

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年6月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCマイセレクション25
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCマイセレクション25

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。  
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。  
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2019年 6月29日から2019年12月27日までとします。

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

**（ 8 ） 【 申込取扱場所 】**

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 10 ） 【 払込取扱場所 】**

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

**（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（ 12 ） 【 その他 】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同

じ。 ) における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、国内株式、国内債券、外国株式及び外国債券に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グロ ー バ ル  (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド  ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり ( )  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ・ ショ ー ト型/ 絶対収益追求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	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)				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、短期 金融資産)資産 配分固定型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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



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

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

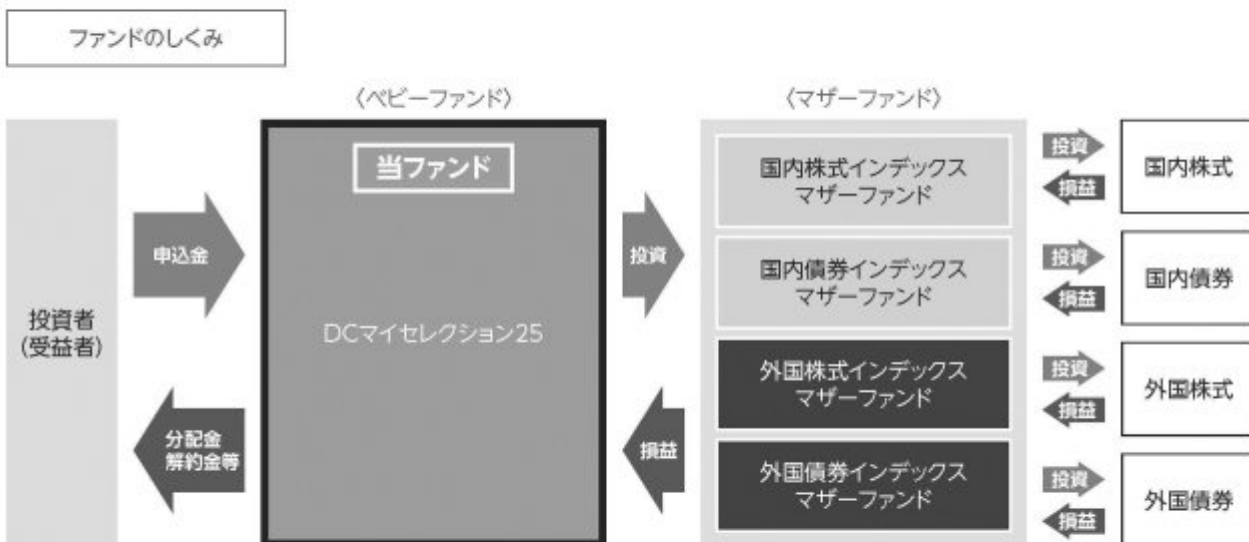
る旨の記載があるものをいう。

- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

#### <ファンドの特色>

## 1. 日本を含む世界の公社債や株式にバランスよく投資を行い、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 原則として、為替ヘッジは行いません。



### ? ファミリーファンド方式とは

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

## 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX (東証株価指数) <sup>1</sup>
国内債券	NOMURA-BPI 総合 <sup>2</sup>
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス (円ベース) <sup>3</sup>
外国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) <sup>4</sup>

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

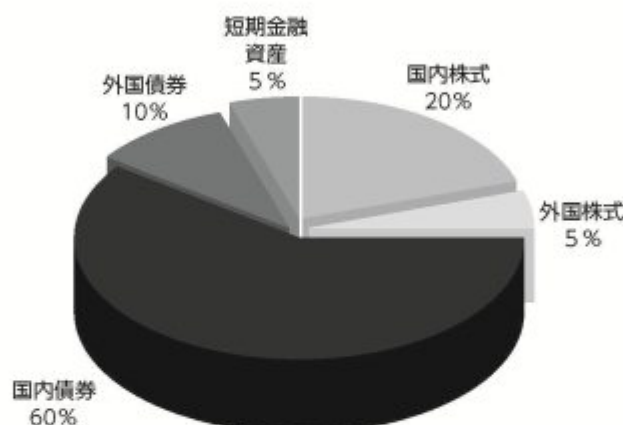
各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

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

### 3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式20%、外国株式5%、国内債券60%、外国債券10%、短期金融資産5%を基準ポートフォリオとして運用します。

- 資産ごとの投資比率は、原則として、基準ポートフォリオから±5%の範囲内にコントロールします。
- 基準ポートフォリオは、投資環境等の変化に応じて、年1回程度見直しを行うことがあります。

基準ポートフォリオ



#### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基準ポートフォリオに基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

- 基準ポートフォリオに従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

- 資産配分比率が基準ポートフォリオから一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

**分配方針**

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
  - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

**主な投資制限**

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の25%以下とします。

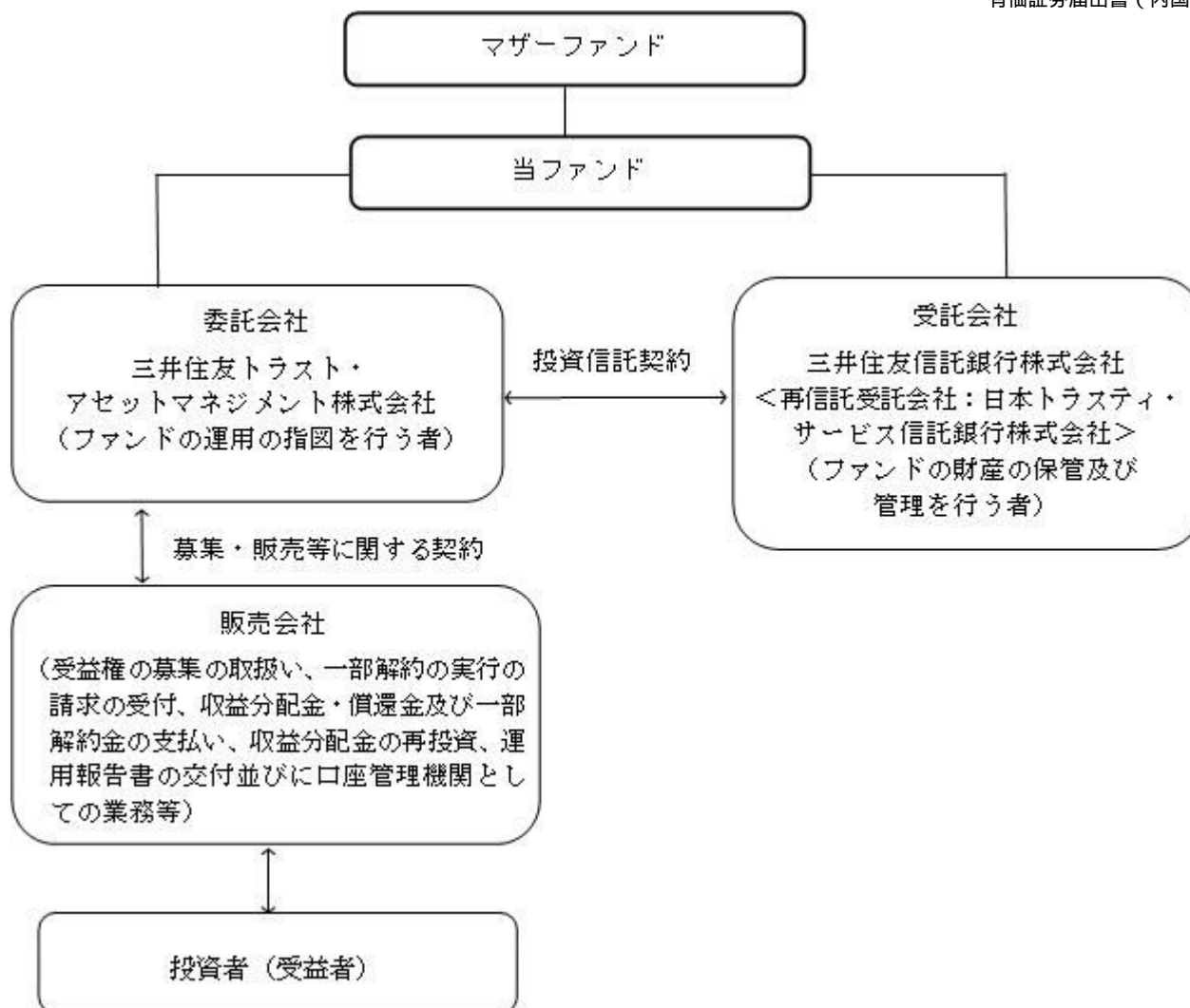
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

**(2)【ファンドの沿革】**

2001年10月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月1日	本ファンドの名称を「すみしん DCマイセレクション25」から「DCマイセレクション25」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

**(3)【ファンドの仕組み】**

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年 4月26日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### （イ）基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

### （ロ）運用方法

#### 投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」および「外国債券インデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2)基準ポートフォリオは、国内株式20%、国内債券60%、外国株式5%、外国債券10%および短期金融資産5%の比率で基準配分します。
- 3)各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- 4)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- 5)投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6)投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 7)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

## （２）【投資対象】

（イ）本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

## 二．約束手形

## 2.次に掲げる特定資産以外の資産

## イ．為替手形

(ロ) 委託会社は、信託金を主として次に掲げる第1号から第4号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第5号から第26号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内株式インデックス マザーファンド
2. 国内債券インデックス マザーファンド
3. 外国株式インデックス マザーファンド
4. 外国債券インデックス マザーファンド
5. 株券または新株引受権証書
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
17. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
18. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するもの、および第18号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

###### (1)投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。

このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

##### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総



額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純

資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。

このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

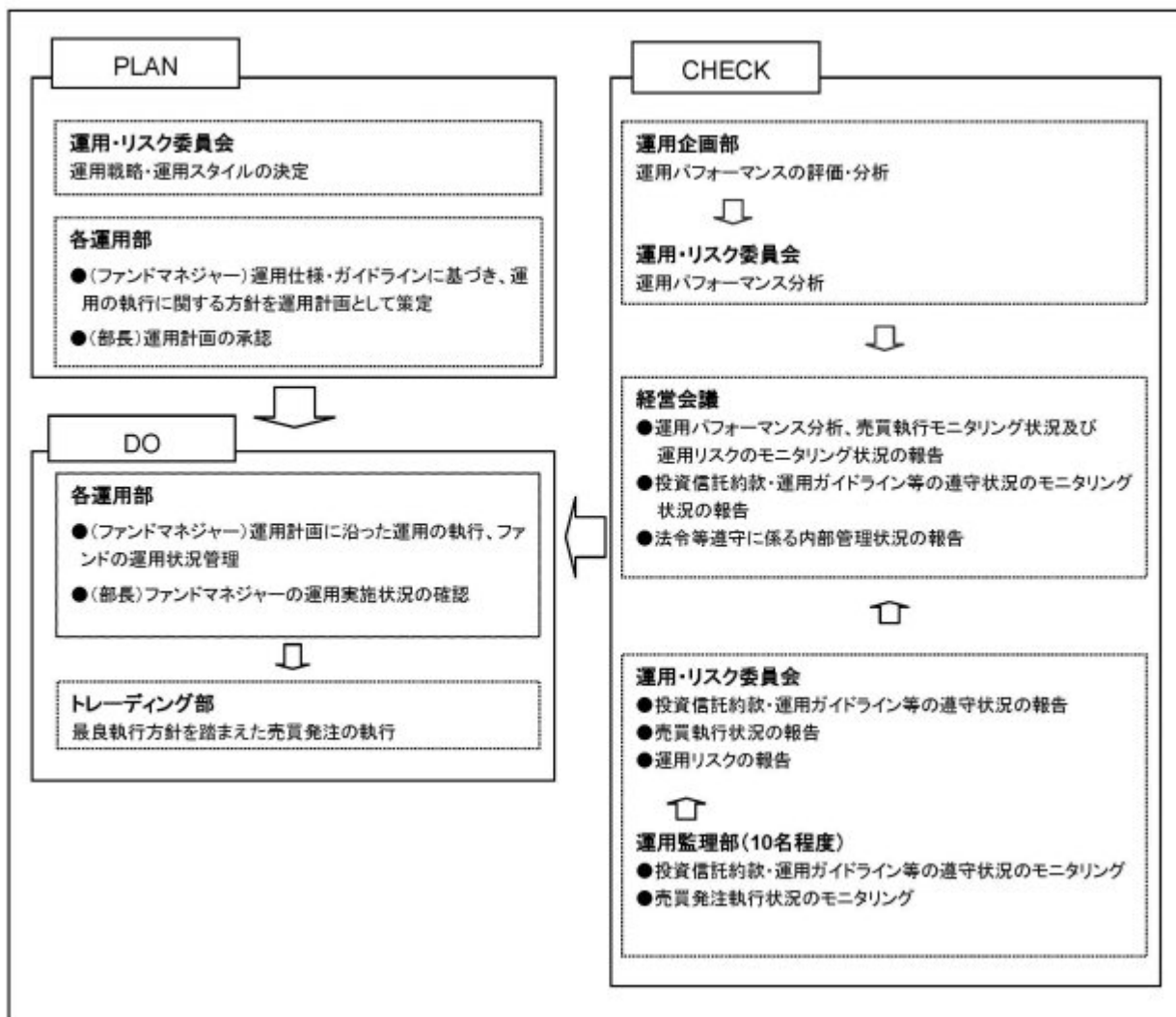
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

#### (3) 【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 分配については、委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### < 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の25%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しに

より行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財

産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第26条）

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第27条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第28条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第31条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第39条）

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

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

前記 から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (イ) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事



態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

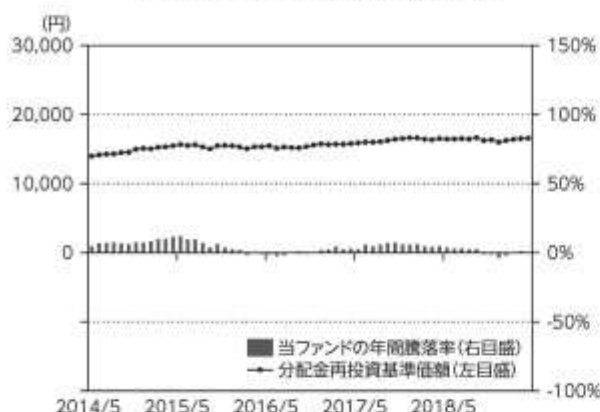
#### (口) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

### 当ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



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

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

### 当ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



\*2014年5月～2019年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)\*1

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)\*2

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)\*3

日本国債… NOMURA-BPI国債\*4

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)\*5

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)\*6

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

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

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

※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、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。

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

ありません。

### (2) 【換金（解約）手数料】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.2808%（\*）（税抜 0.26%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1404% （税抜 0.13%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.108% （税抜 0.1%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.0324% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

\* 消費税率が10%になった場合は、0.286%となります。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.143% （税抜 0.13%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.11% （税抜 0.1%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2019年 4月26日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### 5【運用状況】

以下は、2019年4月26日現在の状況について記載してあります。

#### 【DCマイセレクション25】

##### （１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	45,283,362,423	95.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,234,015,723	4.70
合計(純資産総額)		47,517,378,146	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	19,856,318,298	1.3806	27,414,201,241	1.4132	28,060,949,018	59.05
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	6,645,167,969	1.5929	10,585,626,333	1.4879	9,887,345,421	20.81
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,633,632,818	2.7545	4,499,852,581	2.7615	4,511,277,026	9.49
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,065,059,012	2.6442	2,816,233,061	2.6513	2,823,790,958	5.94

