	174,500.00	579,689,000.00	
	POSCO	13,990	185,000.00	2,588,150,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,967	78,500.00	311,409,500.00	
	CJ CORP	3,215	88,300.00	283,884,500.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	5,856	86,100.00	504,201,600.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	26,032	3,580.00	93,194,560.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	6,507	24,450.00	159,096,150.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	8,098	27,300.00	221,075,400.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	10,115	25,850.00	261,472,750.00	
	HANWHA CORPORATION	10,143	23,000.00	233,289,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	15,811	34,600.00	547,060,600.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	2,060	254,000.00	523,240,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	12,156	24,800.00	301,468,800.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	7,446	90,300.00	672,373,800.00	
	LG CORP	18,503	74,400.00	1,376,623,200.00	
	LOTTE CORP	3,952	34,300.00	135,553,600.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	7,531	14,350.00	108,069,850.00	
	SAMSUNG C&T CORP	15,837	118,000.00	1,868,766,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	25,856	12,300.00	318,028,800.00	

SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	84,388	6,100.00	514,766,800.00
SK HOLDINGS CO LTD	6,564	286,500.00	1,880,586,000.00
S-1 CORPORATION	3,622	88,700.00	321,271,400.00
CJ LOGISTICS	1,801	159,500.00	287,259,500.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	4,218	111,000.00	468,198,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	16,090	18,050.00	290,424,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD-RTS	6,287	3,060.00	19,238,220.00
PAN OCEAN CO LTD	39,939	3,770.00	150,570,030.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	16,564	25,300.00	419,069,200.00
HANON SYSTEMS	43,260	9,580.00	414,430,800.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	12,695	205,000.00	2,602,475,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	27,993	103,000.00	2,883,279,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	7,722	60,600.00	467,953,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	3,585	58,000.00	207,930,000.00
KIA MOTORS CORP	51,864	33,750.00	1,750,410,000.00
COWAY CO LTD	9,531	73,800.00	703,387,800.00
FILA HOLDINGS CORP	11,149	35,850.00	399,691,650.00
HLB INC	7,869	102,500.00	806,572,500.00
LG ELECTRONICS INC	20,535	67,000.00	1,375,845,000.00
KANGWON LAND INC	19,369	22,300.00	431,928,700.00
CHEIL WORLDWIDE INC	17,976	16,700.00	300,199,200.00
KAKAO CORP	10,559	282,500.00	2,982,917,500.00
NAVER CORP	23,495	279,000.00	6,555,105,000.00
NCSOFT CORP	3,118	943,000.00	2,940,274,000.00
NETMARBLE CORP	3,622	101,000.00	365,822,000.00
PEARL ABYSS CORP	1,102	219,000.00	241,338,000.00
CJ ENM CO LTD	1,662	111,400.00	185,146,800.00
HOTEL SHILLA CO LTD	6,730	69,900.00	470,427,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	2,000	58,100.00	116,200,000.00
LOTTE SHOPPING CO	2,198	79,700.00	175,180,600.00
SHINSEGAE INC	1,181	209,500.00	247,419,500.00
BGF RETAIL CO LTD	1,349	137,000.00	184,813,000.00
E-MART INC	3,358	111,000.00	372,738,000.00
GS RETAIL CO LTD	4,031	38,150.00	153,782,650.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,754	346,000.00	606,884,000.00
KT&G CORP	22,508	79,500.00	1,789,386,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	4,722	137,000.00	646,914,000.00
OTTOGI CORPORATION	187	572,000.00	106,964,000.00
AMOREPACIFIC CORP	6,519	155,000.00	1,010,445,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,222	60,500.00	73,931,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	4,695	49,850.00	234,045,750.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,764	1,345,000.00	2,372,580,000.00

	LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	343	713,000.00	244,559,000.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	13,396	112,900.00	1,512,408,400.00	
	CELLTRION INC	18,115	319,000.00	5,778,685,000.00	
	CELLTRION PHARM INC	2,819	136,600.00	385,075,400.00	
	HANMI PHARM CO LTD	1,079	257,000.00	277,303,000.00	
	HELIXMITH CO LTD	3,937	65,000.00	255,905,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,221	819,000.00	2,637,999,000.00	
	YUHAN CORP	9,295	53,100.00	493,564,500.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	48,834	5,100.00	249,053,400.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	55,632	27,650.00	1,538,224,800.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	54,119	8,300.00	449,187,700.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	74,211	34,900.00	2,589,963,900.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	86,148	30,200.00	2,601,669,600.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	105,445	9,250.00	975,366,250.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	8,663	48,250.00	417,989,750.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	58,500	3,230.00	188,955,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	66,513	6,980.00	464,260,740.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	20,867	8,820.00	184,046,940.00	
	SAMSUNG CARD CO	4,545	28,200.00	128,169,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	9,939	27,900.00	277,298,100.00	
	DB INSURANCE CO LTD	9,631	44,000.00	423,764,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	10,238	25,250.00	258,509,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,018	186,500.00	1,122,357,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	13,439	46,400.00	623,569,600.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	3,400	108,500.00	368,900,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	6,817	179,000.00	1,220,243,000.00	
	KMW CO LTD	6,037	62,900.00	379,727,300.00	
	LG DISPLAY CO LTD	45,899	12,000.00	550,788,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,514	168,000.00	422,352,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	10,498	136,000.00	1,427,728,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	909,180	52,900.00	48,095,622,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	156,279	47,000.00	7,345,113,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	10,394	380,500.00	3,954,917,000.00	
	LG UPLUS CORP	46,629	12,250.00	571,205,250.00	
	SK TELECOM	3,819	205,500.00	784,804,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	49,082	19,850.00	974,277,700.00	
	KOREA GAS CORPORATION	3,688	27,300.00	100,682,400.00	
	SK HYNIX INC	103,648	86,000.00	8,913,728,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,849,010		157,790,977,090.00 (14,043,396,961)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	219,150	89.00	19,504,350.00	
	ASIA CEMENT CORP	397,281	43.45	17,261,859.45	

CHINA STEEL CORP	2,231,947	20.85	46,536,094.95
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	662,430	75.50	50,013,465.00
FORMOSA PLASTICS CORP	719,600	87.40	62,893,040.00
NAN YA PLASTICS CORP	980,557	64.70	63,442,037.90
TAIWAN CEMENT	896,563	42.85	38,417,724.55
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	25,000	514.00	12,850,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	587,138	27.75	16,293,079.50
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	47,405	295.50	14,008,177.50
CHINA AIRLINES LTD	405,000	8.39	3,397,950.00
EVA AIRWAYS CORP	615,365	11.40	7,015,161.00
EVERGREEN MARINE CORP LTD	439,883	10.75	4,728,742.25
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	386,000	36.85	14,224,100.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	306,413	34.50	10,571,248.50
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	31,728	338.00	10,724,064.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	54,318	180.00	9,777,240.00
FORMOSA TAFFETA CO.	131,000	37.25	4,879,750.00
GIANT MANUFACTURING	62,000	261.50	16,213,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	28,000	297.00	8,316,000.00
POU CHEN	419,500	28.95	12,144,525.00
TATUNG CO LTD	297,000	21.00	6,237,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	57,000	689.00	39,273,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	110,000	300.00	33,000,000.00
STANDARD FOODS CORP	110,023	63.00	6,931,449.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	913,624	71.40	65,232,753.60
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	989,563	19.55	19,345,956.65
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	3,298,955	20.25	66,803,838.75
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,970,106	27.95	55,064,462.70
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,984,816	22.70	45,055,323.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,500,878	19.90	29,867,472.20
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,124,754	31.25	66,398,562.50
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,861,018	11.10	20,657,299.80
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,969,316	13.55	26,684,231.80
TAIWAN BUSINESS BANK	1,190,859	10.85	12,920,820.15
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,678,824	20.80	34,919,539.20
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	641,000	45.10	28,909,100.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	218,478	119.00	25,998,882.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD-NEW	8,739	119.00	1,039,941.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,822,321	18.40	33,530,706.40
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,512,366	42.20	63,821,845.20
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,557,255	9.34	23,884,761.70
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	455,056	22.00	10,011,232.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,248,087	44.15	55,103,041.05

SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	2,271,852	8.66	19,674,238.32
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	105,000	43.90	4,609,500.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	108,720	50.60	5,501,232.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	93,000	223.50	20,785,500.00
ACER INC	573,168	18.00	10,317,024.00
ADVANTECH CO LTD	64,676	294.00	19,014,744.00
ASUSTEK COMPUTER INC	138,774	223.50	31,015,989.00
AU OPTRONICS CORP	1,766,000	9.34	16,494,440.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	130,000	222.50	28,925,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	101,766	84.60	8,609,403.60
COMPAL ELECTRONICS	806,775	19.45	15,691,773.75
DELTA ELECTRONICS INC	372,220	168.00	62,532,960.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	163,042	55.90	9,114,047.80
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,376,272	83.50	198,418,712.00
INNOLUX CORP	1,733,112	7.86	13,622,260.32
INVENTEC CORP	488,429	25.70	12,552,625.30
LARGAN PRECISION CO LTD	18,820	4,010.00	75,468,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	391,160	47.30	18,501,868.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	140,000	106.50	14,910,000.00
PEGATRON CORP	393,976	70.10	27,617,717.60
QUANTA COMPUTER INC	556,150	70.90	39,431,035.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	237,193	41.30	9,796,070.90
WALSIN TECHNOLOGY CORP	65,000	188.50	12,252,500.00
WISTRON CORP	525,865	35.65	18,747,087.25
WIWYNN CORP	15,000	799.00	11,985,000.00
WPG HOLDINGS LTD	335,168	39.45	13,222,377.60
YAGEO CORPORATION	68,952	407.50	28,097,940.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	110,000	133.50	14,685,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	733,000	114.50	83,928,500.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	291,000	67.00	19,497,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	308,400	108.00	33,307,200.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	625,294	68.00	42,519,992.00
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	406.50	17,073,000.00
MEDIATEK INC	287,236	580.00	166,596,880.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	217,000	60.80	13,193,600.00
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	116,000	228.00	26,448,000.00
PHISON ELECTRONICS CORP	23,000	292.00	6,716,000.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	147,300	103.00	15,171,900.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	92,703	306.50	28,413,469.50
SILERGY CORP	15,000	1,885.00	28,275,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,691,000	317.50	1,489,392,500.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,117,000	15.75	33,342,750.00