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.30
合計	95.30

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第8期計算期間末	(2009年 9月30日)	11,547,455,341	11,547,455,341	11,386	11,386
第9期計算期間末	(2010年 9月30日)	12,646,942,774	12,646,942,774	11,424	11,424
第10期計算期間末	(2011年 9月30日)	15,059,779,253	15,059,779,253	11,199	11,199
第11期計算期間末	(2012年10月 1日)	18,760,389,848	18,760,389,848	11,515	11,515
第12期計算期間末	(2013年 9月30日)	22,915,591,315	22,915,591,315	13,574	13,574
第13期計算期間末	(2014年 9月30日)	27,361,873,335	27,361,873,335	14,469	14,469
第14期計算期間末	(2015年 9月30日)	30,481,047,032	30,481,047,032	15,019	15,019
第15期計算期間末	(2016年 9月30日)	33,555,285,756	33,555,285,756	15,159	15,159
第16期計算期間末	(2017年10月 2日)	38,809,433,024	38,809,433,024	16,209	16,209

第17期計算期間末	(2018年10月 1日)	45,795,333,892	45,795,333,892	16,626	16,626
	2018年 4月末日	43,986,330,929		16,496	
	5月末日	44,175,849,823		16,424	
	6月末日	44,302,983,975		16,427	
	7月末日	45,041,774,965		16,496	
	8月末日	45,041,176,778		16,425	
	9月末日	45,779,859,240		16,626	
	10月末日	44,965,433,028		16,218	
	11月末日	45,530,068,054		16,331	
	12月末日	45,273,416,802		15,988	
	2019年 1月末日	46,224,927,138		16,226	
	2月末日	46,970,378,772		16,404	
	3月末日	47,453,175,954		16,498	
	4月末日	47,517,378,146		16,557	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第8期計算期間	2008年10月 1日～2009年 9月30日	0
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	0
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	0
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	0
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第8期計算期間	2008年10月 1日～2009年 9月30日	1.4
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	0.3
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	2.0
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	2.8
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	17.9
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	6.6
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3.8
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0.9
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	6.9

第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	2.6
第18期中間計算期間	2018年10月 2日～2019年 4月 1日	0.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第8期計算期間	2008年10月 1日～2009年 9月30日	1,779,813,085	858,869,963	10,141,881,630
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	1,735,481,576	807,208,250	11,070,154,956
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	3,346,014,906	968,606,685	13,447,563,177
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	3,864,486,771	1,020,101,320	16,291,948,628
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	2,886,146,198	2,295,802,968	16,882,291,858
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	3,563,330,174	1,535,389,837	18,910,232,195
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3,679,811,287	2,295,568,761	20,294,474,721
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	3,463,560,259	1,622,856,126	22,135,178,854
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	3,956,589,861	2,148,272,884	23,943,495,831
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	5,895,612,544	2,295,315,456	27,543,792,919
第18期中間計算期間	2018年10月 2日～2019年 4月 1日	2,214,836,324	993,250,370	28,765,378,873

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

(参考)

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	275,339,881,820	98.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,410,369,706	1.93
合計(純資産総額)		280,750,251,526	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,474,850,000	1.95

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,321,300	6,882.53	9,093,886,889	6,905.00	9,123,576,500	3.25
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	486,200	8,021.26	3,899,936,612	11,555.00	5,618,041,000	2.00
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,050,300	661.42	5,324,629,426	549.90	4,426,859,970	1.58
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,035,200	4,474.01	4,631,495,152	4,112.00	4,256,742,400	1.52
日本	株式	ソニー	電気機器	795,500	5,352.85	4,258,192,175	5,212.00	4,146,146,000	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	58,200	63,250.75	3,681,193,650	69,120.00	4,022,784,000	1.43
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	795,800	5,003.19	3,981,538,602	4,616.00	3,673,412,800	1.31
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	824,200	4,403.90	3,629,694,380	4,021.00	3,314,108,200	1.18
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,000,200	3,394.49	3,395,168,898	3,101.00	3,101,620,200	1.10
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	15,890,900	190.01	3,019,429,909	173.50	2,757,071,150	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	811,700	2,987.43	2,424,896,931	3,329.00	2,702,149,300	0.96
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,025,400	2,888.30	2,961,662,820	2,540.50	2,605,028,700	0.93
日本	株式	任天堂	その他製品	67,800	39,624.85	2,686,564,830	38,000.00	2,576,400,000	0.92
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	106,200	22,574.16	2,397,375,792	23,895.00	2,537,649,000	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	819,500	3,069.20	2,515,209,400	3,056.00	2,504,392,000	0.89
日本	株式	花王	化学	287,900	8,281.22	2,384,163,238	8,557.00	2,463,560,300	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	418,100	5,283.70	2,209,114,970	5,602.00	2,342,196,200	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	112,700	22,073.74	2,487,710,498	20,775.00	2,341,342,500	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	161,900	12,677.71	2,052,521,249	14,100.00	2,282,790,000	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	142,700	16,052.19	2,290,647,513	15,785.00	2,252,519,500	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	373,200	5,370.63	2,004,319,116	5,960.00	2,224,272,000	0.79
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	210,800	10,474.84	2,208,096,272	10,465.00	2,206,022,000	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	204,600	10,412.64	2,130,426,144	10,430.00	2,133,978,000	0.76
日本	株式	資生堂	化学	235,600	7,901.84	1,861,673,504	8,718.00	2,053,960,800	0.73
日本	株式	キヤノン	電気機器	638,300	3,592.21	2,292,907,643	3,089.00	1,971,708,700	0.70
日本	株式	日立製作所	電気機器	533,800	3,841.79	2,050,747,502	3,689.00	1,969,188,200	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	489,500	4,847.23	2,372,719,085	3,859.00	1,888,980,500	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,185,800	1,507.73	1,787,866,234	1,582.00	1,875,935,600	0.67
日本	株式	HOYA	精密機器	238,700	6,414.22	1,531,074,314	7,815.00	1,865,440,500	0.66
日本	株式	第一三共	医薬品	339,300	3,758.87	1,275,384,591	5,481.00	1,859,703,300	0.66



(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.28
		建設業	2.81
		食料品	4.09
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.29
		化学	7.35
		医薬品	5.43
		石油・石炭製品	0.61
		ゴム製品	0.77
		ガラス・土石製品	0.87
		鉄鋼	0.95
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.55
		機械	5.14
		電気機器	13.38
		輸送用機器	7.88
		精密機器	2.03
		その他製品	2.09
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	4.57
		海運業	0.17
		空運業	0.56
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.38
		卸売業	4.84
		小売業	4.48
		銀行業	5.93
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.17
		その他金融業	1.07
		不動産業	2.27
サービス業	4.95		
	小計	98.07	
合計		98.07	

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	339	円	5,427,556,730	5,474,850,000	1.95

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	378,294,161,850	83.25
地方債証券	日本	25,057,345,185	5.51
特殊債券	日本	31,412,967,590	6.91
社債券	日本	16,094,031,590	3.54
	フランス	1,398,214,000	0.31
	オーストラリア	601,191,000	0.13
	アメリカ	105,670,000	0.02
	イギリス	100,457,000	0.02
	スウェーデン	100,215,000	0.02
	小計	18,399,778,590	4.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,219,216,111	0.27
合計(純資産総額)		454,383,469,326	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	152,730,000	0.03

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,060,000,000	101.29	9,177,235,100	101.25	9,173,884,200	0.100	2023/12/20	2.02
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	100.86	5,951,004,000	101.14	5,967,319,000	0.100	2023/6/20	1.31
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	5,790,000,000	101.04	5,850,216,000	101.07	5,852,010,900	0.100	2023/3/20	1.29
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.84	5,586,591,400	100.76	5,582,270,200	0.100	2022/3/20	1.23
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.87	4,842,112,800	100.84	4,840,656,000	0.100	2022/6/20	1.07
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.65	4,811,342,700	100.48	4,803,278,600	0.100	2021/3/20	1.06
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,710,000,000	101.38	4,775,073,100	101.59	4,785,218,700	0.100	2028/12/20	1.05
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.95	4,785,172,200	100.93	4,784,176,800	0.100	2022/9/20	1.05
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	103.82	4,744,950,100	103.06	4,710,161,900	1.000	2021/12/20	1.04
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	103.24	4,016,200,500	103.52	4,027,122,500	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,940,000,000	100.66	3,966,004,000	101.78	4,010,486,600	0.100	2028/3/20	0.88
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	100.33	3,902,867,100	101.65	3,954,223,900	0.100	2028/9/20	0.87
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,770,000,000	103.30	3,894,410,000	103.63	3,907,152,600	0.400	2025/9/20	0.86
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	102.21	3,894,239,100	1.200	2020/12/20	0.86
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	103.49	3,746,338,000	103.63	3,751,478,400	0.500	2024/9/20	0.83
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,530,000,000	102.62	3,622,486,000	103.11	3,639,888,900	0.300	2025/12/20	0.80
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.55	3,630,071,600	100.35	3,622,887,700	0.100	2020/9/20	0.80
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.85	3,562,192,200	103.58	3,553,034,100	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	3,430,000,000	101.02	3,464,997,700	101.18	3,470,782,700	0.100	2023/9/20	0.76
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	102.23	3,455,374,000	102.66	3,470,144,600	0.300	2024/12/20	0.76
日本	国債証券	第390回利付国債(2年)	3,320,000,000	100.38	3,332,616,000	100.29	3,329,926,800	0.100	2020/7/1	0.73
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	100.76	3,234,492,300	101.82	3,268,646,700	0.100	2027/12/20	0.72
日本	国債証券	第135回利付国債(10年)	3,140,000,000	104.07	3,267,871,600	102.89	3,230,840,200	1.200	2021/6/20	0.71

日本	国債証券	第129回利付国債（5年）	3,200,000,000	100.76	3,224,448,000	100.63	3,220,192,000	0.100	2021/9/20	0.71
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	3,150,000,000	101.05	3,183,075,000	101.87	3,208,968,000	0.100	2026/6/20	0.71
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	101.00	3,201,763,400	0.100	2022/12/20	0.70
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,540,000,000	117.98	2,996,934,100	119.69	3,040,227,600	1.500	2034/6/20	0.67
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	2,920,000,000	100.88	2,945,696,000	101.90	2,975,742,800	0.100	2027/3/20	0.65
日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	100.61	2,978,233,600	100.42	2,972,491,200	0.100	2020/12/20	0.65
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,910,000,000	101.05	2,940,793,600	101.84	2,963,573,100	0.100	2026/3/20	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.25
地方債証券	5.51
特殊債券	6.91
社債券	4.05
合計	99.73

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1円		152,650,324	152,730,000	0.03

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

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

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	226,587,560,885	61.94
	イギリス	21,983,575,383	6.01

	カナダ	13,455,442,700	3.68
	フランス	13,399,669,444	3.66
	スイス	12,575,018,024	3.44
	ドイツ	11,594,945,908	3.17
	オーストラリア	8,257,390,770	2.26
	オランダ	6,529,247,106	1.78
	アイルランド	6,032,070,299	1.65
	スペイン	3,928,985,388	1.07
	香港	3,629,796,611	0.99
	スウェーデン	3,369,249,755	0.92
	イタリア	2,535,393,965	0.69
	デンマーク	2,250,050,346	0.62
	シンガポール	1,658,603,184	0.45
	フィンランド	1,565,954,594	0.43
	バミューダ	1,489,442,800	0.41
	ベルギー	1,325,164,317	0.36
	ケイマン	957,899,267	0.26
	ジャージー	957,514,648	0.26
	ノルウェー	934,726,335	0.26
	イスラエル	694,065,251	0.19
	キュラソー	576,804,119	0.16
	ルクセンブルク	414,482,704	0.11
	オーストリア	331,945,983	0.09
	ニュージーランド	322,098,986	0.09
	パナマ	211,489,624	0.06
	ポルトガル	208,296,334	0.06
	リベリア	187,544,778	0.05
	パプアニューギニア	76,185,397	0.02
	英ヴァージン諸島	57,499,002	0.02
	マン島	40,498,148	0.01
	モーリシャス	9,968,680	0.00
	小計	348,148,580,735	95.17
投資信託受益証券	オーストラリア	167,723,885	0.05
	香港	89,878,641	0.02
	小計	257,602,526	0.07
投資証券	アメリカ	7,160,786,022	1.96
	オーストラリア	645,064,984	0.18
	フランス	445,553,874	0.12
	イギリス	277,527,741	0.08
	香港	233,825,854	0.06
	シンガポール	152,112,168	0.04
	カナダ	66,671,351	0.02

	小計	8,981,541,994	2.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,425,176,206	2.30
合計(純資産総額)		365,812,901,461	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,547,847,802	1.52
	買建	カナダ	329,278,320	0.09
	買建	ドイツ	1,380,035,462	0.38
	買建	イギリス	585,422,948	0.16
	買建	オーストラリア	324,605,638	0.09

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		984,569,580	0.27

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	402,575	21,013.25	8,459,412,944	22,960.56	9,243,350,663	2.53
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	618,610	11,067.55	6,846,501,745	14,445.42	8,936,085,906	2.44
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,254	180,511.35	6,363,747,468	212,766.66	7,500,875,920	2.05
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	203,629	20,412.62	4,156,602,416	21,616.13	4,401,671,139	1.20

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	26,644	120,404.28	3,208,051,849	141,316.88	3,765,247,017	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,292	121,353.89	3,069,282,700	141,751.97	3,585,191,053	0.98
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	281,755	12,356.06	3,481,384,362	12,707.27	3,580,339,254	0.98
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	227,778	13,697.15	3,119,909,661	15,619.85	3,557,858,763	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	358,711	8,790.29	3,153,174,254	9,196.30	3,298,816,480	0.90
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	259,428	8,458.48	2,194,366,602	10,657.75	2,764,918,975	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,028	14,713.86	2,192,778,245	18,010.08	2,684,007,245	0.73
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	789,496	3,365.56	2,657,101,289	3,364.44	2,656,218,238	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	109,623	21,845.42	2,394,760,860	23,706.60	2,598,789,434	0.71
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	386,406	6,169.64	2,383,988,232	6,443.67	2,489,876,034	0.68
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	210,947	8,441.31	1,780,671,025	11,551.86	2,436,831,899	0.67
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	380,632	4,839.74	1,842,163,532	6,300.51	2,398,175,913	0.66
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	152,138	11,037.35	1,679,201,572	15,350.29	2,335,363,029	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	95,597	20,863.38	1,994,476,586	23,097.02	2,208,006,299	0.60
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	349,784	5,495.19	1,922,129,714	6,246.82	2,185,038,561	0.60
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	490,485	4,023.24	1,973,341,079	4,430.37	2,173,034,199	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	77,757	21,458.42	1,668,542,559	27,471.47	2,136,099,754	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	161,747	13,625.56	2,203,894,586	13,187.11	2,132,976,290	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,621	27,501.67	2,244,714,460	25,813.86	2,106,953,189	0.58
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	616,020	3,551.23	2,187,633,325	3,393.52	2,090,481,735	0.57
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	378,409	6,122.66	2,316,873,053	5,313.99	2,010,862,966	0.55
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,639	40,234.68	1,836,270,652	42,816.17	1,954,087,639	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	220,538	6,679.68	1,473,123,709	8,538.62	1,883,092,162	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	383,994	3,576.96	1,373,532,331	4,801.72	1,843,831,862	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	342,026	4,780.46	1,635,044,690	5,350.90	1,830,148,291	0.50
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	59,430	24,099.92	1,432,258,804	28,983.90	1,722,513,771	0.47

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.27
		素材	4.33
		資本財	6.93
		商業・専門サービス	1.15
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.19
		耐久消費財・アパレル	1.86
		消費者サービス	1.86
		メディア・娯楽	6.06
		小売	4.82
		食品・生活必需品小売り	1.42
		食品・飲料・タバコ	4.74
		家庭用品・パーソナル用品	2.00
		ヘルスケア機器・サービス	4.38
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.66
		銀行	7.98
		各種金融	4.20
		保険	3.80
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	9.02
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.31
電気通信サービス	2.21		
公益事業	3.29		
半導体・半導体製造装置	3.15		
	小計	95.17	
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.46
合計			97.70

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
-------	----	-----	-------	---------	----	----	----------------	-------------	----------------	-------------	-------------



株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	339	アメリカドル	48,924,630.5	5,472,219,921	49,600,785	5,547,847,802	1.52
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	20	カナダドル	3,916,934	324,909,675	3,969,600	329,278,320	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	34	スイスフラン	3,184,748	348,984,685	3,263,660	357,631,862	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	240	ユーロ	8,018,670	997,362,175	8,220,000	1,022,403,600	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	26	オーストラリアドル	4,035,882	316,453,507	4,139,850	324,605,638	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	55	イギリスポンド	4,024,641.25	580,192,283	4,060,925	585,422,948	0.16

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	5,980,000.00	670,424,600	668,197,200	0.18
	ユーロ	売建	900,000.00	112,664,700	111,942,000	0.03
	イギリスポンド	売建	900,000.00	130,345,200	129,690,000	0.04
	スイスフラン	売建	682,000.00	74,733,560	74,740,380	0.02

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	143,634,450,076	46.02
	フランス	30,816,849,328	9.87
	イタリア	26,447,073,202	8.47
	ドイツ	20,316,899,121	6.51
	イギリス	20,184,703,547	6.47
	スペイン	17,591,394,213	5.64
	ベルギー	7,564,367,666	2.42
	オーストラリア	6,474,574,550	2.07
	オランダ	6,026,848,953	1.93
	カナダ	5,872,014,532	1.88

	オーストリア	4,477,993,070	1.43
	メキシコ	2,522,810,779	0.81
	アイルランド	2,394,065,177	0.77
	ポーランド	1,962,175,250	0.63
	フィンランド	1,935,297,469	0.62
	南アフリカ	1,724,063,505	0.55
	デンマーク	1,570,248,252	0.50
	マレーシア	1,462,359,057	0.47
	シンガポール	1,246,523,455	0.40
	スウェーデン	1,084,586,416	0.35
	ノルウェー	755,669,434	0.24
	小計	306,064,967,052	98.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,062,265,393	1.94
合計(純資産総額)		312,127,232,445	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,071,323,769	0.34
	買建	ドイツ	1,265,719,487	0.41

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,122,875,000	1.00

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,659.43	1,865,401,159	10,939.17	1,914,355,969	1.750	2023/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,360.15	1,897,146,236	11,324.56	1,891,202,332	2.625	2025/12/31	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,222.96	1,786,695,553	11,512.00	1,832,711,390	2.875	2028/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,463.17	1,719,476,196	11,574.52	1,736,179,305	3.000	2025/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	9,958.14	1,643,094,124	10,276.17	1,695,569,007	2.500	2046/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,824.17	1,702,680,525	11,747.92	1,691,701,608	3.125	2028/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,250.76	1,687,615,170	11,240.96	1,686,144,052	2.500	2022/1/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,237.41	1,637,986,177	10,266.57	1,642,651,952	2.500	2046/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,275.73	1,607,919,940	11,510.40	1,641,384,274	2.875	2028/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,785.62	1,580,093,969	11,021.86	1,614,703,580	1.875	2022/10/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,533.07	1,543,095,371	10,970.50	1,607,179,216	2.250	2027/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	11,154.80	1,556,094,669	11,196.30	1,561,884,767	2.500	2020/5/31	0.50
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000	13,863.01	1,504,137,639	13,618.55	1,477,612,976	3.250	2021/10/25	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 10/31/20	13,000,000	11,271.88	1,465,345,177	11,268.57	1,464,914,429	2.875	2020/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/20	12,700,000	11,219.33	1,424,855,110	11,217.26	1,424,592,204	2.625	2020/7/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/23	12,680,000	10,959.25	1,389,633,563	11,086.74	1,405,798,872	2.125	2023/11/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,882.11	1,360,263,998	11,197.61	1,399,701,861	2.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 10/15/21	12,250,000	11,355.57	1,391,057,478	11,334.19	1,388,438,741	2.875	2021/10/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,022.93	1,323,027,520	10,478.51	1,383,164,381	1.500	2026/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,535.87	1,295,912,425	10,919.54	1,343,103,683	2.000	2025/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,000,000	10,928.67	1,311,440,699	11,059.04	1,327,085,245	2.000	2023/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.875% 01/31/22	12,000,000	10,986.33	1,318,360,246	11,056.84	1,326,821,287	1.875	2022/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,664.64	1,279,757,021	11,013.29	1,321,595,740	2.125	2025/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/23	11,500,000	11,352.21	1,305,504,812	11,329.74	1,302,921,174	2.625	2023/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/15/21	11,500,000	11,148.87	1,282,120,332	11,193.35	1,287,235,513	2.375	2021/4/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/20	11,500,000	11,107.54	1,277,367,250	11,166.86	1,284,189,845	2.250	2020/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 12/31/23	11,500,000	11,110.63	1,277,722,940	11,144.69	1,281,639,883	2.250	2023/12/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	11,500,000	10,995.18	1,264,446,703	11,116.02	1,278,342,760	2.875	2043/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,488.37	1,275,209,179	11,434.64	1,269,245,813	3.625	2021/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 10/31/23	11,000,000	11,362.17	1,249,838,744	11,445.86	1,259,044,862	2.875	2023/10/31	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.06
合計	98.06

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	38	アメリカ ドル	4,375,167.56	489,362,491	4,385,734.28	490,544,379	0.16
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	23	アメリカ ドル	2,827,685.85	316,276,662	2,837,984.49	317,428,565	0.10
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカ ドル	2,343,501.5	262,120,643	2,354,500	263,350,825	0.08
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	18	ユーロ	2,014,252	250,532,664	2,015,010	250,626,944	0.08
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	19	ユーロ	2,520,416	313,489,342	2,527,760	314,402,789	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	34	ユーロ	5,593,536	695,724,007	5,633,460	700,689,754	0.22

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	14,510,000.00	1,620,628,430	1,620,186,600	0.52
	カナダドル	買建	1,540,000.00	128,860,260	127,573,600	0.04
	ユーロ	買建	9,330,000.00	1,179,713,825	1,160,465,400	0.37
	イギリスポンド	買建	1,490,000.00	217,238,665	214,649,400	0.07

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

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

## 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績



## 運用実績

当初設定日：2001年10月1日

作成基準日：2019年4月26日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額 16,557円

純資産総額 475.17億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

### 分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額：0円

決算期	2014年9月	2015年9月	2016年9月	2017年10月	2018年10月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	59.1%	第138回利付国債(5年) 第136回利付国債(5年) 第135回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	1.2%
国内株式 インデックス マザーファンド	20.8%	トヨタ自動車 ソフトバンクグループ 三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	輸送用機器 情報・通信業 銀行業	-	-	0.7%
外国債券 インデックス マザーファンド	9.5%	T 1.75% 05/15/23 T 2.625% 12/31/25 T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	1.750% 2.625% 2.875%	2023/05/15 2025/12/31 2028/08/15	0.1% 0.1% 0.1%
外国株式 インデックス マザーファンド	5.9%	APPLE INC MICROSOFT CORP AMAZON.COM	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器 ソフトウェア・サービス 小売	-	-	0.2% 0.1% 0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移（暦年ベース）



※2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

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

受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求

の受付を取り消すことができます。

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法



## ・株式

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

## ・公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評価します。

- a. 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）
- b. 価格情報会社の提供する価額
- c. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

## 外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

## &lt; 基準価額の照会方法 &gt;

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （２）【保管】

該当事項はありません。

## （３）【信託期間】

無期限とします。（2001年10月 1日設定）

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

## （４）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

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

## （５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

- (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ファンドの繰上償還において、上記 から までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

## <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

### (1)投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

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

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受

益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

#### < 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をするこ

とします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2017年10月3日から2018年10月1日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DCマイセレクション25】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2017年10月 2日現在)	第17期 (2018年10月 1日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,840,816,501	2,275,015,346
親投資信託受益証券	37,047,944,106	43,544,955,986
未収入金	-	90,340,000
流動資産合計	38,888,760,607	45,910,311,332
資産合計	38,888,760,607	45,910,311,332
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	24,317,294	50,993,247
未払受託者報酬	6,155,060	7,187,487
未払委託者報酬	47,188,733	55,104,005
未払利息	3,446	5,685
その他未払費用	1,663,050	1,687,016
流動負債合計	79,327,583	114,977,440
負債合計	79,327,583	114,977,440
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	23,943,495,831	27,543,792,919
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,865,937,193	18,251,540,973
(分配準備積立金)	6,483,286,085	6,917,160,120
元本等合計	38,809,433,024	45,795,333,892
純資産合計	38,809,433,024	45,795,333,892
負債純資産合計	38,888,760,607	45,910,311,332

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	2016年10月 1日 至 2017年10月 2日	自	2017年10月 3日 至 2018年10月 1日
営業収益				
受取利息		2,295		1,309
有価証券売買等損益		2,507,793,351		1,157,001,880
営業収益合計		2,507,795,646		1,157,003,189
営業費用				
支払利息		1,246,729		1,464,033
受託者報酬		11,835,262		13,904,048
委託者報酬		90,736,915		106,597,551
その他費用		1,677,810		1,741,281
営業費用合計		105,496,716		123,706,913
営業利益又は営業損失（ ）		2,402,298,930		1,033,296,276
経常利益又は経常損失（ ）		2,402,298,930		1,033,296,276
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,402,298,930		1,033,296,276
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（ ）		121,957,432		49,996,312
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,420,106,902		14,865,937,193
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,282,732,103		3,835,568,922
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,282,732,103		3,835,568,922
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,117,243,310		1,433,265,106
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,117,243,310		1,433,265,106
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,865,937,193		18,251,540,973

## (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 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第17期計算期間は2017年10月3日から2018年10月1日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2017年10月2日現在)	第17期 (2018年10月1日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,943,495,831口	27,543,792,919口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6209円 (16,209円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6626円 (16,626円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2016年10月1日 至 2017年10月2日			第17期 自 2017年10月3日 至 2018年10月1日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 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	2,281,314,412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	983,622,900円
収益調整金額	C	8,382,651,108円	収益調整金額	C	11,334,380,853円
分配準備積立金額	D	4,201,971,673円	分配準備積立金額	D	5,933,537,220円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,865,937,193円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,251,540,973円
当ファンドの期末残存口数	F	23,943,495,831口	当ファンドの期末残存口数	F	27,543,792,919口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,208円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,626円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円



## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第17期 自 2017年10月 3日 至 2018年10月 1日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第17期 (2018年10月 1日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第16期	第17期
	自 2016年10月 1日 至 2017年10月 2日	自 2017年10月 3日 至 2018年10月 1日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	22,135,178,854円	23,943,495,831円
期中追加設定元本額	3,956,589,861円	5,895,612,544円
期中一部解約元本額	2,148,272,884円	2,295,315,456円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第16期	第17期
	(2017年10月 2日現在)	(2018年10月 1日現在)
	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	2,384,343,626	1,092,082,993
合計	2,384,343,626	1,092,082,993

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	5,573,724,027	9,193,857,782	
	外国株式インデックス マザーファンド	964,501,805	2,577,727,524	
	国内債券インデックス マザーファンド	19,864,955,453	27,417,611,516	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,578,287,979	4,355,759,164	
合計		27,981,469,264	43,544,955,986	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2018年10月 1日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,046,301,560
株式	228,398,082,175
新株予約権証券	1,917,300
派生商品評価勘定	64,908,640
未収入金	1,254,748,145
未収配当金	1,882,336,624
差入委託証拠金	113,123,300
流動資産合計	233,761,417,744
資産合計	233,761,417,744
負債の部	
流動負債	
前受金	64,913,500
未払金	18,645,515
未払解約金	1,147,281,207
未払利息	5,114
その他未払費用	1,506
流動負債合計	1,230,846,842

	2018年10月 1日現在
項目	金額（円）
負債合計	1,230,846,842
純資産の部	
元本等	
元本	140,967,747,516
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	91,562,823,386
元本等合計	232,530,570,902
純資産合計	232,530,570,902
負債純資産合計	233,761,417,744

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年10月 1日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年10月 1日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		140,967,747,516口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6495円 (16,495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

	2018年10月 1日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月 1日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2018年10月 1日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年10月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年10月 3日
期首元本額	119,334,768,553円
期中追加設定元本額	40,599,673,428円
期中一部解約元本額	18,966,694,465円
期末元本額	140,967,747,516円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	618,242,873円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,573,103,369円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,343,313円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,366,810,645円
世界経済インデックスファンド	1,658,472,920円

区分	2018年10月 1日現在
日本株式インデックス・オープン	5,835,200,599円
DCマイセレクション25	5,573,724,027円
DCマイセレクション50	16,850,722,405円
DCマイセレクション75	16,081,730,114円
DC日本株式インデックス・オープン	5,253,105,931円
DCマイセレクションS25	2,222,390,754円
DCマイセレクションS50	6,715,245,872円
DCマイセレクションS75	4,616,601,300円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,646,107,345円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	348,527,206円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	555,151,909円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	361,446,999円
DC世界経済インデックスファンド	1,329,141,008円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	441,645,183円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	23,241,513円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	47,259,581円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	40,334,232円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	345,740,103円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,562,169円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	122,805,228円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	429,060,562円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	67,370,503円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	637,392,855円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,832,292,647円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	727,174,924円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,268,549,618円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	640,451,142円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	49,277,359円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	817,770,092円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	315,024,752円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	460,025,470円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	596,026,094円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	55,053,016円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	930,830,982円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,769,875,901円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,549,193,098円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	182,728,525円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	184,260,632円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	214,008,948円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	8,883,742円
SMT インデックスバランス・オープン	67,211,449円
SMT 世界経済インデックス・オープン	5,222,657円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	44,932,173円

区分	2018年10月 1日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	5,849,472円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	970,076円
グローバル経済コア	314,909,739円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,349,929円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	32,585,578円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	623,879円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	34,110,185,104円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2018年10月 1日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,590,705,974
新株予約権証券	1,917,300
合計	7,592,623,274

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2018年10月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,999,261,500	-	4,064,175,000	64,913,500
	合計	3,999,261,500	-	4,064,175,000	64,913,500