	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	185,000	78.30	14,485,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	61,000	295.00	17,995,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	460,000	13.40	6,164,000.00	
	ニュー台湾ドル 小計	62,728,339		4,018,017,366.44 (14,585,403,040)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	115,594	378.55	43,758,108.70	
	COAL INDIA LTD	238,400	141.55	33,745,520.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	105,207	228.40	24,029,278.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	373,789	87.10	32,557,021.90	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	489,850	83.10	40,706,535.00	
	PETRONET LNG LTD	133,659	262.65	35,105,536.35	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	543,157	1,727.85	938,493,822.45	
	AMBUJA CEMENTS LTD	135,329	188.70	25,536,582.30	
	ASIAN PAINTS LTD	53,729	1,747.25	93,877,995.25	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	44,660	540.80	24,152,128.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	54,756	613.65	33,601,019.40	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	240,897	151.40	36,471,805.80	
	JSW STEEL LTD	181,540	193.90	35,200,606.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	26,343	1,404.15	36,989,523.45	
	SHREE CEMENT LTD	1,824	22,566.25	41,160,840.00	
	TATA STEEL LTD	54,834	326.05	17,878,625.70	
	ULTRATECH CEMENT LTD	23,025	3,821.60	87,992,340.00	
	UPL LTD	85,811	444.95	38,181,604.45	
	VEDANTA LTD	332,594	109.45	36,402,413.30	
	HAVELLS INDIA LTD	51,739	582.10	30,117,271.90	
	LARSEN & TOUBRO LTD	88,309	955.55	84,383,664.95	
	SIEMENS LTD	10,672	1,094.30	11,678,369.60	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	92,656	351.85	32,601,013.60	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	32,335	417.75	13,507,946.25	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	15,619	1,062.50	16,595,187.50	
	BAJAJ AUTO LTD	14,978	2,817.25	42,196,770.50	
	BHARAT FORGE LTD	53,198	356.65	18,973,066.70	
	BOSCH LTD	1,117	11,401.30	12,735,252.10	
	EICHER MOTORS LTD	2,432	18,436.85	44,838,419.20	
	HERO MOTOCORP LTD	18,137	2,493.80	45,230,050.60	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	142,365	515.35	73,367,802.75	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	23,024	5,755.35	132,511,178.40	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	151,457	95.70	14,494,434.90	
	TATA MOTORS LTD	369,721	104.80	38,746,760.80	
	PAGE INDUSTRIES LTD	1,074	20,753.90	22,289,688.60	
	TITAN CO LTD	63,266	988.20	62,519,461.20	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	13,156	1,767.65	23,255,203.40	

INFO EDGE INDIA LTD	12,518	2,712.05	33,949,441.90
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	147,513	174.10	25,682,013.30
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,138	2,358.35	66,359,252.30
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,326	3,446.40	39,033,926.40
ITC LTD	652,664	191.85	125,213,588.40
NESTLE INDIA LTD	4,245	16,707.95	70,925,247.75
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	77,000	383.10	29,498,700.00
UNITED SPIRITS LTD	53,355	608.00	32,439,840.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	13,677	1,388.35	18,988,462.95
DABUR INDIA LTD	94,514	455.05	43,008,595.70
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	81,841	671.70	54,972,599.70
HINDUSTAN UNILEVER LTD	157,131	2,130.30	334,736,169.30
MARICO LTD	94,747	338.75	32,095,546.25
AUROBINDO PHARMA LTD	52,503	791.95	41,579,750.85
BIOCON LTD	50,755	389.90	19,789,374.50
CIPLA LTD	65,246	631.20	41,183,275.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	13,924	2,341.35	32,600,957.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	22,330	4,042.65	90,272,374.50
LUPIN LTD	43,303	921.40	39,899,384.20
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	15,818	1,240.40	19,620,647.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	161,560	484.40	78,259,664.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,990	2,462.05	22,133,829.50
AXIS BANK LTD	394,911	424.65	167,698,956.15
BANDHAN BANK LTD	73,800	331.35	24,453,630.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	314,092	1,797.75	564,658,893.00
ICICI BANK LTD	922,252	348.10	321,035,921.20
LIC HOUSING FINANCE LTD	50,241	270.40	13,585,166.40
STATE BANK OF INDIA	347,235	184.60	64,099,581.00
BAJAJ FINANCE LTD	33,410	2,934.45	98,039,974.50
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	8,941	2,447.30	21,881,309.30
REC LTD	126,676	112.90	14,301,720.40
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,379	682.25	10,492,322.75
BAJAJ FINSERV LTD	7,537	6,046.05	45,569,078.85
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	142,800	527.25	75,291,300.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	41,277	1,293.10	53,375,288.70
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	63,100	430.65	27,174,015.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	71,900	780.75	56,135,925.00
DLF LTD	138,319	160.05	22,137,955.95
HCL TECHNOLOGIES LTD	210,747	559.60	117,934,021.20
INFOSYS LTD	649,044	714.15	463,514,772.60
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	172,110	2,042.20	351,483,042.00
TECH MAHINDRA LTD	82,825	560.95	46,460,683.75

	WIPRO LTD	220,999	218.20	48,221,981.80	
	BHARTI AIRTEL LTD	472,969	557.35	263,609,272.15	
	BHARTI INFRA TEL LTD	49,169	233.05	11,458,835.45	
	GAIL INDIA LTD	325,150	101.40	32,970,210.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	36,632	443.55	16,248,123.60	
	NTPC LTD	428,056	97.05	41,542,834.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	369,017	178.50	65,869,534.50	
	インドルピー 小計	12,011,939		6,707,369,841.15 (9,524,465,174)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	16,748	567.00	9,496,116.00	
	MONETA MONEY BANK AS	101,820	55.70	5,671,374.00	
	CEZ AS	30,444	495.00	15,069,780.00	
	チェココルナ 小計	149,012		30,237,270.00 (136,370,087)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	1,058,563	2,090.00	2,212,396,670.00	
	BANCOLOMBIA SA	39,604	25,000.00	990,100,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	87,511	24,720.00	2,163,271,920.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	38,050	19,280.00	733,604,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	91,762	18,800.00	1,725,125,600.00	
	コロンビアペソ 小計	1,315,490		7,824,498,190.00 (224,563,098)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	76,580	1,912.00	146,420,960.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	26,853	6,750.00	181,257,750.00	
	OTP BANK PLC	43,226	11,620.00	502,286,120.00	
	ハンガリーフォリント 小計	146,659		829,964,830.00 (284,262,954)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	575,797	5.02	2,890,500.94	
	DUBAI ISLAMIC BANK	378,667	3.88	1,469,227.96	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	536,876	11.22	6,023,748.72	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	820,642	1.85	1,518,187.70	
	EMAAR MALLS PJSC	731,313	1.44	1,053,090.72	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	790,788	2.80	2,214,206.40	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	353,612	16.90	5,976,042.80	
	アラブディルハム 小計	4,187,695		21,145,005.24 (617,434,153)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	15,889	59.10	939,039.90	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	57,472	64.08	3,682,805.76	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	368,052	4.40	1,620,164.90	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	26,966	88.56	2,388,108.96	
	LPP SA	260	6,555.00	1,704,300.00	
	CD PROJEKT SA	12,909	407.60	5,261,708.40	
	CYFROWY POLSAT SA	48,046	26.54	1,275,140.84	
	DINO POLSKA SA	10,080	201.00	2,026,080.00	

	BANK PEKAO SA	37,668	54.60	2,056,672.80
	MBANK SA	2,305	241.20	555,966.00
	PKO BANK POLSKI SA	164,806	22.81	3,759,224.86
	SANTANDER BANK POLSKA SA	6,517	180.40	1,175,666.80
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	114,089	29.27	3,339,385.03
	ORANGE POLSKA SA	110,607	6.16	681,892.15
	PGE SA	148,359	7.33	1,088,361.62
	ポーランドズロチ 小計	1,124,025		31,554,518.02 (852,918,622)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	53,022	131.53	6,973,983.66
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	9,699	1,212.00	11,755,188.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	77,932	497.24	38,750,907.68
	GOLD FIELDS LTD	172,551	155.71	26,867,916.21
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,665	114.50	17,251,142.50
	KUMBA IRON ORE LTD	13,805	490.57	6,772,318.85
	NORTHAM PLATINUM LTD	73,043	109.73	8,015,008.39
	SASOL LTD	111,300	140.00	15,582,000.00
	SIBANYE STILLWATER LTD	435,901	36.00	15,692,436.00
	BIDVEST GROUP LTD	51,937	149.00	7,738,613.00
	MULTICHOICE GROUP LTD	81,412	106.71	8,687,474.52
	MR PRICE GROUP LTD	53,931	145.72	7,858,825.32
	NASPERS LTD-N SHS	84,574	3,167.51	267,888,990.74
	PEPKOR HOLDINGS LTD	123,600	11.41	1,410,276.00
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	207,846	33.61	6,985,704.06
	BID CORP LTD	64,043	286.66	18,358,566.38
	CLICKS GROUP LTD	45,600	218.04	9,942,624.00
	PICK N PAY STORES LTD	55,770	52.54	2,930,155.80
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	101,866	107.83	10,984,210.78
	SPAR GROUP LIMITED/THE	32,210	175.00	5,636,750.00
	TIGER BRANDS LTD	26,414	178.50	4,714,899.00
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	230,622	17.22	3,971,310.84
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	75,342	146.63	11,047,397.46
	ABSA GROUP LTD	132,975	88.24	11,733,714.00
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,709	857.41	7,467,183.69
	NEDBANK GROUP LTD	65,739	106.12	6,976,222.68
	STANDARD BANK GROUP LTD	245,339	103.71	25,444,107.69
FIRSTRAND LTD	925,053	39.59	36,622,848.27	
PSG GROUP LTD	33,344	158.62	5,289,025.28	
REINET INVESTMENTS SCA	26,395	286.06	7,550,553.70	
REMGRO LTD	101,024	103.21	10,426,687.04	
DISCOVERY LTD	80,303	106.12	8,521,754.36	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN	144,183	18.00	2,595,294.00	