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

	評価額
--	-----



銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	3,900	3,380.00	13,182,000	
日本水産	111,000	735.00	81,585,000	
マルハニチロ	18,700	4,180.00	78,166,000	
カネコ種苗	3,400	1,590.00	5,406,000	
サカタのタネ	14,600	4,020.00	58,692,000	
ホクト	10,000	1,957.00	19,570,000	
ホクリヨウ	1,600	826.00	1,321,600	
住石ホールディングス	25,800	145.00	3,741,000	
日鉄鉱業	2,700	5,380.00	14,526,000	
三井松島ホールディングス	5,000	1,921.00	9,605,000	
国際石油開発帝石	479,700	1,437.00	689,328,900	
石油資源開発	15,600	2,634.00	41,090,400	
K & O エナジーグループ	5,800	1,781.00	10,329,800	
ヒノキヤグループ	2,500	2,902.00	7,255,000	
ショーボンドホールディングス	9,300	9,130.00	84,909,000	
ミライト・ホールディングス	33,800	1,959.00	66,214,200	
タマホーム	7,500	1,162.00	8,715,000	
サンヨーホームズ	1,500	988.00	1,482,000	
日本アクア	2,800	400.00	1,120,000	
ファーストコーポレーション	3,300	1,200.00	3,960,000	
ベステラ	1,800	1,592.00	2,865,600	
T A T E R U	14,200	724.00	10,280,800	
スペースバリューホールディングス	14,700	1,160.00	17,052,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,200	926.00	2,037,200	
第一カッター興業	1,300	2,330.00	3,029,000	
安藤・間	80,500	871.00	70,115,500	
東急建設	37,900	1,090.00	41,311,000	
コムシスホールディングス	37,912	3,335.00	126,436,520	
ミサワホーム	8,300	898.00	7,453,400	
ピーアールホールディングス	9,700	465.00	4,510,500	
高松コンストラクショングループ	6,400	3,150.00	20,160,000	
東建コーポレーション	3,700	7,380.00	27,306,000	
ソネック	1,200	846.00	1,015,200	
ヤマウラ	4,700	900.00	4,230,000	
大成建設	98,200	5,180.00	508,676,000	
大林組	295,800	1,076.00	318,280,800	
清水建設	301,800	1,039.00	313,570,200	
飛鳥建設	8,980	1,910.00	17,151,800	
長谷工コーポレーション	115,100	1,485.00	170,923,500	
松井建設	11,000	926.00	10,186,000	
銭高組	1,400	5,560.00	7,784,000	

鹿島建設	216,800	1,649.00	357,503,200
不動テトラ	7,470	2,069.00	15,455,430
大末建設	3,200	1,253.00	4,009,600
鉄建建設	6,000	2,949.00	17,694,000
西松建設	22,800	2,869.00	65,413,200
三井住友建設	68,700	770.00	52,899,000
大豊建設	7,200	3,250.00	23,400,000
前田建設工業	70,300	1,495.00	105,098,500
佐田建設	6,500	435.00	2,827,500
ナカノフドー建設	7,600	690.00	5,244,000
奥村組	16,200	3,635.00	58,887,000
東鉄工業	11,800	2,928.00	34,550,400
イチケン	1,800	2,275.00	4,095,000
富士ピー・エス	2,600	620.00	1,612,000
浅沼組	3,500	3,560.00	12,460,000
戸田建設	114,700	807.00	92,562,900
熊谷組	15,500	3,095.00	47,972,500
青木あすなろ建設	6,500	971.00	6,311,500
北野建設	2,100	4,085.00	8,578,500
植木組	1,200	2,633.00	3,159,600
矢作建設工業	13,400	866.00	11,604,400
ピーエス三菱	11,900	602.00	7,163,800
日本ハウスホールディングス	18,900	643.00	12,152,700
大東建託	35,100	14,455.00	507,370,500
新日本建設	11,700	1,240.00	14,508,000
N I P P O	22,800	2,078.00	47,378,400
東亜道路工業	2,000	3,790.00	7,580,000
前田道路	30,900	2,303.00	71,162,700
日本道路	2,700	6,580.00	17,766,000
東亜建設工業	7,300	2,498.00	18,235,400
若築建設	5,300	1,661.00	8,803,300
東洋建設	31,000	461.00	14,291,000
五洋建設	117,300	749.00	87,857,700
世紀東急工業	13,300	702.00	9,336,600
福田組	3,200	5,690.00	18,208,000
住友林業	63,100	1,965.00	123,991,500
日本基礎技術	10,900	397.00	4,327,300
巴コーポレーション	12,500	489.00	6,112,500
大和ハウス工業	291,400	3,375.00	983,475,000
ライト工業	19,000	1,534.00	29,146,000
積水ハウス	321,000	1,721.00	552,441,000
日特建設	8,400	752.00	6,316,800

北陸電気工事	5,500	1,062.00	5,841,000
ユアテック	13,800	933.00	12,875,400
四電工	1,500	2,753.00	4,129,500
中電工	12,700	2,574.00	32,689,800
関電工	39,300	1,179.00	46,334,700
きんでん	65,600	1,816.00	119,129,600
東京エネシス	11,200	1,114.00	12,476,800
トーエネック	2,800	3,245.00	9,086,000
住友電設	7,800	1,889.00	14,734,200
日本電設工業	15,100	2,372.00	35,817,200
協和エクシオ	37,593	3,315.00	124,620,795
新日本空調	7,600	1,702.00	12,935,200
九電工	19,500	4,525.00	88,237,500
三機工業	21,000	1,216.00	25,536,000
日揮	85,000	2,635.00	223,975,000
中外炉工業	3,000	3,015.00	9,045,000
ヤマト	8,100	721.00	5,840,100
太平電業	6,700	2,924.00	19,590,800
高砂熱学工業	27,100	2,054.00	55,663,400
三晃金属工業	1,100	3,460.00	3,806,000
朝日工業社	2,000	3,425.00	6,850,000
明星工業	17,900	903.00	16,163,700
大気社	12,500	3,690.00	46,125,000
ダイダン	6,600	2,837.00	18,724,200
日比谷総合設備	11,000	1,978.00	21,758,000
東芝プラントシステム	21,400	2,452.00	52,472,800
OSJBホールディングス	43,500	305.00	13,267,500
東洋エンジニアリング	10,100	913.00	9,221,300
千代田化工建設	64,000	898.00	57,472,000
新興プランテック	19,100	1,152.00	22,003,200
日本製粉	29,300	1,996.00	58,482,800
日清製粉グループ本社	108,200	2,483.00	268,660,600
日東富士製粉	600	5,400.00	3,240,000
昭和産業	8,100	2,945.00	23,854,500
鳥越製粉	7,800	1,030.00	8,034,000
中部飼料	10,800	1,558.00	16,826,400
フィード・ワン	60,000	215.00	12,900,000
東洋精糖	1,500	1,226.00	1,839,000
日本甜菜製糖	5,000	2,090.00	10,450,000
三井製糖	7,000	3,155.00	22,085,000
塩水港精糖	10,600	268.00	2,840,800
日新製糖	4,200	2,284.00	9,592,800

森永製菓	20,700	4,300.00	89,010,000
中村屋	2,300	4,815.00	11,074,500
江崎グリコ	24,700	5,590.00	138,073,000
名糖産業	4,200	1,694.00	7,114,800
井村屋グループ	3,500	3,385.00	11,847,500
不二家	4,900	2,551.00	12,499,900
山崎製パン	72,300	2,269.00	164,048,700
第一屋製パン	1,500	1,135.00	1,702,500
モロゾフ	1,500	6,050.00	9,075,000
亀田製菓	5,500	5,300.00	29,150,000
寿スピリッツ	8,500	5,310.00	45,135,000
カルビー	40,300	3,735.00	150,520,500
森永乳業	17,700	3,105.00	54,958,500
六甲バター	6,500	2,599.00	16,893,500
ヤクルト本社	51,400	9,260.00	475,964,000
明治ホールディングス	58,400	7,680.00	448,512,000
雪印メグミルク	21,300	2,937.00	62,558,100
プリマハム	12,400	2,660.00	32,984,000
日本ハム	38,200	4,165.00	159,103,000
林兼産業	3,100	724.00	2,244,400
丸大食品	9,400	2,214.00	20,811,600
S Foods	6,200	4,860.00	30,132,000
伊藤ハム米久ホールディングス	56,900	793.00	45,121,700
サッポロホールディングス	32,300	2,354.00	76,034,200
アサヒグループホールディングス	185,100	5,012.00	927,721,200
キリンホールディングス	399,800	2,926.00	1,169,814,800
宝ホールディングス	66,200	1,708.00	113,069,600
オエノンホールディングス	25,400	409.00	10,388,600
養命酒製造	2,700	2,432.00	6,566,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	67,700	3,100.00	209,870,000
サントリー食品インターナショナル	59,100	4,740.00	280,134,000
ダイドーグループホールディングス	4,500	5,720.00	25,740,000
伊藤園	29,300	5,120.00	150,016,000
キーコーヒー	8,700	2,080.00	18,096,000
ユニカフェ	2,700	1,272.00	3,434,400
ジャパンフーズ	1,300	1,418.00	1,843,400
日清オイリオグループ	10,400	3,310.00	34,424,000
不二製油グループ本社	23,900	3,555.00	84,964,500
かどや製油	1,000	6,360.00	6,360,000
J - オイルミルズ	4,600	3,870.00	17,802,000
キッコーマン	63,600	6,780.00	431,208,000
味の素	203,200	1,942.50	394,716,000

キューピー	49,200	2,585.00	127,182,000
ハウス食品グループ本社	33,700	3,390.00	114,243,000
カゴメ	35,400	3,255.00	115,227,000
焼津水産化学工業	4,400	1,111.00	4,888,400
アリアケジャパン	8,100	11,210.00	90,801,000
ピエトロ	1,200	1,654.00	1,984,800
エバラ食品工業	1,900	2,277.00	4,326,300
ニチレイ	42,100	3,000.00	126,300,000
東洋水産	48,500	4,380.00	212,430,000
イトアンド	2,800	1,710.00	4,788,000
大冷	1,000	1,968.00	1,968,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	927.00	1,575,900
日清食品ホールディングス	34,700	7,850.00	272,395,000
永谷園ホールディングス	4,500	3,110.00	13,995,000
一正蒲鉾	3,500	1,078.00	3,773,000
フジッコ	9,600	2,366.00	22,713,600
ロック・フィールド	9,500	1,873.00	17,793,500
日本たばこ産業	510,300	2,941.00	1,500,792,300
ケンコーマヨネーズ	5,900	2,856.00	16,850,400
わらべや日洋ホールディングス	5,800	2,002.00	11,611,600
なとり	4,900	1,882.00	9,221,800
イフジ産業	1,500	794.00	1,191,000
ピククルスコーポレーション	1,700	2,375.00	4,037,500
北の達人コーポレーション	27,000	710.00	19,170,000
ユーグレナ	35,200	862.00	30,342,400
ミヨシ油脂	3,400	1,321.00	4,491,400
理研ビタミン	3,300	3,920.00	12,936,000
片倉工業	10,700	1,399.00	14,969,300
ゲンゼ	6,900	5,690.00	39,261,000
東洋紡	34,100	1,921.00	65,506,100
ユニチカ	27,000	708.00	19,116,000
富士紡ホールディングス	5,200	3,520.00	18,304,000
倉敷紡績	9,300	3,075.00	28,597,500
シキボウ	4,600	1,322.00	6,081,200
日本毛織	28,600	939.00	26,855,400
トーア紡コーポレーション	3,800	564.00	2,143,200
ガイドーリミテッド	10,700	394.00	4,215,800
帝国繊維	9,700	3,060.00	29,682,000
帝人	75,800	2,189.00	165,926,200
東レ	669,100	878.30	587,670,530
サカイオーベックス	2,300	2,401.00	5,522,300
住江織物	2,300	3,215.00	7,394,500

日本フェルト	5,100	516.00	2,631,600
イチカワ	1,200	1,740.00	2,088,000
日東製網	1,000	1,717.00	1,717,000
アツギ	6,300	1,168.00	7,358,400
ダイニック	3,400	975.00	3,315,000
セーレン	21,200	1,914.00	40,576,800
ソトー	3,600	1,010.00	3,636,000
東海染工	1,400	1,377.00	1,927,800
小松マテーレ	14,200	1,104.00	15,676,800
ワコールホールディングス	25,100	3,240.00	81,324,000
ホギメディカル	11,600	3,985.00	46,226,000
レナウン	25,200	126.00	3,175,200
クラウドシアホールディングス	2,300	533.00	1,225,900
T S Iホールディングス	31,900	817.00	26,062,300
マツオカコーポレーション	2,200	3,350.00	7,370,000
三陽商会	5,200	2,205.00	11,466,000
ナイガイ	3,400	515.00	1,751,000
オンワードホールディングス	53,600	755.00	40,468,000
ルックホールディングス	3,300	1,323.00	4,365,900
ゴールドウイン	5,200	7,930.00	41,236,000
デサント	21,100	2,407.00	50,787,700
キング	4,600	462.00	2,125,200
ヤマトインターナショナル	5,900	504.00	2,973,600
特種東海製紙	5,100	4,730.00	24,123,000
王子ホールディングス	388,000	826.00	320,488,000
日本製紙	41,300	2,080.00	85,904,000
三菱製紙	13,200	667.00	8,804,400
北越コーポレーション	51,500	625.00	32,187,500
中越パルプ工業	3,700	1,660.00	6,142,000
巴川製紙所	2,800	1,430.00	4,004,000
大王製紙	37,000	1,617.00	59,829,000
阿波製紙	2,200	610.00	1,342,000
レンゴー	88,900	980.00	87,122,000
トモク	5,300	2,126.00	11,267,800
ザ・パック	6,500	4,030.00	26,195,000
クラレ	145,500	1,718.00	249,969,000
旭化成	575,100	1,730.00	994,923,000
共和レザー	5,400	1,000.00	5,400,000
昭和電工	57,300	6,420.00	367,866,000
住友化学	679,000	669.00	454,251,000
住友精化	3,800	6,320.00	24,016,000
日産化学	52,900	6,120.00	323,748,000

ラサ工業	3,300	2,404.00	7,933,200
クレハ	8,000	8,500.00	68,000,000
多木化学	1,300	5,090.00	6,617,000
テイカ	7,000	2,750.00	19,250,000
石原産業	16,600	1,740.00	28,884,000
片倉コープアグリ	2,300	1,203.00	2,766,900
日東エフシー	5,500	769.00	4,229,500
日本曹達	12,800	3,530.00	45,184,000
東ソー	133,300	1,751.00	233,408,300
トクヤマ	26,800	3,105.00	83,214,000
セントラル硝子	18,800	2,953.00	55,516,400
東亜合成	54,100	1,337.00	72,331,700
大阪ソーダ	9,100	3,005.00	27,345,500
関東電化工業	22,100	1,212.00	26,785,200
デンカ	33,900	4,005.00	135,769,500
信越化学工業	152,000	10,130.00	1,539,760,000
日本カーバイド工業	2,900	1,836.00	5,324,400
堺化学工業	6,300	2,902.00	18,282,600
第一稀元素化学工業	7,000	1,398.00	9,786,000
エア・ウォーター	76,000	2,093.00	159,068,000
大陽日酸	71,000	1,743.00	123,753,000
日本化学工業	3,400	3,780.00	12,852,000
東邦アセチレン	1,300	1,547.00	2,011,100
日本パーカラライジング	47,100	1,557.00	73,334,700
高压ガス工業	13,700	964.00	13,206,800
チタン工業	1,000	2,772.00	2,772,000
四国化成工業	13,300	1,575.00	20,947,500
戸田工業	1,800	2,965.00	5,337,000
ステラ ケミファ	4,700	4,150.00	19,505,000
保土谷化学工業	3,000	3,380.00	10,140,000
日本触媒	14,500	8,860.00	128,470,000
大日精化工業	7,100	3,780.00	26,838,000
カネカ	24,900	5,330.00	132,717,000
三菱瓦斯化学	76,000	2,454.00	186,504,000
三井化学	83,800	2,862.00	239,835,600
J S R	92,700	2,116.00	196,153,200
東京応化工業	14,800	3,445.00	50,986,000
大阪有機化学工業	8,000	1,475.00	11,800,000
三菱ケミカルホールディングス	617,700	1,093.50	675,454,950
K Hネオケム	13,100	4,330.00	56,723,000
ダイセル	124,400	1,349.00	167,815,600
住友ベークライト	14,900	5,160.00	76,884,000

積水化学工業	188,500	2,074.00	390,949,000
日本ゼオン	77,800	1,192.00	92,737,600
アイカ工業	25,900	4,585.00	118,751,500
宇部興産	46,400	3,100.00	143,840,000
積水樹脂	14,200	2,165.00	30,743,000
タキロンシーアイ	18,900	626.00	11,831,400
旭有機材	5,400	2,835.00	15,309,000
日立化成	45,600	2,303.00	105,016,800
ニチバン	4,600	2,768.00	12,732,800
リケンテクノス	19,900	603.00	11,999,700
大倉工業	4,400	2,306.00	10,146,400
積水化成成品工業	11,600	1,099.00	12,748,400
群栄化学工業	2,200	3,335.00	7,337,000
タイガースポリマー	4,700	772.00	3,628,400
ミライアル	3,100	1,154.00	3,577,400
ダイキアクシス	3,100	1,397.00	4,330,700
ダイキョーニシカワ	18,300	1,296.00	23,716,800
竹本容器	1,600	3,085.00	4,936,000
森六ホールディングス	4,700	3,145.00	14,781,500
日本化薬	59,900	1,347.00	80,685,300
カーリットホールディングス	8,700	1,008.00	8,769,600
日本精化	7,600	1,348.00	10,244,800
扶桑化学工業	8,800	2,723.00	23,962,400
トリケミカル研究所	2,100	4,815.00	10,111,500
A D E K A	39,700	1,936.00	76,859,200
日油	35,600	3,795.00	135,102,000
ハリマ化成グループ	7,200	1,000.00	7,200,000
花王	216,500	9,265.00	2,005,872,500
第一工業製薬	3,500	3,655.00	12,792,500
石原ケミカル	2,200	2,334.00	5,134,800
日華化学	3,000	1,238.00	3,714,000
ニイタカ	1,400	1,830.00	2,562,000
三洋化成工業	5,800	5,830.00	33,814,000
有機合成薬品工業	6,300	275.00	1,732,500
大日本塗料	10,700	1,328.00	14,209,600
日本ペイントホールディングス	71,200	4,330.00	308,296,000
関西ペイント	96,900	2,099.00	203,393,100
神東塗料	7,100	217.00	1,540,700
中国塗料	26,400	1,092.00	28,828,800
日本特殊塗料	5,800	2,641.00	15,317,800
藤倉化成	11,700	685.00	8,014,500
太陽ホールディングス	7,100	4,370.00	31,027,000



D I C	39,000	4,030.00	157,170,000
サカタインクス	18,800	1,465.00	27,542,000
東洋インキＳＣホールディングス	18,200	2,974.00	54,126,800
T & K T O K A	6,300	1,214.00	7,648,200
富士フイルムホールディングス	182,900	5,230.00	956,567,000
資生堂	175,000	8,771.00	1,534,925,000
ライオン	122,700	2,500.00	306,750,000
高砂香料工業	5,500	4,035.00	22,192,500
マンダム	17,200	3,615.00	62,178,000
ミルボン	10,900	5,080.00	55,372,000
ファンケル	21,400	5,470.00	117,058,000
コーセー	14,900	21,590.00	321,691,000
コタ	4,200	1,658.00	6,963,600
シーズ・ホールディングス	10,600	4,185.00	44,361,000
シーボン	1,100	2,807.00	3,087,700
ポーラ・オルビスホールディングス	37,600	4,110.00	154,536,000
ノエビアホールディングス	5,600	6,370.00	35,672,000
アジュバンコスメジャパン	1,900	1,026.00	1,949,400
エステー	6,300	2,166.00	13,645,800
アグロ カネショウ	3,600	2,490.00	8,964,000
コニシ	14,500	1,786.00	25,897,000
長谷川香料	10,500	2,420.00	25,410,000
星光P M C	6,000	1,056.00	6,336,000
小林製薬	24,700	8,450.00	208,715,000
荒川化学工業	7,900	1,911.00	15,096,900
メック	6,100	1,952.00	11,907,200
日本高純度化学	2,400	2,488.00	5,971,200
タカラバイオ	23,100	3,130.00	72,303,000
J C U	10,700	2,734.00	29,253,800
新田ゼラチン	6,100	836.00	5,099,600
O A T アグリオ	1,200	2,792.00	3,350,400
デクセリアルズ	22,800	1,153.00	26,288,400
アース製薬	6,600	5,550.00	36,630,000
北興化学工業	9,200	625.00	5,750,000
大成ラミック	2,700	3,200.00	8,640,000
クミアイ化学工業	36,400	840.00	30,576,000
日本農薬	21,200	778.00	16,493,600
アキレス	6,400	2,375.00	15,200,000
有沢製作所	14,900	998.00	14,870,200
日東電工	66,500	8,657.00	575,690,500
レック	10,500	2,891.00	30,355,500
三光合成	6,900	478.00	3,298,200

きもと	15,100	311.00	4,696,100	
藤森工業	7,400	3,835.00	28,379,000	
前澤化成工業	6,100	1,245.00	7,594,500	
ウェブロックホールディングス	2,400	997.00	2,392,800	
J S P	5,200	2,923.00	15,199,600	
エフピコ	7,300	6,820.00	49,786,000	
天馬	6,900	2,024.00	13,965,600	
信越ポリマー	18,100	927.00	16,778,700	
東リ	22,200	363.00	8,058,600	
ニフコ	32,300	3,040.00	98,192,000	
バルカー	7,200	3,180.00	22,896,000	
ユニ・チャーム	186,700	3,715.00	693,590,500	
協和発酵キリン	110,300	2,117.00	233,505,100	
武田薬品工業	324,400	4,723.00	1,532,141,200	
アステラス製薬	865,900	1,970.50	1,706,255,950	
大日本住友製薬	65,300	2,629.00	171,673,700	
塩野義製薬	124,000	7,533.00	934,092,000	
田辺三菱製薬	107,400	1,866.00	200,408,400	
わかもと製薬	10,600	288.00	3,052,800	
あすか製薬	10,000	1,568.00	15,680,000	
日本新薬	23,000	7,360.00	169,280,000	
バイオフェルミン製薬	1,500	2,972.00	4,458,000	
中外製薬	91,800	7,390.00	678,402,000	
科研製薬	15,900	5,990.00	95,241,000	
エーザイ	105,400	11,145.00	1,174,683,000	
ロート製薬	48,400	4,000.00	193,600,000	
小野薬品工業	207,900	3,210.00	667,359,000	
久光製薬	26,000	8,650.00	224,900,000	
持田製薬	6,100	9,320.00	56,852,000	
参天製薬	166,900	1,825.00	304,592,500	
扶桑薬品工業	3,100	2,879.00	8,924,900	
日本ケミファ	1,200	4,575.00	5,490,000	
ツムラ	31,500	3,880.00	122,220,000	
日医工	23,200	1,662.00	38,558,400	
キッセイ薬品工業	15,600	3,545.00	55,302,000	
生化学工業	17,100	1,743.00	29,805,300	
栄研化学	14,300	2,647.00	37,852,100	
日水製薬	3,800	1,363.00	5,179,400	
鳥居薬品	4,700	2,717.00	12,769,900	
J C R ファーマ	6,200	6,430.00	39,866,000	
東和薬品	4,200	8,520.00	35,784,000	
富士製薬工業	6,000	1,784.00	10,704,000	

沢井製薬	17,700	5,990.00	106,023,000
ゼリア新薬工業	18,900	2,473.00	46,739,700
第一三共	252,000	4,889.00	1,232,028,000
キョーリン製薬ホールディングス	24,600	2,382.00	58,597,200
大幸薬品	4,700	2,110.00	9,917,000
ダイト	5,100	3,525.00	17,977,500
大塚ホールディングス	167,700	5,707.00	957,063,900
大正製薬ホールディングス	19,700	13,830.00	272,451,000
ペプチドリーム	40,500	4,625.00	187,312,500
日本コークス工業	75,600	114.00	8,618,400
昭和シェル石油	82,400	2,470.00	203,528,000
ニチレキ	11,400	1,214.00	13,839,600
ユシロ化学工業	4,900	1,555.00	7,619,500
ピーピー・カストロール	3,100	1,654.00	5,127,400
富士石油	21,400	487.00	10,421,800
MORESCO	3,200	1,690.00	5,408,000
出光興産	73,900	6,120.00	452,268,000
JXTGホールディングス	1,405,200	860.70	1,209,455,640
コスモエネルギーホールディングス	25,500	4,765.00	121,507,500
横浜ゴム	51,000	2,442.00	124,542,000
東洋ゴム工業	45,200	2,028.00	91,665,600
ブリヂストン	270,600	4,320.00	1,168,992,000
住友ゴム工業	79,100	1,689.00	133,599,900
藤倉ゴム工業	7,700	589.00	4,535,300
オカモト	6,100	6,220.00	37,942,000
フコク	3,900	1,012.00	3,946,800
ニッタ	9,100	4,320.00	39,312,000
住友理工	17,100	1,144.00	19,562,400
三ツ星ベルト	10,700	3,090.00	33,063,000
バンドー化学	16,800	1,363.00	22,898,400
日東紡績	13,100	2,602.00	34,086,200
A G C	88,800	4,735.00	420,468,000
日本板硝子	43,000	1,236.00	53,148,000
石塚硝子	1,200	2,530.00	3,036,000
日本山村硝子	3,700	1,819.00	6,730,300
日本電気硝子	38,100	3,565.00	135,826,500
オハラ	3,500	3,250.00	11,375,000
住友大阪セメント	16,700	4,715.00	78,740,500
太平洋セメント	55,600	3,605.00	200,438,000
日本ヒューム	9,000	1,030.00	9,270,000
日本コンクリート工業	19,300	355.00	6,851,500
三谷セキサン	4,600	2,893.00	13,307,800

アジアパイルホールディングス	11,400	747.00	8,515,800
東海カーボン	80,000	2,321.00	185,680,000
日本カーボン	4,200	8,080.00	33,936,000
東洋炭素	5,200	3,440.00	17,888,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,900	7,080.00	34,692,000
TOTO	67,700	4,795.00	324,621,500
日本碍子	107,500	1,867.00	200,702,500
日本特殊陶業	74,200	3,290.00	244,118,000
MARUWA	3,000	7,590.00	22,770,000
品川リフラクトリーズ	2,300	5,020.00	11,546,000
黒崎播磨	1,700	8,770.00	14,909,000
ヨータイ	7,000	921.00	6,447,000
イソライト工業	4,600	604.00	2,778,400
東京窯業	11,200	497.00	5,566,400
ニッカトー	4,100	1,323.00	5,424,300
フジインコーポレーテッド	7,900	3,025.00	23,897,500
クニミネ工業	2,300	1,018.00	2,341,400
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,175.00	2,232,500
ニチアス	24,000	2,944.00	70,656,000
ニチハ	13,300	2,978.00	39,607,400
新日鐵住金	389,700	2,398.50	934,695,450
神戸製鋼所	159,400	1,015.00	161,791,000
中山製鋼所	12,100	724.00	8,760,400
合同製鐵	4,700	2,308.00	10,847,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	235,100	2,607.50	613,023,250
日新製鋼	24,000	1,701.00	40,824,000
東京製鐵	46,600	835.00	38,911,000
共英製鋼	9,800	2,245.00	22,001,000
大和工業	18,500	3,525.00	65,212,500
東京鐵鋼	3,600	1,847.00	6,649,200
大阪製鐵	5,800	2,207.00	12,800,600
淀川製鋼所	12,700	2,808.00	35,661,600
丸一鋼管	30,800	3,690.00	113,652,000
モリ工業	2,800	3,080.00	8,624,000
大同特殊鋼	15,400	5,520.00	85,008,000
日本高周波鋼業	3,300	779.00	2,570,700
日本冶金工業	72,400	331.00	23,964,400
山陽特殊製鋼	10,100	2,774.00	28,017,400
愛知製鋼	4,900	4,250.00	20,825,000
日立金属	93,800	1,411.00	132,351,800
日本金属	2,200	1,758.00	3,867,600
大平洋金属	5,400	4,255.00	22,977,000

新日本電工	52,100	295.00	15,369,500
栗本鐵工所	4,400	1,881.00	8,276,400
虹技	1,300	1,861.00	2,419,300
日本鑄鉄管	900	1,570.00	1,413,000
三菱製鋼	6,400	2,231.00	14,278,400
日亜鋼業	12,800	349.00	4,467,200
日本精線	1,400	4,215.00	5,901,000
エンビプロ・ホールディングス	1,800	797.00	1,434,600
シンニッタン	13,700	482.00	6,603,400
新家工業	2,000	2,016.00	4,032,000
大紀アルミニウム工業所	14,500	777.00	11,266,500
日本軽金属ホールディングス	254,800	253.00	64,464,400
三井金属鉱業	23,500	3,410.00	80,135,000
東邦亜鉛	4,900	4,470.00	21,903,000
三菱マテリアル	57,600	3,425.00	197,280,000
住友金属鉱山	111,300	3,902.00	434,292,600
D O W Aホールディングス	22,100	3,660.00	80,886,000
古河機械金属	14,500	1,701.00	24,664,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,100	1,800.00	16,380,000
東邦チタニウム	15,800	1,370.00	21,646,000
U A C J	13,300	2,700.00	35,910,000
C Kサンエツ	1,700	3,645.00	6,196,500
古河電気工業	29,000	3,895.00	112,955,000
住友電気工業	325,600	1,740.00	566,544,000
フジクラ	105,400	536.00	56,494,400
昭和電線ホールディングス	11,000	805.00	8,855,000
東京特殊電線	1,200	2,226.00	2,671,200
タツタ電線	17,500	616.00	10,780,000
カナレ電気	1,500	2,123.00	3,184,500
平河ヒューテック	4,400	1,812.00	7,972,800
リョービ	10,700	4,410.00	47,187,000
アーレスティ	10,900	855.00	9,319,500
アサヒホールディングス	15,000	2,065.00	30,975,000
稲葉製作所	4,900	1,397.00	6,845,300
宮地エンジニアリンググループ	2,500	2,986.00	7,465,000
トーカロ	24,300	1,173.00	28,503,900
アルファC o	3,100	1,480.00	4,588,000
S U M C O	96,200	1,682.00	161,808,400
川田テクノロジーズ	1,800	6,770.00	12,186,000
R S Technologies	1,700	5,520.00	9,384,000
東洋製罐グループホールディングス	55,500	2,354.00	130,647,000
ホッカンホールディングス	4,400	2,285.00	10,054,000

コロナ	4,900	1,274.00	6,242,600
横河ブリッジホールディングス	16,200	2,312.00	37,454,400
駒井ハルテック	1,900	2,418.00	4,594,200
高田機工	800	2,879.00	2,303,200
三和ホールディングス	83,500	1,358.00	113,393,000
文化シャッター	25,800	850.00	21,930,000
三協立山	12,100	1,445.00	17,484,500
アルインコ	6,300	1,097.00	6,911,100
東洋シャッター	2,200	689.00	1,515,800
LIXILグループ	128,400	2,196.00	281,966,400
日本フィルコン	6,700	611.00	4,093,700
ノーリツ	19,500	1,796.00	35,022,000
長府製作所	8,900	2,599.00	23,131,100
リンナイ	15,500	8,510.00	131,905,000
ダイニチ工業	4,800	801.00	3,844,800
日東精工	12,100	732.00	8,857,200
三洋工業	1,100	2,189.00	2,407,900
岡部	17,800	1,113.00	19,811,400
ジーテクト	9,600	1,874.00	17,990,400
東プレ	16,300	2,832.00	46,161,600
高周波熱錬	16,900	1,175.00	19,857,500
東京製網	6,200	1,493.00	9,256,600
サンコール	5,000	797.00	3,985,000
モリテック スチール	6,800	601.00	4,086,800
パイオラックス	12,900	2,517.00	32,469,300
エイチワン	8,600	1,422.00	12,229,200
日本発條	86,800	1,182.00	102,597,600
中央発條	1,100	3,840.00	4,224,000
アドバネクス	1,400	2,138.00	2,993,200
立川ブラインド工業	3,900	1,187.00	4,629,300
三益半導体工業	6,800	1,768.00	12,022,400
日本ドライケミカル	2,400	1,262.00	3,028,800
日本製鋼所	28,500	2,808.00	80,028,000
三浦工業	37,700	3,570.00	134,589,000
タクマ	29,700	1,505.00	44,698,500
ツガミ	23,000	1,142.00	26,266,000
オークマ	10,200	6,400.00	65,280,000
東芝機械	9,900	2,570.00	25,443,000
アマダホールディングス	134,600	1,218.00	163,942,800
アイダエンジニアリング	22,500	1,018.00	22,905,000
滝澤鉄工所	2,700	1,798.00	4,854,600
F U J I	26,100	1,818.00	47,449,800