	OLD MUTUAL LTD	985,060	11.65	11,475,949.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	139,332	29.69	4,136,767.08	
	SANLAM LTD	346,686	58.82	20,392,070.52	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	82,474	87.55	7,220,598.70	
	MTN GROUP LTD	313,960	53.90	16,922,444.00	
	VODACOM GROUP LTD	130,082	123.51	16,066,427.82	
	南アフリカランド 小計	6,093,743		714,658,347.02 (4,395,148,834)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	57,700	5.68	327,736.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	242,225	3.97	961,633.25	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	41,728	14.68	612,567.04	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	26,000	6.54	170,040.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	331,200	2.73	904,176.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	4.60	193,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	308,400	4.26	1,313,784.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	79,200	7.26	574,992.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	28,400	5.85	166,140.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	39,000	6.37	248,430.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	38,870	3.73	144,985.10	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	30.94	281,554.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	21,055	8.80	185,284.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	124,400	2.77	344,588.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	50,680	2.55	129,234.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	49,000	54.10	2,650,900.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	176,396	4.60	811,421.60	
	BBMG CORPORATION-A	79,100	3.08	243,628.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	14,200	40.48	574,816.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	33,200	9.38	311,416.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	365,201	3.70	1,351,243.70	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	34,500	9.41	324,645.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	10,308	54.03	556,941.24	
	GEM CO LTD-A	39,400	4.92	193,848.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	28,700	6.70	192,290.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	9,000	35.80	322,200.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	55,700	13.76	766,432.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	35,148	8.93	313,871.64	
	HESTEEL CO LTD-A	100,800	2.06	207,648.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	12,900	24.27	313,083.00	
	HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	40,200	3.82	153,564.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	433,400	1.08	468,072.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	80,316	2.58	207,215.28	
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	48,700	13.35	650,145.00	

JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	2,900	81.51	236,379.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	19,700	13.28	261,616.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	25,500	6.09	155,295.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	19,300	17.87	344,891.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	56,600	2.59	146,594.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	81,700	2.04	166,668.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	90,700	11.98	1,086,586.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	23,300	6.81	158,673.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	24,660	36.48	899,596.80
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,500	18.09	280,395.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	113,700	2.02	229,674.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	9,200	32.67	300,564.00
SHANDONG SUN PAPERIndustr-A	24,600	9.36	230,256.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	8,600	100.97	868,342.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	54,100	3.34	180,694.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	58,100	3.50	203,350.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	12,800	16.55	211,840.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	26,600	25.80	686,280.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	17,600	13.02	229,152.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	100,100	1.91	191,191.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	30,906	5.50	169,983.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	29,800	50.02	1,490,596.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	4,900	62.00	303,800.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	11.75	157,450.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	18,900	15.71	296,919.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	6,400	66.46	425,344.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	10,250	38.32	392,780.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	26,100	6.85	178,785.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	30,900	12.68	391,812.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	32,700	8.96	292,992.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	281,300	4.38	1,232,094.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	10,900	13.66	148,894.00
AECC AVIATION POWER CO-A	21,400	23.35	499,690.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	26,300	17.71	465,773.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	34,300	7.91	271,313.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	8,800	32.25	283,800.00
AVICOPTER PLC-A	5,500	40.68	223,740.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	16,100	21.60	347,760.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	58,800	2.98	175,224.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	25,900	6.44	166,796.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	13,900	13.29	184,731.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	26,000	7.46	193,960.00

CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	43,700	5.95	260,015.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	10,200	14.36	146,472.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	46,800	5.53	258,804.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	109,300	8.47	925,771.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	291,100	5.07	1,475,877.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	217,404	4.01	871,790.04
CHINA SPACESAT CO LTD -A	11,200	31.05	347,760.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	533,680	4.84	2,583,011.20
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	25,508	171.50	4,374,622.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	75,100	1.86	139,686.00
CRRC CORP LTD-A	231,325	5.59	1,293,106.75
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	26,100	8.97	234,117.00
EVE ENERGY CO LTD-A	17,488	44.38	776,117.44
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	36,143	6.45	233,122.35
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	10,800	26.62	287,496.00
GUOCHENG MINING CO LTD-A	37,800	18.43	696,654.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	6,400	53.10	339,840.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	7,100	39.09	277,539.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	16,100	10.23	164,703.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	8,400	76.26	640,584.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	29,200	11.30	329,960.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	169,634	2.52	427,477.68
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	26,700	25.43	678,981.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	43,900	20.73	910,047.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	121,200	3.51	425,412.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	79,516	18.53	1,473,431.48
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	3.08	260,260.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	77,300	5.06	391,138.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	29,774	5.74	170,902.76
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15,900	36.96	587,664.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	14,800	13.78	203,944.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	14,700	19.19	282,093.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	25,400	7.84	199,136.00
TBEA CO LTD-A	35,200	6.87	241,824.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	56,851	13.54	769,762.54
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	74,400	5.88	437,472.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	8.89	239,141.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	32,800	9.98	327,344.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,500	26.12	535,460.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	75.40	348,348.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	34,113	21.88	746,392.44
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	15,000	11.81	177,150.00

ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	21,000	12.08	253,680.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	60,900	6.25	380,625.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	30,000	8.20	246,000.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	15,800	18.97	299,726.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8,800	52.78	464,464.00
AIR CHINA LTD-A	142,600	6.65	948,290.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	88,800	4.25	377,400.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	81,800	5.18	423,724.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	276,200	3.44	950,128.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	141,289	7.07	998,913.23
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	19,688	15.33	301,817.04
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	443,900	1.51	670,289.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	15,600	9.16	142,896.00
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	83,600	3.54	295,944.00
S F HOLDING CO LTD-A	30,700	55.20	1,694,640.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	9,100	70.86	644,826.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	80,900	4.22	341,398.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	19,500	7.66	149,370.00
SINOTRANS LIMITED-A	41,600	3.24	134,784.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,700	36.20	314,940.00
STO EXPRESS CO LTD-A	37,900	16.64	630,656.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	18,460	24.59	453,931.40
BYD CO LTD -A	17,200	71.70	1,233,240.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,600	122.04	317,304.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	37,000	11.33	419,210.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,938	21.24	402,243.12
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	29,900	20.82	622,518.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	23.07	285,145.20
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	31,200	27.25	850,200.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	97,044	18.19	1,765,230.36
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	11,400	20.47	233,358.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	7,900	20.39	161,081.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	20,800	6.42	133,536.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	40,593	57.22	2,322,731.46
HAIER SMART HOME CO LTD-A	57,929	17.92	1,038,087.68
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	31.77	285,930.00
JOYOUNG CO LTD -A	21,300	37.04	788,952.00
NAVINFO CO LTD-A	18,600	15.76	293,136.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	2,655	116.61	309,599.55
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	8,700	22.67	197,229.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	128,600	6.14	789,604.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	13,800	56.75	783,150.00



ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	17,100	7.08	121,068.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	69.61	361,972.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	9,400	15.63	146,922.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	25,100	27.87	699,537.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	6,400	28.36	181,504.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	78,000	6.12	477,360.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	18.22	452,639.46
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	11.43	318,897.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	31,200	24.40	761,280.00
CHINA FILM CO LTD-A	14,700	12.94	190,218.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	17,000	10.65	181,050.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A	13,000	12.10	157,300.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,502	5.55	774,236.10
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	700	524.33	367,031.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	12,800	17.61	225,408.00
LEO GROUP CO LTD-A	173,000	4.03	697,190.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	25,280	62.90	1,590,112.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	23,400	22.60	528,840.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	32,600	9.69	315,894.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	12,200	56.10	684,420.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	19,800	15.55	307,890.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	20,000	43.50	870,000.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	8,400	25.97	218,148.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	50,600	15.73	795,938.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	26,299	127.30	3,347,862.70
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	14,500	18.70	271,150.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	8.80	271,040.00
SUNING.COM CO LTD-A	166,680	8.93	1,488,452.40
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.22	203,404.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	2,700	94.00	253,800.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	5,040	84.50	425,880.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	91,000	9.42	857,220.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	46.30	361,140.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,600	149.88	539,568.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5,625	49.28	277,200.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	8.86	357,058.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	7,000	55.38	387,660.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	26,800	6.69	179,292.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	12,500	53.71	671,375.00
CHONGQING BREWERY CO-A	4,600	67.56	310,776.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	7,500	35.48	266,100.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	31,586	123.80	3,910,346.80

FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	28.95	283,710.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	15,000	47.34	710,100.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	16,900	14.60	246,740.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	26,200	43.83	1,148,346.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	82,100	30.82	2,530,322.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	11,890	38.01	451,938.90
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	14,281	105.33	1,504,217.73
JIANGXI ZHENGHANG TECH -A	23,200	16.85	390,920.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	56.21	427,196.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	5,500	69.08	379,940.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,378	1,460.01	19,532,013.78
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	13,900	92.46	1,285,194.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	38,760	75.20	2,914,752.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	40,000	28.40	1,136,000.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,300	138.18	1,146,894.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	4,600	62.36	286,856.00
TOLY BREAD CO LTD-A	5,200	49.79	258,908.00
TONGWEI CO LTD-A	37,000	17.20	636,400.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	72.20	476,520.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	60,540	21.90	1,325,826.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,100	168.61	6,929,871.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	12,500	16.33	204,125.00
BY-HEALTH CO LTD-A	15,000	22.01	330,150.00
C&S PAPER CO LTD-A	35,999	21.23	764,258.77
PROYA COSMETICS CO LTD-A	4,500	173.85	782,325.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	6,400	46.80	299,520.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	38,252	44.05	1,685,000.60
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	2,700	167.15	451,305.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	3,600	47.90	172,440.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	7,200	49.52	356,544.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	86.35	379,940.00
GUANGZHOU WONFO BIOTECH C-A	7,700	96.52	743,204.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	16,640	24.10	401,024.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	7,600	65.28	496,128.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	9,500	33.82	321,290.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	17,800	17.88	318,264.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,960	35.79	606,998.40
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	13.45	478,282.00
OVCTEK CHINA INC-A	5,700	66.50	379,050.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	18,300	18.49	338,367.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	10,600	299.19	3,171,414.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,000	156.30	468,900.00

WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	20,020	20.47	409,809.40
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	15,000	22.00	330,000.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	2,200	231.00	508,200.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	9,900	43.88	434,412.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	13,000	26.69	346,970.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3,800	135.71	515,698.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	3,800	145.98	554,724.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	5,200	417.60	2,171,520.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	6,900	44.70	308,430.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,300	28.62	266,166.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	21,098	99.90	2,107,690.20
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	12,100	27.02	326,942.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	6,200	37.17	230,454.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,400	32.04	429,336.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	97.62	692,028.18
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	17,290	48.03	830,438.70
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	7,800	23.88	186,264.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	57,636	92.95	5,357,266.20
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	11,100	15.71	174,381.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	10,700	26.25	280,875.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	16.26	299,184.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	47.18	273,644.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	5,700	59.30	338,010.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	10,780	27.33	294,617.40
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	19,200	32.66	627,072.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	57,900	8.42	487,518.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	9,900	23.84	236,016.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,041	153.70	928,501.70
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	8,200	27.49	225,418.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	11,500	30.58	351,670.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	13,600	20.74	282,064.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	132,800	5.45	723,760.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,300	15.67	302,431.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	14,680	53.67	787,875.60
WUXI APPTec CO LTD-A	19,460	95.88	1,865,824.80
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	11,700	22.85	267,345.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,100	94.10	1,138,610.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	5,800	165.26	958,508.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	25,300	5.57	140,921.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	13,860	33.27	461,122.20
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	20,400	28.20	575,280.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	5,000	59.82	299,100.00

AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	708,100	3.37	2,386,297.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	200,800	4.90	983,920.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	34,393	7.95	273,424.35
BANK OF CHINA LTD-A	333,900	3.46	1,155,294.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	506,033	5.12	2,590,888.96
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	48,700	9.07	441,709.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	109,620	5.69	623,737.80
BANK OF NANJING CO LTD -A	169,500	7.41	1,255,995.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	80,011	26.11	2,089,087.21
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	134,969	8.24	1,112,144.56
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	53,900	5.07	273,273.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	91,200	6.32	576,384.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	378,310	3.59	1,358,132.90
CHINA MERCHANTS BANK-A	235,999	33.90	8,000,366.10
CHINA MINSHENG BANKING-A	430,928	5.67	2,443,361.76
HUAXIA BANK CO LTD-A	198,750	6.13	1,218,337.50
IND & COMM BK OF CHINA-A	646,128	5.22	3,372,788.16
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	228,374	15.84	3,617,444.16
JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A	26,000	7.49	194,740.00
PING AN BANK CO LTD-A	203,161	12.80	2,600,460.80
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	156,900	4.45	698,205.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	327,937	10.60	3,476,132.20
AVIC CAPITAL CO LTD -A	85,300	3.97	338,641.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	34,125	10.59	361,383.75
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	52,500	6.90	362,250.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	70,200	11.54	810,108.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	12.73	738,340.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	54,300	20.17	1,095,231.00
CITIC SECURITIES CO-A	119,445	24.25	2,896,541.25
CSC FINANCIAL CO LTD-A	26,300	37.95	998,085.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	11.04	289,248.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	76,597	19.18	1,469,130.46
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	37,200	14.79	550,188.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	33,200	7.04	233,728.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	78,300	7.13	558,279.00
GF SECURITIES CO LTD-A	56,200	14.37	807,594.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	39,000	11.35	442,650.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	114,300	17.36	1,984,248.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	8.65	275,935.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	133,879	12.87	1,723,022.73
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,130	128.02	656,742.60
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	34,400	6.81	234,264.00

HUATAI SECURITIES CO LTD-A	108,940	19.46	2,119,972.40
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	24,900	10.94	272,406.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	63,600	6.15	391,140.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	31,300	14.65	458,545.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	22,200	8.66	192,252.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	56,800	9.63	546,984.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	64,800	3.23	209,304.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	33,500	12.77	427,795.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	40,000	4.41	176,400.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	26,900	6.39	171,891.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	214,214	4.84	1,036,795.76
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	28,700	11.52	330,624.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	28,500	8.29	236,265.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	4.62	248,094.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	115,900	6.25	724,375.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	33,200	8.25	273,900.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	26,400	10.11	266,904.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	26,400	28.23	745,272.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	75,700	27.51	2,082,507.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	47,000	5.28	248,160.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	19,786	44.82	886,808.52
PICC HOLDING CO-A	81,000	6.47	524,070.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	122,522	72.26	8,853,439.72
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	24,500	5.83	142,835.00
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	38,700	4.08	157,896.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	28,500	22.95	654,075.00
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	21,688	30.33	657,797.04
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	75,223	16.69	1,255,471.87
CHINA VANKE CO LTD -A	111,356	26.40	2,939,798.40
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	28,300	6.65	188,195.00
GEMDALE CORP-A	42,900	13.43	576,147.00
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	31,100	5.08	157,988.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	77,200	5.67	437,724.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	35,200	8.87	312,224.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	50,700	8.03	407,121.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	32,901	3.80	125,023.80
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	113,000	14.74	1,665,620.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	41,300	8.12	335,356.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	21,500	31.77	683,055.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	14,800	18.95	280,460.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	28,600	5.44	155,584.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	81,700	3.00	245,100.00

YANGO GROUP CO LTD-A	38,500	6.56	252,560.00
YOUNGOR GROUP CO-A	106,400	6.01	639,464.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	229,500	3.25	745,875.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	51,100	18.89	965,279.00
AISINO CORP-A	17,800	16.63	296,014.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	14,300	52.50	750,750.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	8,400	39.00	327,600.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	14,700	26.53	389,991.00
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	26,700	27.97	746,799.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	4,700	79.12	371,864.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	14,100	22.97	323,877.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	29,500	12.39	365,505.00
GLODON CO LTD-A	10,700	69.95	748,465.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	10,049	103.97	1,044,794.53
IFLYTEK CO LTD - A	21,000	36.58	768,180.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	9,900	15.90	157,410.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,200	189.76	607,232.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	54,860	2.77	151,962.20
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	8,000	58.58	468,640.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	8,200	18.73	153,586.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	11,800	69.12	815,616.00
VENUSTECH GROUP INC-A	8,500	40.98	348,330.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	23,200	8.79	203,928.00
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	32,300	22.51	727,073.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	30,615	43.70	1,337,875.50
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	6,400	32.59	208,576.00
ADDSINO CO LTD -A	15,000	13.42	201,300.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	10,000	37.36	373,600.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	321,800	4.53	1,457,754.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	16,597	25.74	427,206.78
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	27,800	13.04	362,512.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	12,040	39.66	477,506.40
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	11,100	29.17	323,787.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	88,700	15.52	1,376,624.00
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	8,000	34.55	276,400.00
GOERTEK INC -A	30,800	27.16	836,528.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	22,900	12.12	277,548.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	21,800	12.76	278,168.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	8,400	95.90	805,560.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	102,910	30.27	3,115,085.70
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	18,000	16.56	298,080.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	29,600	5.23	154,808.00

HUAGONG TECH CO LTD-A	33,500	24.47	819,745.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	9,500	13.32	126,540.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	12,300	41.80	514,140.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	31,100	25.51	793,361.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	24,200	6.13	148,346.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	54,200	10.93	592,406.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	66,012	49.04	3,237,228.48
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	169.04	743,776.00
NINESTAR CORP-A	10,100	34.46	348,046.00
OFILM GROUP CO LTD-A	25,700	17.50	449,750.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	21,600	29.88	645,408.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,480	167.09	748,563.20
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	29,600	23.71	701,816.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	9,200	50.02	460,184.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	15,300	29.44	450,432.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	9,000	36.60	329,400.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	19,400	15.28	296,432.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	16,120	42.58	686,389.60
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	13,800	21.36	294,768.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	8,000	21.34	170,720.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	10,000	126.19	1,261,900.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	15,130	26.69	403,819.70
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	20,000	10.75	215,000.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	16,400	24.96	409,344.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	8,400	46.05	386,820.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,050	67.00	472,350.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,500	19.09	544,065.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	5,700	62.10	353,970.00
ZTE CORP-A	44,200	39.71	1,755,182.00
CHINA UNITED NETWORK-A	295,000	4.87	1,436,650.00
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	28,400	4.59	130,356.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	123,205	4.12	507,604.60
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	241,064	19.09	4,601,911.76
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	186,400	1.85	344,840.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	64,400	3.42	220,248.00
HUANENG POWER INTL INC-A	157,200	4.21	661,812.00
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	41,300	3.52	145,376.00
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	55,000	2.47	135,850.00
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	15,000	14.06	210,900.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	64,500	7.88	508,260.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	24,800	7.40	183,520.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	46,600	5.92	275,872.00

	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	37,560	4.72	177,283.20
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	41,800	9.30	388,740.00
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	48,300	2.57	124,131.00
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,340	244.07	1,059,263.80
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	12,500	14.79	184,875.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	50,434	38.00	1,916,492.00
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	38,800	24.20	938,960.00
	SG MICRO CORP-A	2,700	300.40	811,080.00
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	3,600	226.28	814,608.00
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	26,500	20.89	553,585.00
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	51,100	13.66	698,026.00
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	24.29	706,839.00
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	5,700	71.59	408,063.00
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	13,000	14.03	182,390.00
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,500	206.68	1,136,740.00
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	58,800	11.95	702,660.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	29,700	24.30	721,710.00
	オフショア元 小計	25,077,409		349,233,195.60 (5,283,898,249)
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	32,700	13.38	437,526.00
	SAUDI ARABIAN OIL CO	226,598	32.80	7,432,414.40
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	17,512	53.00	928,136.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	48,940	10.12	495,272.80
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	77,416	14.14	1,094,662.24
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	41,469	74.30	3,081,146.70
	SAUDI ARABIAN MINING CO	86,949	35.30	3,069,299.70
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	170,252	87.80	14,948,125.60
	SAUDI CEMENT	11,200	51.00	571,200.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	32,930	20.02	659,258.60
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	144,273	8.29	1,196,023.17
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,276	51.60	2,645,841.60
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	6,030	78.80	475,164.00
	JARIR MARKETING CO	12,646	145.80	1,843,786.80
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	8,000	114.20	913,600.00
	ALMARAI CO	46,959	55.00	2,582,745.00
	SAVOLA	52,366	44.90	2,351,233.40
	AL RAJHI BANK	233,789	57.50	13,442,867.50
	ALINMA BANK	200,518	14.60	2,927,562.80
	ARAB NATIONAL BANK	106,309	19.42	2,064,520.78
	BANK AL-JAZIRA	81,590	11.18	912,176.20
	BANK ALBILAD	63,262	22.12	1,399,355.44
	BANQUE SAUDI FRANSI	119,495	30.05	3,590,824.75