牧野フライス製作所	8,900	4,885.00	43,476,500
オーエスジー	43,000	2,594.00	111,542,000
ダイジェット工業	1,200	1,952.00	2,342,400
旭ダイヤモンド工業	26,300	800.00	21,040,000
D M G 森精機	55,200	1,921.00	106,039,200
ソディック	19,000	1,030.00	19,570,000
ディスコ	11,800	19,410.00	229,038,000
日東工器	5,400	2,613.00	14,110,200
日進工具	2,300	2,974.00	6,840,200
パンチ工業	7,400	796.00	5,890,400
富士ダイス	4,400	946.00	4,162,400
豊和工業	5,100	965.00	4,921,500
O K K	3,600	1,144.00	4,118,400
東洋機械金属	6,800	760.00	5,168,000
島精機製作所	11,100	5,030.00	55,833,000
オプトラン	8,500	3,050.00	25,925,000
N C ホールディングス	2,900	697.00	2,021,300
フリー	6,200	968.00	6,001,600
ヤマシンフィルタ	13,200	859.00	11,338,800
日阪製作所	12,500	1,179.00	14,737,500
やまびこ	16,900	1,415.00	23,913,500
平田機工	3,200	8,400.00	26,880,000
ペガサスミシン製造	8,100	1,032.00	8,359,200
ナプテスコ	48,000	3,080.00	147,840,000
三井海洋開発	9,300	3,690.00	34,317,000
レオン自動機	7,800	2,057.00	16,044,600
S M C	27,600	37,120.00	1,024,512,000
新川	5,900	625.00	3,687,500
ホソカワミクロン	3,100	6,200.00	19,220,000
ユニオンツール	3,800	4,245.00	16,131,000
オイレス工業	11,300	2,469.00	27,899,700
日精エー・エス・ビー機械	2,500	4,705.00	11,762,500
サトーホールディングス	11,500	3,735.00	42,952,500
技研製作所	6,000	2,977.00	17,862,000
日本エアーテック	2,700	787.00	2,124,900
カワタ	1,800	2,426.00	4,366,800
日精樹脂工業	7,600	1,180.00	8,968,000
オカダアイヨン	2,900	1,864.00	5,405,600
ワイエイシイホールディングス	3,000	839.00	2,517,000
小松製作所	425,200	3,422.00	1,455,034,400
住友重機械工業	50,500	4,075.00	205,787,500
日立建機	41,200	3,805.00	156,766,000

日工	2,500	2,448.00	6,120,000
巴工業	3,700	2,302.00	8,517,400
井関農機	8,900	2,076.00	18,476,400
TOWA	6,800	1,093.00	7,432,400
丸山製作所	2,100	1,836.00	3,855,600
北川鉄工所	4,300	3,060.00	13,158,000
ローツェ	4,300	2,362.00	10,156,600
タカキタ	3,000	791.00	2,373,000
クボタ	472,400	1,936.50	914,802,600
荏原実業	2,700	2,253.00	6,083,100
三菱化工機	3,200	1,958.00	6,265,600
月島機械	17,600	1,532.00	26,963,200
帝国電機製作所	6,100	1,671.00	10,193,100
新東工業	21,200	1,150.00	24,380,000
澁谷工業	7,800	4,250.00	33,150,000
アイチ コーポレーション	15,800	626.00	9,890,800
小森コーポレーション	22,300	1,397.00	31,153,100
鶴見製作所	7,500	1,896.00	14,220,000
住友精密工業	1,500	3,980.00	5,970,000
酒井重工業	1,700	3,695.00	6,281,500
荏原製作所	39,100	3,925.00	153,467,500
石井鐵工所	1,500	1,836.00	2,754,000
西島製作所	9,200	1,095.00	10,074,000
北越工業	9,900	1,343.00	13,295,700
ダイキン工業	120,200	15,255.00	1,833,651,000
オルガノ	3,200	3,175.00	10,160,000
トーヨーカネツ	3,700	2,840.00	10,508,000
栗田工業	47,700	3,235.00	154,309,500
椿本チエイン	10,500	5,250.00	55,125,000
大同工業	4,100	1,156.00	4,739,600
木村化工機	7,900	456.00	3,602,400
アネスト岩田	14,900	1,153.00	17,179,700
ダイフク	44,800	5,880.00	263,424,000
サムコ	2,500	1,414.00	3,535,000
加藤製作所	4,200	3,415.00	14,343,000
油研工業	1,800	2,405.00	4,329,000
タダノ	42,700	1,329.00	56,748,300
フジテック	27,100	1,538.00	41,679,800
C K D	24,500	1,512.00	37,044,000
キトー	6,700	2,107.00	14,116,900
平和	27,300	2,522.00	68,850,600
理想科学工業	8,700	2,703.00	23,516,100



SANKYO	22,000	4,365.00	96,030,000
日本金銭機械	8,200	1,267.00	10,389,400
マースグループホールディングス	5,600	2,434.00	13,630,400
福島工業	5,400	5,690.00	30,726,000
オーイズミ	3,800	512.00	1,945,600
ダイコク電機	4,000	1,778.00	7,112,000
竹内製作所	14,700	3,060.00	44,982,000
アマノ	27,200	2,395.00	65,144,000
JUKI	12,300	1,435.00	17,650,500
サンデンホールディングス	10,700	1,566.00	16,756,200
蛇の目ミシン工業	8,000	705.00	5,640,000
マックス	13,500	1,717.00	23,179,500
グローリー	26,300	2,860.00	75,218,000
新晃工業	8,900	1,844.00	16,411,600
大和冷機工業	12,800	1,237.00	15,833,600
セガサミーホールディングス	87,300	1,652.00	144,219,600
日本ピストンリング	3,200	2,345.00	7,504,000
リケン	4,100	6,330.00	25,953,000
T P R	9,900	2,974.00	29,442,600
ツバキ・ナカシマ	13,300	2,374.00	31,574,200
ホシザキ	25,700	11,380.00	292,466,000
大豊工業	7,300	1,321.00	9,643,300
日本精工	180,800	1,321.00	238,836,800
NTN	203,800	473.00	96,397,400
ジェイテクト	93,800	1,737.00	162,930,600
不二越	8,200	5,680.00	46,576,000
日本トムソン	28,100	765.00	21,496,500
THK	54,900	2,966.00	162,833,400
ユーシン精機	7,900	1,243.00	9,819,700
前澤給装工業	3,400	1,964.00	6,677,600
イーグル工業	10,900	1,481.00	16,142,900
前澤工業	6,500	462.00	3,003,000
日本ピラー工業	8,900	1,624.00	14,453,600
キッツ	35,700	986.00	35,200,200
マキタ	114,800	5,590.00	641,732,000
日立造船	70,300	475.00	33,392,500
三菱重工業	147,600	4,389.00	647,816,400
I H I	67,700	4,305.00	291,448,500
スター精密	14,100	2,061.00	29,060,100
日清紡ホールディングス	57,500	1,353.00	77,797,500
イビデン	54,100	1,606.00	86,884,600
コニカミノルタ	206,400	1,234.00	254,697,600

ブラザー工業	107,700	2,278.00	245,340,600
ミネベアミツミ	163,600	2,055.00	336,198,000
日立製作所	422,900	3,830.00	1,619,707,000
三菱電機	880,700	1,566.00	1,379,176,200
富士電機	53,100	4,560.00	242,136,000
東洋電機製造	3,700	1,774.00	6,563,800
安川電機	102,200	3,525.00	360,255,000
シンフォニアテクノロジー	11,600	1,701.00	19,731,600
明電舎	15,100	1,897.00	28,644,700
オリジン電気	2,800	1,771.00	4,958,800
山洋電気	4,300	5,520.00	23,736,000
デンヨー	8,300	1,891.00	15,695,300
東芝テック	12,700	3,350.00	42,545,000
芝浦メカトロニクス	1,400	3,905.00	5,467,000
マブチモーター	24,400	4,560.00	111,264,000
日本電産	106,000	16,320.00	1,729,920,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,800	2,217.00	8,424,600
トレックス・セミコンダクター	2,700	1,576.00	4,255,200
東光高岳	4,700	1,756.00	8,253,200
ダブル・スコープ	13,300	1,123.00	14,935,900
ダイヘン	9,800	2,878.00	28,204,400
ヤーマン	12,900	2,312.00	29,824,800
JVCケンウッド	69,300	320.00	22,176,000
ミマキエンジニアリング	8,200	1,169.00	9,585,800
第一精工	3,900	1,659.00	6,470,100
日新電機	21,100	1,025.00	21,627,500
大崎電気工業	19,400	862.00	16,722,800
オムロン	93,700	4,935.00	462,409,500
日東工業	14,300	2,090.00	29,887,000
I D E C	11,100	2,474.00	27,461,400
不二電機工業	1,300	1,385.00	1,800,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	31,800	2,722.00	86,559,600
サクサホールディングス	2,400	2,238.00	5,371,200
メルコホールディングス	4,300	4,090.00	17,587,000
テクノメディカ	1,800	2,130.00	3,834,000
日本電気	114,000	3,105.00	353,970,000
富士通	90,600	8,003.00	725,071,800
沖電気工業	36,000	1,478.00	53,208,000
岩崎通信機	3,900	788.00	3,073,200
電気興業	5,100	3,245.00	16,549,500
サンケン電気	10,400	2,992.00	31,116,800
ナカヨ	1,900	1,641.00	3,117,900

アイホン	5,200	1,685.00	8,762,000
ルネサスエレクトロニクス	91,700	730.00	66,941,000
セイコーエプソン	131,300	1,942.00	254,984,600
ワコム	69,100	481.00	33,237,100
アルバック	20,300	4,380.00	88,914,000
アクセル	4,200	696.00	2,923,200
E I Z O	8,200	5,130.00	42,066,000
日本信号	24,700	1,155.00	28,528,500
京三製作所	21,400	603.00	12,904,200
能美防災	11,800	2,535.00	29,913,000
ホーチキ	6,600	1,652.00	10,903,200
星和電機	3,900	484.00	1,887,600
エレコム	7,900	2,899.00	22,902,100
パナソニック	1,006,100	1,335.50	1,343,646,550
シャープ	87,300	2,300.00	200,790,000
アンリツ	64,400	1,928.00	124,163,200
富士通ゼネラル	27,100	1,953.00	52,926,300
ソニー	590,100	6,879.00	4,059,297,900
T D K	46,100	12,430.00	573,023,000
帝国通信工業	4,300	1,296.00	5,572,800
タムラ製作所	34,400	716.00	24,630,400
アルプス電気	76,000	2,921.00	221,996,000
池上通信機	2,800	1,371.00	3,838,800
日本電波工業	7,800	509.00	3,970,200
鈴木	4,800	831.00	3,988,800
日本トリム	2,000	5,860.00	11,720,000
ローランド ディー . ジー .	4,600	2,741.00	12,608,600
フォスター電機	10,600	1,457.00	15,444,200
クラリオン	9,500	1,766.00	16,777,000
S M K	2,400	3,105.00	7,452,000
ヨコオ	6,000	1,468.00	8,808,000
ホシデン	22,700	1,117.00	25,355,900
ヒロセ電機	14,400	12,580.00	181,152,000
日本航空電子工業	23,000	1,926.00	44,298,000
T O A	9,800	1,298.00	12,720,400
マクセルホールディングス	17,700	1,793.00	31,736,100
古野電気	10,700	1,492.00	15,964,400
ユニデンホールディングス	2,600	2,869.00	7,459,400
アルパイン	21,200	2,168.00	45,961,600
スミダコーポレーション	7,800	1,460.00	11,388,000
アイコム	5,000	2,424.00	12,120,000
リオン	3,800	2,517.00	9,564,600

本多通信工業	7,300	811.00	5,920,300
横河電機	88,300	2,451.00	216,423,300
新電元工業	3,200	5,390.00	17,248,000
アズビル	52,900	2,469.00	130,610,100
東亜ディーケーケー	4,600	1,433.00	6,591,800
日本光電工業	36,500	3,600.00	131,400,000
チノー	3,300	1,606.00	5,299,800
共和電業	10,400	449.00	4,669,600
日本電子材料	4,000	906.00	3,624,000
堀場製作所	17,500	6,160.00	107,800,000
アドバンテスト	49,300	2,453.00	120,932,900
小野測器	4,600	876.00	4,029,600
エスベック	8,000	2,153.00	17,224,000
キーエンス	43,200	66,520.00	2,873,664,000
日置電機	4,700	3,760.00	17,672,000
シスメックス	68,600	9,670.00	663,362,000
日本マイクロニクス	14,700	811.00	11,921,700
メガチップス	7,100	2,425.00	17,217,500
O B A R A G R O U P	5,200	5,570.00	28,964,000
澤藤電機	1,100	2,296.00	2,525,600
コーセル	12,500	1,329.00	16,612,500
イリソ電子工業	7,500	5,960.00	44,700,000
オブテックスグループ	15,600	2,241.00	34,959,600
千代田インテグレ	3,900	2,392.00	9,328,800
アイ・オー・データ機器	4,000	1,365.00	5,460,000
レーザーテック	18,100	3,820.00	69,142,000
スタンレー電気	67,300	3,895.00	262,133,500
岩崎電気	3,700	1,626.00	6,016,200
ウシオ電機	53,700	1,557.00	83,610,900
岡谷電機産業	7,000	538.00	3,766,000
ヘリオス テクノ ホールディング	8,000	924.00	7,392,000
日本セラミック	9,100	3,045.00	27,709,500
遠藤照明	5,000	852.00	4,260,000
古河電池	6,700	896.00	6,003,200
双信電機	4,700	517.00	2,429,900
山一電機	6,600	1,594.00	10,520,400
図研	5,900	1,853.00	10,932,700
日本電子	16,200	2,479.00	40,159,800
カシオ計算機	71,000	1,855.00	131,705,000
ファナック	83,700	21,725.00	1,818,382,500
日本シイエムケイ	15,900	862.00	13,705,800
エンプラス	4,100	3,250.00	13,325,000

大真空	3,600	1,344.00	4,838,400
ローム	39,600	8,360.00	331,056,000
浜松ホトニクス	63,200	4,495.00	284,084,000
三井ハイテック	11,800	1,493.00	17,617,400
新光電気工業	33,800	961.00	32,481,800
京セラ	144,600	6,871.00	993,546,600
太陽誘電	42,900	2,600.00	111,540,000
村田製作所	92,400	17,675.00	1,633,170,000
ユーシン	13,500	792.00	10,692,000
双葉電子工業	14,600	2,042.00	29,813,200
北陸電気工業	3,900	1,289.00	5,027,100
ニチコン	28,000	1,117.00	31,276,000
日本ケミコン	7,100	3,260.00	23,146,000
K O A	12,400	1,975.00	24,490,000
市光工業	13,600	950.00	12,920,000
小糸製作所	52,800	7,410.00	391,248,000
ミツバ	16,700	1,049.00	17,518,300
S C R E E Nホールディングス	16,700	6,940.00	115,898,000
キャノン電子	8,200	2,389.00	19,589,800
キャノン	474,100	3,632.00	1,721,931,200
リコー	265,000	1,249.00	330,985,000
象印マホービン	16,600	1,545.00	25,647,000
M U T O Hホールディングス	1,400	2,380.00	3,332,000
東京エレクトロン	58,700	15,955.00	936,558,500
トヨタ紡織	25,700	2,152.00	55,306,400
芦森工業	1,800	2,308.00	4,154,400
ユニプレス	17,100	2,219.00	37,944,900
豊田自動織機	71,300	6,580.00	469,154,000
モリタホールディングス	14,100	2,557.00	36,053,700
三櫻工業	11,300	768.00	8,678,400
デンソー	195,400	5,923.00	1,157,354,200
東海理化電機製作所	23,200	2,385.00	55,332,000
三井E & Sホールディングス	31,800	2,053.00	65,285,400
川崎重工業	68,500	3,220.00	220,570,000
名村造船所	26,400	597.00	15,760,800
日本車輛製造	3,200	3,080.00	9,856,000
三菱ロジスネクスト	10,500	1,489.00	15,634,500
近畿車輛	1,100	2,522.00	2,774,200
日産自動車	1,038,400	1,051.50	1,091,877,600
いすゞ自動車	255,100	1,776.50	453,185,150
トヨタ自動車	1,070,400	7,060.00	7,557,024,000
日野自動車	125,700	1,244.00	156,370,800

三菱自動車工業	325,900	795.00	259,090,500
エフテック	5,800	1,330.00	7,714,000
レシップホールディングス	3,100	817.00	2,532,700
G M B	1,500	1,324.00	1,986,000
ファルテック	1,500	1,071.00	1,606,500
武蔵精密工業	18,800	1,826.00	34,328,800
日産車体	34,400	1,031.00	35,466,400
新明和工業	38,300	1,526.00	58,445,800
極東開発工業	16,400	1,798.00	29,487,200
日信工業	17,900	1,921.00	34,385,900
トピー工業	7,300	3,365.00	24,564,500
ティラド	3,200	3,125.00	10,000,000
曙ブレーキ工業	41,400	257.00	10,639,800
タチエス	15,000	1,671.00	25,065,000
N O K	47,400	1,927.00	91,339,800
フタバ産業	27,000	827.00	22,329,000
K Y B	9,200	5,180.00	47,656,000
大同メタル工業	11,600	934.00	10,834,400
プレス工業	47,100	602.00	28,354,200
ミクニ	11,300	759.00	8,576,700
太平洋工業	18,500	1,884.00	34,854,000
ケーヒン	20,300	2,351.00	47,725,300
河西工業	11,000	1,191.00	13,101,000
アイシン精機	72,500	5,280.00	382,800,000
マツダ	276,300	1,358.50	375,353,550
今仙電機製作所	8,200	1,179.00	9,667,800
本田技研工業	792,300	3,434.00	2,720,758,200
スズキ	174,500	6,480.00	1,130,760,000
S U B A R U	273,300	3,407.00	931,133,100
安永	4,300	2,048.00	8,806,400
ヤマハ発動機	124,300	3,145.00	390,923,500
ショーワ	22,900	1,710.00	39,159,000
T B K	10,600	504.00	5,342,400
エクセディ	10,600	3,785.00	40,121,000
豊田合成	32,000	2,776.00	88,832,000
愛三工業	15,700	989.00	15,527,300
盟和産業	1,400	1,255.00	1,757,000
日本プラスト	4,900	1,060.00	5,194,000
ヨロズ	8,900	1,747.00	15,548,300
エフ・シー・シー	14,400	3,375.00	48,600,000
シマノ	35,500	17,800.00	631,900,000
テイ・エス テック	20,500	3,940.00	80,770,000

ジャムコ	4,400	3,275.00	14,410,000
テルモ	135,000	6,820.00	920,700,000
クリエートメディック	3,000	1,269.00	3,807,000
日機装	28,400	1,511.00	42,912,400
島津製作所	105,200	3,560.00	374,512,000
JMS	8,300	651.00	5,403,300
長野計器	7,000	1,201.00	8,407,000
ブイ・テクノロジー	2,100	17,060.00	35,826,000
東京計器	5,700	1,200.00	6,840,000
愛知時計電機	1,200	4,670.00	5,604,000
インターアクション	4,700	1,770.00	8,319,000
オーバル	8,700	311.00	2,705,700
東京精密	15,900	3,015.00	47,938,500
マニー	10,700	5,520.00	59,064,000
ニコン	153,400	2,152.00	330,116,800
トプコン	47,300	2,145.00	101,458,500
オリンパス	131,200	4,370.00	573,344,000
理研計器	8,400	2,429.00	20,403,600
タムロン	7,800	2,400.00	18,720,000
HOYA	177,300	6,757.00	1,198,016,100
シード	3,700	2,010.00	7,437,000
ノーリツ鋼機	8,900	3,210.00	28,569,000
エー・アンド・デイ	8,000	1,047.00	8,376,000
シチズン時計	105,100	755.00	79,350,500
リズム時計工業	3,000	2,167.00	6,501,000
大研医器	8,000	844.00	6,752,000
メニコン	12,100	2,706.00	32,742,600
シンシア	1,300	637.00	828,100
松風	4,400	1,378.00	6,063,200
セイコーホールディングス	13,600	3,140.00	42,704,000
ニプロ	60,900	1,552.00	94,516,800
中本パックス	2,200	1,868.00	4,109,600
スノーピーク	3,100	1,829.00	5,669,900
パラマウントベッドホールディングス	9,300	5,570.00	51,801,000
トランザクション	4,800	773.00	3,710,400
SHO-BI	2,600	389.00	1,011,400
ニホンフラッシュ	4,100	2,281.00	9,352,100
前田工織	9,700	2,407.00	23,347,900
永大産業	11,500	517.00	5,945,500
アートネイチャー	9,500	707.00	6,716,500
バンダイナムコホールディングス	91,000	4,350.00	395,850,000
アイフィスジャパン	1,900	779.00	1,480,100

共立印刷	14,600	342.00	4,993,200
S H O E I	4,200	4,930.00	20,706,000
フランスベッドホールディングス	10,300	977.00	10,063,100
パイロットコーポレーション	15,400	6,880.00	105,952,000
萩原工業	4,900	1,908.00	9,349,200
トッパン・フォームズ	19,000	1,072.00	20,368,000
フジシールインターナショナル	19,700	4,000.00	78,800,000
タカラトミー	37,000	1,166.00	43,142,000
廣済堂	8,300	521.00	4,324,300
エステールホールディングス	2,500	780.00	1,950,000
アーク	44,800	114.00	5,107,200
タカノ	3,900	1,011.00	3,942,900
プロネクサス	7,700	1,213.00	9,340,100
ホクシン	5,900	172.00	1,014,800
ウッドワン	3,000	1,303.00	3,909,000
大建工業	6,900	2,227.00	15,366,300
凸版印刷	124,300	1,828.00	227,220,400
大日本印刷	115,200	2,655.00	305,856,000
図書印刷	5,900	798.00	4,708,200
共同印刷	2,700	2,950.00	7,965,000
N I S S H A	18,100	2,208.00	39,964,800
光村印刷	800	2,383.00	1,906,400
宝印刷	4,600	1,942.00	8,933,200
アシックス	87,400	1,669.00	145,870,600
ツツミ	2,700	2,167.00	5,850,900
小松ウオール工業	3,000	2,203.00	6,609,000
ヤマハ	57,600	5,840.00	336,384,000
河合楽器製作所	3,000	5,190.00	15,570,000
クリナップ	8,300	811.00	6,731,300
ピジョン	53,200	6,430.00	342,076,000
兼松サステック	700	1,935.00	1,354,500
キングジム	7,300	993.00	7,248,900
リンテック	20,900	2,953.00	61,717,700
イトーキ	16,200	655.00	10,611,000
任天堂	54,200	42,040.00	2,278,568,000
三菱鉛筆	14,500	2,074.00	30,073,000
タカラスタANDARD	18,200	1,945.00	35,399,000
コクヨ	42,200	2,042.00	86,172,400
ナカバヤシ	8,800	671.00	5,904,800
グローブライド	3,900	3,040.00	11,856,000
オカムラ	30,700	1,517.00	46,571,900
美津濃	8,700	2,860.00	24,882,000



東京電力ホールディングス	702,900	548.00	385,189,200	
中部電力	269,400	1,714.00	461,751,600	
関西電力	359,300	1,704.00	612,247,200	
中国電力	121,700	1,455.00	177,073,500	
北陸電力	86,200	1,150.00	99,130,000	
東北電力	206,200	1,534.00	316,310,800	
四国電力	79,300	1,472.00	116,729,600	
九州電力	194,400	1,372.00	266,716,800	
北海道電力	88,300	714.00	63,046,200	
沖縄電力	17,800	2,366.00	42,114,800	
電源開発	70,100	3,115.00	218,361,500	
エフオン	5,400	1,323.00	7,144,200	
イーレックス	13,900	1,032.00	14,344,800	
レノバ	9,100	1,350.00	12,285,000	
東京瓦斯	185,100	2,785.50	515,596,050	
大阪瓦斯	170,900	2,208.50	377,432,650	
東邦瓦斯	43,600	4,270.00	186,172,000	
北海道瓦斯	4,700	1,535.00	7,214,500	
広島ガス	18,400	377.00	6,936,800	
西部瓦斯	10,700	2,664.00	28,504,800	
静岡ガス	27,200	1,015.00	27,608,000	
メタウォーター	5,000	3,230.00	16,150,000	
SBSホールディングス	8,700	1,576.00	13,711,200	
東武鉄道	92,900	3,305.00	307,034,500	
相鉄ホールディングス	28,200	3,755.00	105,891,000	
東京急行電鉄	239,100	2,053.00	490,872,300	
京浜急行電鉄	120,600	2,026.00	244,335,600	
小田急電鉄	131,000	2,651.00	347,281,000	
京王電鉄	49,200	6,130.00	301,596,000	
京成電鉄	61,300	3,930.00	240,909,000	
富士急行	12,000	3,505.00	42,060,000	
新京成電鉄	2,300	2,253.00	5,181,900	
東日本旅客鉄道	156,600	10,335.00	1,618,461,000	
西日本旅客鉄道	78,900	7,770.00	613,053,000	
東海旅客鉄道	78,800	23,610.00	1,860,468,000	
西武ホールディングス	112,200	2,020.00	226,644,000	
鴻池運輸	12,500	1,933.00	24,162,500	
西日本鉄道	24,400	3,010.00	73,444,000	
ハマキョウレックス	6,200	4,175.00	25,885,000	
サカイ引越センター	4,600	6,360.00	29,256,000	
近鉄グループホールディングス	83,400	4,470.00	372,798,000	
阪急阪神ホールディングス	111,200	3,975.00	442,020,000	

南海電気鉄道	39,500	2,869.00	113,325,500
京阪ホールディングス	37,100	4,310.00	159,901,000
神戸電鉄	2,000	4,025.00	8,050,000
名古屋鉄道	66,800	2,790.00	186,372,000
山陽電気鉄道	6,400	2,474.00	15,833,600
日本通運	32,700	7,360.00	240,672,000
ヤマトホールディングス	146,200	3,405.00	497,811,000
山九	21,400	6,350.00	135,890,000
丸運	4,500	348.00	1,566,000
丸全昭和運輸	6,000	2,929.00	17,574,000
センコーグループホールディングス	50,100	930.00	46,593,000
トナミホールディングス	2,000	7,010.00	14,020,000
ニッコンホールディングス	31,700	2,915.00	92,405,500
日本石油輸送	1,000	2,954.00	2,954,000
福山通運	12,200	4,850.00	59,170,000
セイノーホールディングス	62,400	1,700.00	106,080,000
エスライン	2,300	1,231.00	2,831,300
神奈川中央交通	2,100	3,810.00	8,001,000
日立物流	18,300	3,150.00	57,645,000
丸和運輸機関	4,400	4,235.00	18,634,000
C & F ロジホールディングス	9,100	1,396.00	12,703,600
九州旅客鉄道	70,000	3,425.00	239,750,000
S Gホールディングス	78,800	3,020.00	237,976,000
日本郵船	70,000	2,128.00	148,960,000
商船三井	52,900	3,315.00	175,363,500
川崎汽船	38,800	2,266.00	87,920,800
N S ユナイテッド海運	4,200	2,613.00	10,974,600
飯野海運	43,800	573.00	25,097,400
共栄タンカー	900	1,934.00	1,740,600
乾汽船	6,400	913.00	5,843,200
日本航空	152,700	4,038.00	616,602,600
A N Aホールディングス	161,900	3,917.00	634,162,300
パスコ	1,600	1,384.00	2,214,400
トランコム	2,300	8,230.00	18,929,000
日新	7,200	2,604.00	18,748,800
三菱倉庫	28,900	2,934.00	84,792,600
三井倉庫ホールディングス	9,500	2,025.00	19,237,500
住友倉庫	28,900	1,495.00	43,205,500
澁澤倉庫	4,600	1,780.00	8,188,000
東陽倉庫	15,000	355.00	5,325,000
日本トランスシティ	20,200	525.00	10,605,000
ケイヒン	1,600	1,615.00	2,584,000

中央倉庫	5,200	1,274.00	6,624,800
川西倉庫	1,700	1,687.00	2,867,900
安田倉庫	7,600	917.00	6,969,200
東洋埠頭	2,500	1,701.00	4,252,500
宇徳	7,100	544.00	3,862,400
上組	51,400	2,477.00	127,317,800
サンリツ	2,100	772.00	1,621,200
キムラユニティー	2,300	1,195.00	2,748,500
キューソー流通システム	2,100	2,908.00	6,106,800
近鉄エクスプレス	15,700	2,178.00	34,194,600
東海運	4,500	331.00	1,489,500
エーアイティー	5,900	1,049.00	6,189,100
内外トランスライン	2,600	1,800.00	4,680,000
日本コンセプト	2,300	1,216.00	2,796,800
N E C ネットズエスアイ	9,600	2,589.00	24,854,400
システナ	27,800	1,600.00	44,480,000
デジタルアーツ	4,300	5,350.00	23,005,000
新日鉄住金ソリューションズ	13,000	3,690.00	47,970,000
キューブシステム	5,200	958.00	4,981,600
エイジア	1,900	1,510.00	2,869,000
コア	3,800	1,410.00	5,358,000
ソリトンシステムズ	5,100	1,058.00	5,395,800
ソフトクリエイティブホールディングス	4,200	1,739.00	7,303,800
T I S	28,800	5,740.00	165,312,000
ネオス	2,600	945.00	2,457,000
電算システム	3,400	2,242.00	7,622,800
グリー	46,900	537.00	25,185,300
コーエーテクモホールディングス	17,780	1,969.00	35,008,820
三菱総合研究所	3,400	4,385.00	14,909,000
電算	1,000	2,244.00	2,244,000
A G S	5,100	804.00	4,100,400
ファインデックス	7,600	775.00	5,890,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,100	1,813.00	3,807,300
ブレインパッド	1,900	5,960.00	11,324,000
K L a b	15,500	1,135.00	17,592,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,300	2,953.00	18,603,900
イーブックイニシアティブジャパン	1,400	2,302.00	3,222,800
ネクソン	220,000	1,490.00	327,800,000
アイスタイル	22,200	1,376.00	30,547,200
エムアップ	2,900	2,759.00	8,001,100
エイチーム	5,500	1,946.00	10,703,000
テクノスジャパン	8,100	1,057.00	8,561,700