	NATIONAL COMMERCIAL BANK	279,052	37.25	10,394,687.00	
	RIYAD BANK	265,259	16.72	4,435,130.48	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	181,351	23.00	4,171,073.00	
	SAUDI BRITISH BANK	142,160	21.82	3,101,931.20	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	10,773	114.40	1,232,431.20	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	14,550	70.00	1,018,500.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	117,066	6.99	818,291.34	
	EMAAR ECONOMIC CITY	57,120	6.71	383,275.20	
	ETIHAD ETISALAT CO	78,370	27.15	2,127,745.50	
	SAUDI TELECOM CO	115,569	99.00	11,441,331.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	150,064	15.96	2,395,021.44	
	サウジアラビアリアル 小計	3,283,813		110,582,160.84 (3,161,543,978)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	20,156	89.00	1,793,884.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	294,834	8.37	2,467,760.58	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	77,548	31.50	2,442,762.00	
	KOC HOLDING AS	155,842	17.10	2,664,898.20	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	26,912	19.10	514,019.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,226	12.40	1,069,202.40	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	14,221	71.35	1,014,668.35	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	89,057	70.95	6,318,594.15	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	50,431	20.28	1,022,740.68	
	AKBANK T.A.S.	562,940	5.96	3,355,122.40	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	460,073	8.19	3,767,997.87	
	TURKIYE IS BANKASI-C	268,383	5.34	1,433,165.22	
	YAPI VE KREDI BANKASI	515,884	2.36	1,217,486.24	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	136,771	9.00	1,230,939.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	215,914	16.70	3,605,763.80	
	トルコリラ 小計	2,975,192		33,919,004.09 (529,814,843)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,079	13.60	123,474.40	
	FF GROUP	5,889	4.80	28,267.20	
	OPAP SA	39,461	8.92	352,189.42	
	JUMBO SA	22,412	16.26	364,419.12	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	42,454	12.40	526,429.60	
	ユーロ 小計	119,295		1,394,779.74 (168,098,854)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	83,268	16.72	1,392,240.96	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	775,129	2.12	1,650,249.64	
	INDUSTRIES QATAR	308,520	8.10	2,500,863.12	
	COMMERCIAL BANK PSQC	434,616	3.89	1,694,567.78	
	MASRAF AL RAYAN	681,547	3.87	2,641,676.17	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	144,077	8.50	1,224,654.50	

	QATAR ISLAMIC BANK	222,208	16.00	3,555,328.00	
	QATAR NATIONAL BANK	868,021	18.29	15,876,104.09	
	BARWA REAL ESTATE CO	334,664	2.96	990,605.44	
	OOREDOO QPSC	128,720	6.66	858,047.52	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	112,139	16.17	1,813,287.63	
	カタールリアル 小計	4,092,909		34,197,624.85 (1,000,280,526)	
	合計	1,139,602,201		119,436,374,066 (119,436,374,066)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	621,800	12,380,038.00	
メキシコペソ合計			621,800	12,380,038.00 (58,309,978)	
南アフリカランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	537,442	7,551,060.10	
南アフリカランド合計			537,442	7,551,060.10 (46,439,019)	
合計				104,748,997 (104,748,997)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 61銘柄	100.00%		16.26%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.00%		0.08%
香港ドル	株式 208銘柄	100.00%		23.95%
マレーシアリングット	株式 39銘柄	100.00%		1.75%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.00%		2.23%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.00%		0.82%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.00%		1.49%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.23%		1.71%
	投資証券 1銘柄		2.77%	0.05%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	100.00%		5.18%

チリペソ	株式	16銘柄	100.00%		0.60%
韓国ウォン	株式	108銘柄	100.00%		11.75%
ニュー台湾ドル	株式	89銘柄	100.00%		12.20%
インドルピー	株式	86銘柄	100.00%		7.97%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.00%		0.11%
コロンビアペソ	株式	5銘柄	100.00%		0.19%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.00%		0.24%
アラブディルハム	株式	7銘柄	100.00%		0.52%
ポーランドズロチ	株式	15銘柄	100.00%		0.71%
南アフリカランド	株式	39銘柄	98.95%		3.68%
	投資証券	1銘柄		1.05%	0.04%
オフショア元	株式	471銘柄	100.00%		4.42%
サウジアラビアリアル	株式	34銘柄	100.00%		2.64%
トルコリラ	株式	15銘柄	100.00%		0.44%
ユーロ	株式	5銘柄	100.00%		0.14%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.00%		0.84%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 日本株式インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 2年 6月25日現在 ]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,117,806
株式	2,386,769,410
投資証券	34,902,400
未収配当金	6,567,959
前払金	860,000
差入委託証拠金	1,380,000
流動資産合計	2,452,597,575
資産合計	2,452,597,575
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,211,100
未払金	7,261,074
未払解約金	99,040
未払利息	32
流動負債合計	8,571,246

[ 令和 2年 6月25日現在 ]

負債合計	8,571,246
純資産の部	
元本等	
元本	2,438,117,304
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,909,025
元本等合計	2,444,026,329
純資産合計	2,444,026,329
負債純資産合計	2,452,597,575

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1. 期首	令和 2年 3月 6日
期首元本額	1,394,306,678円
期中追加設定元本額	1,111,241,937円
期中一部解約元本額	67,431,311円
元本の内訳	
MAXIS全世界株式(オール・カントリー)上場投信	177,201,309円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	2,260,693,945円
つみたて全世界株式	222,050円
合計	2,438,117,304円
2. 受益権の総数	2,438,117,304口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 2年 3月 6日 至 令和 2年 6月25日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>( 1 ) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>( 2 ) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>( 3 ) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

種類	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	157,682,562
投資証券	558,240

合計	158,240,802
----	-------------

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[ 令和 2年 6月25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	32,360,000		31,150,000	1,210,000
	合計	32,360,000		31,150,000	1,210,000

(注)時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[ 令和 2年 6月25日現在 ]
1口当たり純資産額	1.0024円
(1万口当たり純資産額)	(10,024円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位：円)

	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1605	国際石油開発帝石	6,900	690.50	4,764,450	
1801	大成建設	1,300	3,790.00	4,927,000	

1802	大林組	4,400	982.00	4,320,800	
1803	清水建設	3,700	858.00	3,174,600	
1812	鹿島建設	3,000	1,211.00	3,633,000	
1878	大東建託	400	10,045.00	4,018,000	
1925	大和ハウス工業	3,800	2,522.50	9,585,500	
1928	積水ハウス	4,200	2,039.50	8,565,900	
1963	日揮ホールディングス	1,500	1,117.00	1,675,500	
2002	日清製粉グループ本社	1,300	1,584.00	2,059,200	
2212	山崎製パン	800	1,817.00	1,453,600	
2229	カルビー	600	2,938.00	1,762,800	
2267	ヤクルト本社	800	6,440.00	5,152,000	
2269	明治ホールディングス	800	8,380.00	6,704,000	
2282	日本ハム	600	4,235.00	2,541,000	
2502	アサヒグループホールディングス	2,600	3,880.00	10,088,000	
2503	キリンホールディングス	5,500	2,301.00	12,655,500	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	800	2,016.00	1,612,800	
2587	サントリー食品インターナショナル	900	4,250.00	3,825,000	
2593	伊藤園	400	6,230.00	2,492,000	
2801	キッコーマン	1,000	5,240.00	5,240,000	
2802	味の素	3,100	1,810.50	5,612,550	
2875	東洋水産	600	5,940.00	3,564,000	
2897	日清食品ホールディングス	400	9,400.00	3,760,000	
2914	日本たばこ産業	8,100	2,099.50	17,005,950	
3401	帝人	1,200	1,715.00	2,058,000	
3402	東レ	9,300	498.70	4,637,910	
3861	王子ホールディングス	5,800	501.00	2,905,800	
3405	クラレ	2,200	1,135.00	2,497,000	
3407	旭化成	8,400	859.50	7,219,800	
4004	昭和電工	900	2,468.00	2,221,200	
4005	住友化学	10,000	320.00	3,200,000	
4021	日産化学	800	5,320.00	4,256,000	
4042	東ソー	1,800	1,430.00	2,574,000	
4063	信越化学工業	2,400	12,280.00	29,472,000	
4088	エア・ウォーター	1,200	1,497.00	1,796,400	
4091	大陽日酸	1,000	1,730.00	1,730,000	
4182	三菱瓦斯化学	1,100	1,597.00	1,756,700	
4183	三井化学	1,200	2,253.00	2,703,600	
4185	J S R	1,400	2,027.00	2,837,800	
4188	三菱ケミカルホールディングス	8,600	621.10	5,341,460	
4202	ダイセル	1,700	817.00	1,388,900	
4204	積水化学工業	2,400	1,522.00	3,652,800	
4452	花王	3,200	8,684.00	27,788,800	
4612	日本ペイントホールディングス	1,000	7,930.00	7,930,000	

4613	関西ペイント	1,200	2,229.00	2,674,800	
4901	富士フイルムホールディングス	2,400	4,651.00	11,162,400	
4911	資生堂	2,700	7,023.00	18,962,100	
4912	ライオン	1,500	2,569.00	3,853,500	
4922	コーセー	200	13,050.00	2,610,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	600	1,872.00	1,123,200	
4967	小林製薬	300	9,820.00	2,946,000	
6988	日東電工	1,100	5,860.00	6,446,000	
8113	ユニ・チャーム	2,700	4,424.00	11,944,800	
4151	協和キリン	1,800	2,839.00	5,110,200	
4502	武田薬品工業	10,600	3,930.00	41,658,000	
4503	アステラス製薬	12,500	1,818.00	22,725,000	
4506	大日本住友製薬	1,200	1,491.00	1,789,200	
4507	塩野義製薬	1,800	6,846.00	12,322,800	
4516	日本新薬	300	8,850.00	2,655,000	
4519	中外製薬	1,500	17,430.00	26,145,000	
4523	エーザイ	1,700	8,631.00	14,672,700	
4528	小野薬品工業	2,500	3,115.00	7,787,500	
4530	久光製薬	300	5,760.00	1,728,000	
4536	参天製薬	2,400	2,016.00	4,838,400	
4568	第一三共	3,800	8,950.00	34,010,000	
4578	大塚ホールディングス	2,600	4,848.00	12,604,800	
4581	大正製薬ホールディングス	200	6,640.00	1,328,000	
4587	ペプチドリーム	600	5,140.00	3,084,000	
5019	出光興産	1,300	2,265.00	2,944,500	
5020	E N E O Sホールディングス	20,700	380.90	7,884,630	
5101	横浜ゴム	800	1,516.00	1,212,800	
5108	ブリヂストン	3,600	3,511.00	12,639,600	
5110	住友ゴム工業	1,200	1,085.00	1,302,000	
5201	A G C	1,300	3,190.00	4,147,000	
5233	太平洋セメント	800	2,414.00	1,931,200	
5332	T O T O	1,000	4,115.00	4,115,000	
5333	日本碍子	1,800	1,454.00	2,617,200	
5334	日本特殊陶業	1,100	1,554.00	1,709,400	
5401	日本製鉄	5,400	1,021.00	5,513,400	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	3,300	773.00	2,550,900	
5463	丸一鋼管	400	2,694.00	1,077,600	
5486	日立金属	1,400	1,307.00	1,829,800	
5711	三菱マテリアル	800	2,252.00	1,801,600	
5713	住友金属鉱山	1,600	2,950.00	4,720,000	
5802	住友電気工業	5,100	1,243.00	6,339,300	
3436	S U M C O	1,800	1,604.00	2,887,200	
5938	L I X I Lグループ	1,800	1,547.00	2,784,600	



5947	リンナイ	200	8,960.00	1,792,000	
6005	三浦工業	600	4,470.00	2,682,000	
6113	アマダ	2,200	884.00	1,944,800	
6146	ディスコ	200	25,800.00	5,160,000	
6268	ナブテスコ	800	3,325.00	2,660,000	
6273	S M C	400	55,710.00	22,284,000	
6301	小松製作所	5,900	2,136.50	12,605,350	
6302	住友重機械工業	700	2,362.00	1,653,400	
6305	日立建機	700	2,913.00	2,039,100	
6326	クボタ	7,000	1,628.50	11,399,500	
6367	ダイキン工業	1,700	16,860.00	28,662,000	
6370	栗田工業	700	3,010.00	2,107,000	
6383	ダイフク	700	9,440.00	6,608,000	
6460	セガサミーホールディングス	1,200	1,296.00	1,555,200	
6465	ホシザキ	300	9,180.00	2,754,000	
6471	日本精工	2,400	794.00	1,905,600	
6473	ジェイテクト	1,400	828.00	1,159,200	
6481	T H K	800	2,674.00	2,139,200	
6586	マキタ	1,500	3,890.00	5,835,000	
7011	三菱重工業	2,200	2,520.50	5,545,100	
6448	ブラザー工業	1,500	1,965.00	2,947,500	
6479	ミネベアミツミ	2,400	1,954.00	4,689,600	
6501	日立製作所	6,500	3,400.00	22,100,000	
6502	東芝	2,600	3,500.00	9,100,000	
6503	三菱電機	12,300	1,377.00	16,937,100	
6504	富士電機	900	2,864.00	2,577,600	
6506	安川電機	1,600	3,710.00	5,936,000	
6594	日本電産	3,000	6,965.00	20,895,000	
6645	オムロン	1,300	7,160.00	9,308,000	
6701	日本電気	1,700	5,170.00	8,789,000	
6702	富士通	1,300	12,570.00	16,341,000	
6723	ルネサスエレクトロニクス	5,200	602.00	3,130,400	
6724	セイコーエプソン	1,900	1,224.00	2,325,600	
6752	パナソニック	14,900	924.80	13,779,520	
6753	シャープ	1,400	1,163.00	1,628,200	
6758	ソニー	8,600	7,555.00	64,973,000	
6762	T D K	900	10,640.00	9,576,000	
6806	ヒロセ電機	200	11,860.00	2,372,000	
6841	横河電機	1,500	1,656.00	2,484,000	
6857	アドバンテスト	1,300	5,980.00	7,774,000	
6861	キーエンス	1,200	44,740.00	53,688,000	
6869	シスメックス	1,100	8,249.00	9,073,900	
6920	レーザーテック	500	10,480.00	5,240,000	

6923	スタンレー電気	900	2,549.00	2,294,100	
6952	カシオ計算機	1,300	1,828.00	2,376,400	
6954	ファナック	1,300	19,370.00	25,181,000	
6963	ローム	600	7,130.00	4,278,000	
6965	浜松ホトニクス	900	4,825.00	4,342,500	
6971	京セラ	2,200	5,989.00	13,175,800	
6981	村田製作所	3,900	6,387.00	24,909,300	
7276	小糸製作所	700	4,300.00	3,010,000	
7751	キヤノン	6,700	2,253.50	15,098,450	
7752	リコー	4,500	795.00	3,577,500	
8035	東京エレクトロン	1,000	25,545.00	25,545,000	
6201	豊田自動織機	1,000	5,810.00	5,810,000	
6902	デンソー	2,900	4,104.00	11,901,600	
7012	川崎重工業	1,000	1,564.00	1,564,000	
7201	日産自動車	15,600	404.90	6,316,440	
7202	いすゞ自動車	3,700	961.80	3,558,660	
7203	トヨタ自動車	14,300	6,795.00	97,168,500	
7205	日野自動車	1,900	718.00	1,364,200	
7211	三菱自動車工業	4,500	277.00	1,246,500	
7259	アイシン精機	1,100	3,150.00	3,465,000	
7261	マツダ	3,800	648.00	2,462,400	
7267	本田技研工業	11,000	2,779.50	30,574,500	
7269	スズキ	2,500	3,733.00	9,332,500	
7270	S U B A R U	4,100	2,295.50	9,411,550	
7272	ヤマハ発動機	1,900	1,681.00	3,193,900	
7282	豊田合成	400	2,245.00	898,000	
7309	シマノ	500	20,520.00	10,260,000	
4543	テルモ	4,300	4,172.00	17,939,600	
7701	島津製作所	1,500	2,852.00	4,278,000	
7731	ニコン	2,000	924.00	1,848,000	
7733	オリンパス	7,800	2,132.50	16,633,500	
7741	H O Y A	2,500	10,540.00	26,350,000	
7747	朝日インテック	1,300	3,070.00	3,991,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	1,300	5,803.00	7,543,900	
7911	凸版印刷	1,800	1,814.00	3,265,200	
7912	大日本印刷	1,600	2,431.00	3,889,600	
7951	ヤマハ	900	5,030.00	4,527,000	
7956	ビジョン	800	4,210.00	3,368,000	
7974	任天堂	800	48,270.00	38,616,000	
9501	東京電力ホールディングス	9,700	334.00	3,239,800	
9502	中部電力	4,300	1,372.00	5,899,600	
9503	関西電力	4,700	1,015.50	4,772,850	
9504	中国電力	2,000	1,441.00	2,882,000	

9506	東北電力	2,900	1,009.00	2,926,100	
9508	九州電力	2,600	878.00	2,282,800	
9513	電源開発	900	2,035.00	1,831,500	
9531	東京瓦斯	2,500	2,508.50	6,271,250	
9532	大阪瓦斯	2,500	2,109.00	5,272,500	
9533	東邦瓦斯	500	5,380.00	2,690,000	
9001	東武鉄道	1,300	3,690.00	4,797,000	
9005	東急	3,400	1,533.00	5,212,200	
9006	京浜急行電鉄	1,500	1,703.00	2,554,500	
9007	小田急電鉄	2,000	2,701.00	5,402,000	
9008	京王電鉄	700	6,280.00	4,396,000	
9009	京成電鉄	900	3,400.00	3,060,000	
9020	東日本旅客鉄道	2,000	7,600.00	15,200,000	
9021	西日本旅客鉄道	1,100	6,119.00	6,730,900	
9022	東海旅客鉄道	1,000	16,860.00	16,860,000	
9024	西武ホールディングス	1,500	1,221.00	1,831,500	
9041	近鉄グループホールディングス	1,200	4,890.00	5,868,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	1,500	3,635.00	5,452,500	
9045	京阪ホールディングス	600	4,810.00	2,886,000	
9048	名古屋鉄道	1,300	3,050.00	3,965,000	
9062	日本通運	500	5,480.00	2,740,000	
9064	ヤマトホールディングス	2,100	2,345.00	4,924,500	
9142	九州旅客鉄道	1,000	2,867.00	2,867,000	
9143	S Gホールディングス	1,100	3,560.00	3,916,000	
9101	日本郵船	1,000	1,500.00	1,500,000	
9201	日本航空	800	1,975.50	1,580,400	
9202	A N Aホールディングス	800	2,475.00	1,980,000	
9364	上組	700	2,074.00	1,451,800	
3626	T I S	1,500	2,265.00	3,397,500	
3659	ネクソン	3,300	2,560.00	8,448,000	
3769	G M Oペイメントゲートウェイ	300	11,780.00	3,534,000	
3938	L I N E	400	5,390.00	2,156,000	
4307	野村総合研究所	2,200	2,930.00	6,446,000	
4385	メルカリ	600	3,295.00	1,977,000	
4684	オービック	500	19,310.00	9,655,000	
4689	Zホールディングス	17,900	540.00	9,666,000	
4704	トレンドマイクロ	900	5,940.00	5,346,000	
4716	日本オラクル	300	12,260.00	3,678,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	600	4,110.00	2,466,000	
4768	大塚商会	700	5,600.00	3,920,000	
9432	日本電信電話	8,700	2,491.00	21,671,700	
9433	K D D I	11,100	3,170.00	35,187,000	
9434	ソフトバンク	12,900	1,382.50	17,834,250	

9435	光通信	100	24,440.00	2,444,000	
9437	NTTドコモ	7,900	2,899.50	22,906,050	
9602	東宝	800	3,840.00	3,072,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	4,300	1,210.00	5,203,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	600	5,450.00	3,270,000	
9719	SCSK	400	5,260.00	2,104,000	
9766	コナミホールディングス	600	3,540.00	2,124,000	
9984	ソフトバンクグループ	10,600	5,370.00	56,922,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	1,300	2,194.00	2,852,200	
3038	神戸物産	400	6,180.00	2,472,000	
7459	メディカルホールディングス	1,200	2,039.00	2,446,800	
8001	伊藤忠商事	9,100	2,296.00	20,893,600	
8002	丸紅	11,100	489.60	5,434,560	
8015	豊田通商	1,400	2,691.00	3,767,400	
8031	三井物産	11,200	1,591.50	17,824,800	
8053	住友商事	8,000	1,235.50	9,884,000	
8058	三菱商事	9,100	2,263.50	20,597,850	
9962	ミスミグループ本社	1,900	2,750.00	5,225,000	
9987	スズケン	500	3,915.00	1,957,500	
2651	ローソン	300	5,530.00	1,659,000	
2670	エービーシー・マート	200	6,410.00	1,282,000	
2702	日本マクドナルドホールディングス	400	6,160.00	2,464,000	
3064	MonotaRO	800	4,370.00	3,496,000	
3092	ZOZO	700	2,411.00	1,687,700	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	2,300	658.00	1,513,400	
3141	ウエルシアホールディングス	300	8,840.00	2,652,000	
3349	コスモス薬品	100	16,710.00	1,671,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	5,100	3,482.00	17,758,200	
3391	ツルハホールディングス	200	14,880.00	2,976,000	
7453	良品計画	1,600	1,550.00	2,480,000	
7532	バン・パシフィック・インターナショナルホ	2,800	2,390.00	6,692,000	
8028	ファミリーマート	1,700	1,841.00	3,129,700	
8227	しまむら	100	7,680.00	768,000	
8252	丸井グループ	1,300	2,020.00	2,626,000	
8267	イオン	4,400	2,458.50	10,817,400	
9831	ヤマダ電機	4,900	530.00	2,597,000	
9843	ニトリホールディングス	500	20,715.00	10,357,500	
9983	ファーストリテイリング	400	62,090.00	24,836,000	
9989	サンドラッグ	500	3,510.00	1,755,000	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	6,400	246.00	1,574,400	
7182	ゆうちょ銀行	2,700	840.00	2,268,000	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	7,100	349.00	2,477,900	

8303	新生銀行	1,000	1,310.00	1,310,000	
8304	あおぞら銀行	800	1,919.00	1,535,200	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	82,300	426.70	35,117,410	
8308	りそなホールディングス	14,100	368.10	5,190,210	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	2,300	2,964.00	6,817,200	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	8,800	3,022.00	26,593,600	
8331	千葉銀行	3,600	514.00	1,850,400	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	1,200	1,713.00	2,055,600	
8355	静岡銀行	2,900	690.00	2,001,000	
8369	京都銀行	400	3,800.00	1,520,000	
8410	セブン銀行	4,000	296.00	1,184,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	162,500	131.80	21,417,500	
8473	SBIホールディングス	1,600	2,276.00	3,641,600	
8601	大和証券グループ本社	9,700	448.30	4,348,510	
8604	野村ホールディングス	21,200	475.50	10,080,600	
7181	かんぽ生命保険	1,500	1,393.00	2,089,500	
8630	SOMPOホールディングス	2,300	3,654.00	8,404,200	
8725	MS&ADインシュアランスグループ ホール	3,000	2,998.00	8,994,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディング ス	1,000	2,593.00	2,593,000	
8750	第一生命ホールディングス	7,300	1,313.00	9,584,900	
8766	東京海上ホールディングス	4,300	4,660.00	20,038,000	
8795	T&Dホールディングス	3,600	946.00	3,405,600	
8439	東京センチュリー	300	5,370.00	1,611,000	
8572	アコム	1,900	421.00	799,900	
8591	オリックス	8,900	1,355.00	12,059,500	
8593	三菱UFJリース	2,700	514.00	1,387,800	
8697	日本取引所グループ	3,400	2,437.00	8,285,800	
3003	ヒューリック	2,000	1,004.00	2,008,000	
3231	野村不動産ホールディングス	800	1,930.00	1,544,000	
3289	東急不動産ホールディングス	4,100	500.00	2,050,000	
3291	飯田グループホールディングス	1,000	1,684.00	1,684,000	
4666	パーク24	700	1,770.00	1,239,000	
8801	三井不動産	6,300	1,903.50	11,992,050	
8802	三菱地所	8,000	1,584.00	12,672,000	
8830	住友不動産	2,100	2,884.00	6,056,400	
8905	イオンモール	700	1,402.00	981,400	
9706	日本空港ビルデング	300	4,750.00	1,425,000	
2127	日本M&Aセンター	1,000	4,895.00	4,895,000	
2181	パーソルホールディングス	1,200	1,476.00	1,771,200	
2331	総合警備保障	500	4,920.00	2,460,000	
2371	カカクコム	900	2,730.00	2,457,000	
2413	エムスリー	3,000	4,585.00	13,755,000	

2433	博報堂DYホールディングス	1,600	1,246.00	1,993,600	
4324	電通グループ	1,500	2,550.00	3,825,000	
4661	オリエンタルランド	1,300	14,510.00	18,863,000	
4732	ユー・エス・エス	1,500	1,738.00	2,607,000	
4751	サイバーエージェント	700	5,360.00	3,752,000	
4755	楽天	5,800	998.00	5,788,400	
6098	リクルートホールディングス	8,600	3,694.00	31,768,400	
6178	日本郵政	10,600	764.50	8,103,700	
9735	セコム	1,400	9,343.00	13,080,200	
9783	ベネッセホールディングス	500	2,890.00	1,445,000	
	合計	1,131,500		2,386,769,410	

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	GLP投資法人	25	3,635,000	
	日本プロロジスリート投資法人	14	4,389,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	29	3,723,600	
	日本ビルファンド投資法人	9	5,805,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	9	4,959,000	
	日本リテールファンド投資法人	18	2,458,800	
	オリックス不動産投資法人	18	2,620,800	
	日本プライムリアルティ投資法人	5	1,617,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	20	2,354,000	
	大和ハウスリート投資法人	13	3,339,700	
	合計	160	34,902,400	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【つみたて全世界株式】

## 【純資産額計算書】

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	3,195,269
負債総額	93
純資産総額（ - ）	3,195,176
発行済口数	3,271,421口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9767
（10,000口当たり）	（9,767）

（参考）

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	476,214,098,585
負債総額	3,718,388,351
純資産総額（ - ）	472,495,710,234
発行済口数	165,513,521,550口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.8547
（10,000口当たり）	（28,547）

## 新興国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	123,905,628,121
負債総額	393,692,482
純資産総額（ - ）	123,511,935,639
発行済口数	52,964,490,441口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.3320
（10,000口当たり）	（23,320）

## 日本株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

(単位:円)

資産総額	2,503,838,104
負債総額	50,878,245
純資産総額( - )	2,452,959,859
発行済口数	2,448,949,152口
1口当たり純資産価額( / )	1.0016
(10,000口当たり)	(10,016)



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額等

2020年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### ・ 会社の意思決定機構

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

###### ・ 投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

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

###### 投資行動のモニタリング2

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

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2020年6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	872	13,948,829
追加型公社債投資信託	16	1,318,010
単位型株式投資信託	64	334,950
単位型公社債投資信託	20	101,305
合計	972	15,703,095

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

## 3【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

### (1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

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

### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
(資産の部)		

<b>流動資産</b>				
現金及び預金	2	53,969,686	2	56,398,457
有価証券		1,403,513		1,960,318
前払費用		514,587		575,904
未収入金		2,284		14,559
未収委託者報酬		9,995,458		10,296,453
未収収益	2	560,483	2	638,994
金銭の信託	2	100,000	2	100,000
その他		153,256		254,330
流動資産合計		66,699,271		70,239,017
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	617,032	1	584,048
器具備品	1	665,247	1	871,893
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		1,910,713		2,084,375
<b>無形固定資産</b>				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,670,753		3,369,611
ソフトウェア仮勘定		536,345		1,374,932
無形固定資産合計		4,222,921		4,760,365
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		21,408,781		16,704,756
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	824,268	1	819,255
長期差入保証金		593,536		565,358
前払年金費用		415,234		375,031
繰延税金資産		1,496,180		1,912,824
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		25,079,767		20,718,993
固定資産合計		31,213,401		27,563,734
資産合計		97,912,673		97,802,752

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
<b>(負債の部)</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	293,258	687,565
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	170,281	131,478
未払償還金	448,695	395,400
未払手数料	2	4,026,078
その他未払金	2	3,818,195
未払費用	2	4,402,578
未払消費税等	194,852	629,469
未払法人税等	573,657	617,341
賞与引当金	901,135	933,517

役員賞与引当金	140,100	124,590
その他	868,992	701,285
流動負債合計	15,346,788	16,467,499
固定負債		
長期未払金	43,200	32,400
退職給付引当金	860,851	1,010,401
役員退職慰労引当金	144,303	130,784
時効後支払損引当金	247,767	238,811
固定負債合計	1,296,122	1,412,398
負債合計	16,642,910	17,879,897
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	26,069,594	25,847,605
利益剰余金合計	33,410,184	33,188,194
株主資本合計	80,143,028	79,921,039

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,126,733	1,815
評価・換算差額等合計	1,126,733	1,815
純資産合計	81,269,762	79,922,854
負債純資産合計	97,912,673	97,802,752

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,375,414	67,967,489
投資顧問料	2,505,299	2,385,084
その他営業収益	18,844	16,085
営業収益合計	72,899,557	70,368,658
営業費用		

支払手数料	2	28,533,952	2	27,106,451
広告宣伝費		739,643		696,418
公告費		500		1,000
調査費				
調査費		1,794,755		1,857,271
委託調査費		12,194,996		11,579,175
事務委託費		1,016,816		847,769
営業雑経費				
通信費		170,794		153,731
印刷費		427,442		427,118
協会費		48,375		52,053
諸会費		16,175		15,990
事務機器関連費		1,841,631		1,953,926
営業費用合計		46,785,083		44,690,907
一般管理費				
給料				
役員報酬		349,083		331,987
給料・手当		6,453,717		6,611,427
賞与引当金繰入		901,135		933,517
役員賞与引当金繰入		140,100		124,590
福利厚生費		1,234,293		1,276,950
交際費		13,011		11,871
旅費交通費		200,426		165,891
租税公課		373,201		360,165
不動産賃借料		654,886		647,402
退職給付費用		428,912		422,919
役員退職慰労引当金繰入		51,159		48,183
固定資産減価償却費		1,252,321		1,307,555
諸経費		523,213		427,212
一般管理費合計		12,575,461		12,669,674
営業利益		13,539,012		13,008,076

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	181,073	90,965
受取利息	2 1,913	2 4,169
投資有価証券償還益	416,706	585,179
収益分配金等時効完成分	44,392	101,734
受取賃貸料	2 38,388	2 65,808
その他	11,871	19,987
営業外収益合計	694,346	867,845
営業外費用		
投資有価証券償還損	118,173	96,379
時効後支払損引当金繰入	1,166	
事務過誤費	420	3,483
賃貸関連費用	35,994	20,339
その他	1,481	1,920
営業外費用合計	157,235	122,122

経常利益		14,076,123		13,753,799
特別利益				
投資有価証券売却益		501,778		174,842
特別利益合計		501,778		174,842
特別損失				
投資有価証券売却損		135,399		75,963
投資有価証券評価損		62,310		163,865
固定資産除却損	1	4,848	1	8,832
固定資産売却損		225		435
システム関連費		322,986		
商標使用料		90,000		
特別損失合計		615,770		249,096
税引前当期純利益		13,962,130		13,679,545
法人税、住民税及び事業税	2	4,420,179	2	4,146,534
法人税等調整額		100,112		79,824
法人税等合計		4,320,066		4,226,359
当期純利益		9,642,064		9,453,186

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	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	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344
当期変動額									
剰余金の配当							11,363,380	11,363,380	11,363,380
当期純利益							9,642,064	9,642,064	9,642,064
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計							1,721,316	1,721,316	1,721,316
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
当期純利益			9,642,064
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	358,179	358,179	358,179
当期変動額合計	358,179	358,179	2,079,495
当期末残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762

第35期（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）

(単位：千円)

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

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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～47年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (4)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

#### (5)役員退職慰労引当金

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

#### (6)時効後支払損引当金

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

### 5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### (1)消費税等の会計処理

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

#### (2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

#### (3)「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

#### （未適用の会計基準等）

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

#### (1)概要

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

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

#### (2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

#### (3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価



中であります。

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

#### (1)概要

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

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一した算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

#### (2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

#### (3)当該会計基準等の適用による影響

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

#### (貸借対照表関係)

##### 1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
建物	551,025千円	599,542千円
器具備品	1,350,407千円	1,408,613千円
投資不動産	138,024千円	145,391千円

##### 2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
預金	240,211千円	314,247千円
未収収益	25,307千円	15,773千円
金銭の信託	100,000千円	100,000千円
未払手数料	671,568千円	712,210千円
その他未払金	3,217,341千円	3,029,426千円
未払費用	444,754千円	432,019千円

#### (損益計算書関係)

##### 1.固定資産除却損の内訳

	第34期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
建物	2,547千円	
器具備品	2,301千円	8,832千円
計	4,848千円	8,832千円

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
支払手数料	5,298,064千円	5,234,629千円
受取利息	3千円	2千円
受取賃貸料	38,388千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,216,517千円	3,030,180千円

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	11,363,380千円
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28日

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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和 元年6月27日

第35期(自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
1年内	675,956千円	675,956千円
1年超	675,956千円	
合計	1,351,912千円	675,956千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第34期(平成31年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	53,969,686	53,969,686	-
(2) 有価証券	1,403,513	1,403,513	-
(3) 未収委託者報酬	9,995,458	9,995,458	-
(4) 投資有価証券	21,353,421	21,353,421	-
資産計	86,722,080	86,722,080	-
(1) 未払手数料	3,990,054	3,990,054	-
負債計	3,990,054	3,990,054	-

第35期(令和2年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(4) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,328,625	85,328,625	-
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-

負債計	4,026,078	4,026,078	-
-----	-----------	-----------	---

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

## (2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
非上場株式	55,360	31,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第34期(平成31年3月31日現在)

(単位：千円)

	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	53,969,686	-	-	-
未収委託者報酬	9,995,458	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,403,513	9,358,708	5,874,634	90,573
合計	65,368,659	9,358,708	5,874,634	90,573

第35期(令和2年3月31日現在)

(単位：千円)

	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	56,398,457	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,655,228	5,652,257	4,813,929	27,375

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第34期(平成31年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計 上額が取得原 価を超えるも の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	14,744,545	12,559,380	2,185,164
	小計	14,744,545	12,559,380	2,185,164
貸借対照表計 上額が取得原 価を超えない もの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,012,389	8,573,551	561,161
	小計	8,012,389	8,573,551	561,161
合計		22,756,935	21,132,932	1,624,002

第35期(令和2年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計 上額が取得原 価を超えるも の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
貸借対照表計 上額が取得原 価を超えない もの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,774,369	9,937,087	1,162,718
	小計	8,774,369	9,937,087	1,162,718
合計		18,633,714	18,631,098	2,616

## 3. 売却したその他有価証券

第34期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	140,240	58,440	-
債券	-	-	-
その他	5,222,594	443,338	135,399
合計	5,362,834	501,778	135,399

第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について62,310千円（その他有価証券のその他62,310千円）減損処理を行っております。

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

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,729,252 千円	3,712,289 千円
勤務費用	193,531	204,225
利息費用	24,351	17,557
数理計算上の差異の発生額	15,898	52,430
退職給付の支払額	218,947	162,904
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,712,289	3,718,736

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
年金資産の期首残高	2,723,393 千円	2,666,937 千円
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の発生額	4,606	164,633
事業主からの拠出額	102,564	51,282
退職給付の支払額	203,077	140,518
年金資産の期末残高	2,666,937	2,460,824

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,125,760 千円	2,969,807 千円
年金資産	2,666,937	2,460,824
	458,822	508,982
非積立型制度の退職給付債務	586,529	748,929
未積立退職給付債務	1,045,351	1,257,911
未認識数理計算上の差異	114,968	203,136
未認識過去勤務費用	484,766	419,405
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370
退職給付引当金	860,851	1,010,401
前払年金費用	415,234	375,031
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
勤務費用	193,531 千円	204,225 千円
利息費用	24,351	17,557

期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の費用処理額	43,633	24,035
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	5,986	6,427
確定給付制度に係る退職給付費用	284,199	269,848

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額です。

#### (5)年金資産に関する事項

##### 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
債券	63.9 %	64.7 %
株式	33.2	32.3
その他	2.9	3.0
合計	100	100

##### 長期期待運用収益率の設定方法

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

#### (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

##### 主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
割引率	0.035 ~ 0.49%	0.095 ~ 0.52%
長期期待運用収益率	1.5 ~ 1.8%	1.5 ~ 1.8%

#### 3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

#### (税効果会計関係)

##### 1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	436,050千円	427,046千円
投資有価証券評価損	223,821	226,322
未払事業税	109,109	117,461
賞与引当金	275,927	285,842
役員賞与引当金	19,428	19,703
役員退職慰労引当金	44,185	40,046
退職給付引当金	263,592	309,384
減価償却超過額	157,741	96,767
委託者報酬	264,398	213,044
長期差入保証金	31,721	40,180
時効後支払損引当金	75,866	73,124
連結納税適用による時価評価	148,858	57,656
その他	71,320	123,248
繰延税金資産 小計	2,122,023	2,029,829
評価性引当額	-	-

繰延税金資産 合計	2,122,023	2,029,829
繰延税金負債		
前払年金費用	127,144	114,834
連結納税適用による時価評価	1,320	1,260
その他有価証券評価差額金	497,269	801
その他	108	109
繰延税金負債 合計	625,842	117,005
繰延税金資産の純額	1,496,180	1,912,824

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳  
第34期(平成31年3月31日現在)及び第35期(令和2年3月31日現在)

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第34期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)及び第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第34期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)及び第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第34期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注4)	科目	期末残高(注4)



親会社	(株)三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,216,517 千円	その他未払金	3,217,341 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,298,064 千円	未払手数料	671,568 千円
						投資の助言  役員の兼任	投資助言料 (注3)	695,834 千円	未払費用	365,510 千円

## 第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

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

3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

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

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

## 第34期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし (注1)	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,629,670 千円	未払手数料	734,633 千円
						取引銀行	コーラブル預 金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び 預金	20,000,000 千円
							コーラブル預 金に係る受取 利息 (注3)	1,578 千円	未収収益	1,578 千円

同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円
-------------	--------------------------	---------	---------------	-----	----	-------------------------------	-----------------------	-----------------	-------	---------------

## 第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注4)	科目	期末残高(注4)
同一の親会社を持つ会社	株三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等  取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注2)	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
							コーラブル預金の払戻(注3)	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入(注3)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息(注3)	4,126 千円	未収収益	997 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注2)	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. (株)三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを(株)三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、(株)三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。  
なお、(株)三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行(株)に対して承継させております。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

(1株当たり情報)

	第34期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
1株当たり純資産額	384,107.08円	377,741.17円
1株当たり当期純利益金額	45,571.50円	44,678.80円

(注)1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	9,642,064	9,453,186
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	9,642,064	9,453,186
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581	211,581

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

#### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2020年3月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社北海道銀行	93,524 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社宮崎銀行	14,697 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 3【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(2019年11月末現在)

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

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

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(2020年6月末現在)

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

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

## 独立監査人の監査報告書

令和2年7月29日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたて全世界株式の令和2年3月6日から令和2年6月25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、つみたて全世界株式の令和2年6月25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、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

令和2年6月26日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 青 木 裕 晃 印  
行社員指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 伊 藤 鉄 也 印  
行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成31年4月1日から令和2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、三菱UFJ国際投信株式会社の令和2年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

---

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。