コロプラ	25,000	725.00	18,125,000	
ブロードリーフ	43,100	802.00	34,566,200	
クロス・マーケティンググループ	2,800	532.00	1,489,600	
デジタルハーツホールディングス	4,700	1,710.00	8,037,000	
メディアドゥホールディングス	2,900	2,612.00	7,574,800	
じげん	9,400	865.00	8,131,000	
サイバーリンクス	1,500	1,120.00	1,680,000	
フィックスターズ	8,400	1,611.00	13,532,400	
VOYAGE GROUP	4,700	1,598.00	7,510,600	
オブティム	1,500	5,170.00	7,755,000	
セレス	2,900	2,018.00	5,852,200	
ベリサーブ	1,200	5,010.00	6,012,000	
ティーガイア	8,700	2,963.00	25,778,100	
セック	1,200	5,400.00	6,480,000	
日本アジアグループ	9,300	430.00	3,999,000	
豆蔵ホールディングス	6,700	972.00	6,512,400	
テクマトリックス	4,300	2,305.00	9,911,500	
プロシップ	1,300	2,718.00	3,533,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	209,000	236.00	49,324,000	
GMOペイメントゲートウェイ	14,200	7,610.00	108,062,000	
ザッパラス	4,700	391.00	1,837,700	
システムリサーチ	1,200	4,920.00	5,904,000	
インターネットイニシアティブ	14,100	2,316.00	32,655,600	
さくらインターネット	10,600	727.00	7,706,200	
ヴィンクス	2,500	1,524.00	3,810,000	
GMOクラウド	2,000	4,345.00	8,690,000	
SRAホールディングス	4,600	3,450.00	15,870,000	
Minor iソリューションズ	1,800	1,461.00	2,629,800	
朝日ネット	8,200	523.00	4,288,600	
eBASE	2,400	1,902.00	4,564,800	
アバント	2,400	1,710.00	4,104,000	
アドソル日進	3,400	2,148.00	7,303,200	
フリービット	5,900	1,103.00	6,507,700	
コムチュア	4,400	4,390.00	19,316,000	
サイバーコム	1,600	2,112.00	3,379,200	
アステリア	4,500	1,111.00	4,999,500	
マークラインズ	3,100	2,018.00	6,255,800	
メディカル・データ・ビジョン	7,800	2,037.00	15,888,600	
gumi	10,000	654.00	6,540,000	
ショーケース・ティービー	2,000	1,012.00	2,024,000	
モバイルファクトリー	2,500	1,643.00	4,107,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,900	1,614.00	6,294,600	

P C Iホールディングス	1,600	2,997.00	4,795,200
パイプドHD	1,500	1,097.00	1,645,500
アイビーシー	1,500	1,880.00	2,820,000
ネオジャパン	2,200	1,099.00	2,417,800
P R T I M E S	600	3,185.00	1,911,000
ランドコンピュータ	1,000	1,199.00	1,199,000
オープンドア	3,500	3,185.00	11,147,500
マイネット	3,000	1,235.00	3,705,000
アカツキ	2,300	4,540.00	10,442,000
ベネフィットジャパン	600	1,015.00	609,000
U b i c o mホールディングス	1,400	1,372.00	1,920,800
L I N E	26,300	4,775.00	125,582,500
カナミックネットワーク	1,400	2,247.00	3,145,800
ノムラシステムコーポレーション	900	1,168.00	1,051,200
シンクロ・フード	3,200	890.00	2,848,000
オークネット	4,700	1,297.00	6,095,900
A O I T Y O H o l d i n g s	9,500	1,428.00	13,566,000
マクロミル	10,900	2,494.00	27,184,600
ビーグリー	1,800	1,448.00	2,606,400
オロ	900	6,030.00	5,427,000
ソルクシーズ	3,900	991.00	3,864,900
フェイス	3,200	1,315.00	4,208,000
ハイマックス	1,200	1,960.00	2,352,000
野村総合研究所	54,900	5,710.00	313,479,000
サイバネットシステム	7,300	747.00	5,453,100
C Eホールディングス	2,400	844.00	2,025,600
日本システム技術	1,500	2,566.00	3,849,000
インテージホールディングス	10,400	1,029.00	10,701,600
東邦システムサイエンス	3,100	876.00	2,715,600
ソースネクスト	13,000	1,221.00	15,873,000
F I G	8,300	337.00	2,797,100
フォーカスシステムズ	5,200	1,049.00	5,454,800
クレスコ	2,000	3,440.00	6,880,000
フジ・メディア・ホールディングス	89,700	2,008.00	180,117,600
オービック	27,200	10,790.00	293,488,000
ジャストシステム	14,100	2,640.00	37,224,000
T D Cソフト	7,800	1,111.00	8,665,800
ヤフー	623,500	411.00	256,258,500
トレンドマイクロ	46,000	7,480.00	344,080,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,800	1,726.00	4,832,800
日本オラクル	14,000	9,310.00	130,340,000
アルファシステムズ	2,900	2,934.00	8,508,600

フューチャー	11,800	1,833.00	21,629,400
C A C Holdings	6,600	1,152.00	7,603,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	2,810.00	10,397,000
トーセ	2,600	1,072.00	2,787,200
オービックビジネスコンサルタント	4,400	10,050.00	44,220,000
伊藤忠テクノソリューションズ	39,400	2,497.00	98,381,800
アイティフォー	10,600	1,030.00	10,918,000
東計電算	1,300	3,340.00	4,342,000
エクスネット	1,500	968.00	1,452,000
大塚商会	46,800	4,250.00	198,900,000
サイボウズ	10,400	696.00	7,238,400
ソフトブレーン	7,200	527.00	3,794,400
電通国際情報サービス	5,400	4,215.00	22,761,000
デジタルガレージ	15,600	3,730.00	58,188,000
E Mシステムズ	6,200	1,271.00	7,880,200
ウェザーニューズ	3,000	3,525.00	10,575,000
C I J	7,000	778.00	5,446,000
東洋ビジネスエンジニアリング	900	2,321.00	2,088,900
日本エンタープライズ	9,900	235.00	2,326,500
WOWOW	4,200	3,625.00	15,225,000
スカラ	7,200	1,207.00	8,690,400
I M A G I C A GROUP	7,700	667.00	5,135,900
ネットワンシステムズ	35,300	2,728.00	96,298,400
システムソフト	21,900	119.00	2,606,100
アルゴグラフィックス	4,000	4,855.00	19,420,000
マーベラス	14,800	931.00	13,778,800
エイベックス	16,100	1,631.00	26,259,100
日本ユニシス	24,000	3,045.00	73,080,000
兼松エレクトロニクス	5,500	3,790.00	20,845,000
東京放送ホールディングス	47,800	2,340.00	111,852,000
日本テレビホールディングス	79,400	1,951.00	154,909,400
朝日放送グループホールディングス	8,900	809.00	7,200,100
テレビ朝日ホールディングス	23,800	2,202.00	52,407,600
スカパーJ S A Tホールディングス	66,300	548.00	36,332,400
テレビ東京ホールディングス	7,100	2,823.00	20,043,300
日本BS放送	3,100	1,367.00	4,237,700
ビジョン	2,700	5,290.00	14,283,000
ワイヤレスゲート	4,100	665.00	2,726,500
コネクシオ	6,200	2,054.00	12,734,800
クロップス	2,000	712.00	1,424,000
日本電信電話	620,000	5,164.00	3,201,680,000
K D D I	761,400	3,159.00	2,405,262,600

光通信	10,200	22,170.00	226,134,000
N T T ドコモ	620,400	3,045.00	1,889,118,000
エムティーアイ	10,300	632.00	6,509,600
G M O インターネット	31,600	2,009.00	63,484,400
アйдママーケティングコミュニケーション	2,200	695.00	1,529,000
カドカワ	25,300	1,253.00	31,700,900
学研ホールディングス	2,900	5,900.00	17,110,000
ゼンリン	15,700	3,590.00	56,363,000
昭文社	4,300	677.00	2,911,100
インプレスホールディングス	6,900	177.00	1,221,300
アイネット	5,000	1,955.00	9,775,000
松竹	5,700	13,960.00	79,572,000
東宝	56,900	3,530.00	200,857,000
東映	3,200	13,720.00	43,904,000
エヌ・ティ・ティ・データ	268,500	1,588.00	426,378,000
ピー・シー・エー	1,400	1,932.00	2,704,800
ビジネスブレイン太田昭和	1,600	2,319.00	3,710,400
D T S	9,000	4,550.00	40,950,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,200	4,715.00	189,543,000
シーイーシー	10,300	2,735.00	28,170,500
カブコン	37,100	2,917.00	108,220,700
アイ・エス・ビー	1,800	2,194.00	3,949,200
ジャステック	5,100	1,241.00	6,329,100
S C S K	20,000	5,370.00	107,400,000
日本システムウエア	2,900	2,158.00	6,258,200
アイネス	11,100	1,310.00	14,541,000
T K C	7,300	4,655.00	33,981,500
富士ソフト	12,900	5,760.00	74,304,000
N S D	14,300	2,540.00	36,322,000
コナミホールディングス	35,300	4,460.00	157,438,000
福井コンピュータホールディングス	2,600	2,240.00	5,824,000
J B C C ホールディングス	6,900	1,538.00	10,612,200
ミロク情報サービス	7,700	2,586.00	19,912,200
ソフトバンクグループ	391,100	11,435.00	4,472,228,500
ハウスイ	700	1,094.00	765,800
高千穂交易	3,400	1,043.00	3,546,200
伊藤忠食品	2,100	5,890.00	12,369,000
エレマテック	4,100	2,702.00	11,078,200
J A L U X	2,500	2,874.00	7,185,000
あらた	4,400	5,540.00	24,376,000
トーメンデバイス	1,300	2,782.00	3,616,600
東京エレクトロン デバイス	3,200	1,918.00	6,137,600

フィールズ	6,600	919.00	6,065,400
双日	513,200	411.00	210,925,200
アルフレッサ ホールディングス	96,400	3,045.00	293,538,000
横浜冷凍	22,800	927.00	21,135,600
神栄	1,200	1,285.00	1,542,000
ラサ商事	3,900	1,022.00	3,985,800
ラクーン	5,200	614.00	3,192,800
アルコニックス	9,200	1,617.00	14,876,400
神戸物産	6,500	6,200.00	40,300,000
あい ホールディングス	13,900	2,625.00	36,487,500
ディーブイエックス	3,100	1,449.00	4,491,900
ダイワボウホールディングス	7,400	7,380.00	54,612,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,600	2,045.00	33,947,000
ラクト・ジャパン	1,900	7,720.00	14,668,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,400	1,256.00	20,598,400
八洲電機	6,700	917.00	6,143,900
メディアスホールディングス	4,900	897.00	4,395,300
U K Cホールディングス	5,600	2,631.00	14,733,600
ジューテックホールディングス	1,900	1,080.00	2,052,000
大光	2,100	721.00	1,514,100
O C H Iホールディングス	2,500	1,428.00	3,570,000
T O K A Iホールディングス	45,800	1,146.00	52,486,800
黒谷	1,500	516.00	774,000
C o m i n i x	1,300	937.00	1,218,100
三洋貿易	4,400	2,104.00	9,257,600
ビューティガレージ	1,200	2,457.00	2,948,400
ウイン・パートナーズ	6,400	1,292.00	8,268,800
ミタチ産業	2,100	873.00	1,833,300
シップヘルスケアホールディングス	18,100	4,350.00	78,735,000
明治電機工業	3,000	2,073.00	6,219,000
デリカフーズホールディングス	1,700	1,556.00	2,645,200
スターティアホールディングス	1,900	713.00	1,354,700
コメダホールディングス	16,200	2,303.00	37,308,600
富士興産	3,300	637.00	2,102,100
協栄産業	1,100	1,898.00	2,087,800
小野建	7,700	1,812.00	13,952,400
佐島電機	6,400	1,004.00	6,425,600
エコートレーディング	2,000	677.00	1,354,000
伯東	5,300	1,597.00	8,464,100
コンドーテック	6,800	1,135.00	7,718,000
中山福	5,100	704.00	3,590,400
ナガイレーベン	12,600	2,738.00	34,498,800



三菱食品	9,500	3,015.00	28,642,500
松田産業	6,300	1,596.00	10,054,800
第一興商	12,900	5,460.00	70,434,000
メディカルホールディングス	86,900	2,358.00	204,910,200
S P K	1,900	2,508.00	4,765,200
萩原電気ホールディングス	3,200	3,385.00	10,832,000
アズワン	6,800	8,340.00	56,712,000
スズデン	3,000	1,422.00	4,266,000
尾家産業	2,500	1,434.00	3,585,000
シモジマ	5,400	1,130.00	6,102,000
ドウシシャ	9,200	2,338.00	21,509,600
小津産業	1,900	2,086.00	3,963,400
高速	5,300	1,338.00	7,091,400
たけびし	3,000	1,724.00	5,172,000
リックス	2,000	1,718.00	3,436,000
丸文	7,700	826.00	6,360,200
ハピネット	5,900	1,795.00	10,590,500
橋本総業ホールディングス	1,800	1,624.00	2,923,200
日本ライフライン	24,700	2,401.00	59,304,700
タカショー	4,000	476.00	1,904,000
エクセル	2,900	1,788.00	5,185,200
マルカキカイ	2,800	2,177.00	6,095,600
I D O M	26,700	383.00	10,226,100
日本エム・ディ・エム	5,900	1,228.00	7,245,200
進和	5,100	2,201.00	11,225,100
エスケイジャパン	2,100	637.00	1,337,700
ダイترون	4,000	2,254.00	9,016,000
シークス	11,000	1,971.00	21,681,000
田中商事	2,600	701.00	1,822,600
オーハシテクニカ	4,900	1,634.00	8,006,600
白銅	3,100	1,995.00	6,184,500
伊藤忠商事	636,400	2,225.00	1,415,990,000
丸紅	712,600	1,046.50	745,735,900
高島	1,500	2,077.00	3,115,500
長瀬産業	52,300	2,000.00	104,600,000
蝶理	5,500	2,098.00	11,539,000
豊田通商	96,800	4,335.00	419,628,000
三共生興	15,000	479.00	7,185,000
兼松	37,000	1,719.00	63,603,000
ツカモトコーポレーション	1,600	1,249.00	1,998,400
三井物産	714,400	2,032.50	1,452,018,000
日本紙パルプ商事	4,500	4,745.00	21,352,500

日立ハイテクノロジーズ	30,100	4,040.00	121,604,000
カメイ	11,300	1,581.00	17,865,300
東都水産	1,300	2,331.00	3,030,300
OUGホールディングス	1,400	2,755.00	3,857,000
スターゼン	3,500	4,860.00	17,010,000
山善	33,900	1,360.00	46,104,000
椿本興業	2,000	3,455.00	6,910,000
住友商事	547,000	1,908.50	1,043,949,500
内田洋行	4,000	3,050.00	12,200,000
三菱商事	608,500	3,555.00	2,163,217,500
第一実業	3,900	4,090.00	15,951,000
キャノンマーケティングジャパン	24,800	2,392.00	59,321,600
西華産業	5,300	2,041.00	10,817,300
佐藤商事	7,900	1,228.00	9,701,200
菱洋エレクトロ	8,100	1,764.00	14,288,400
東京産業	8,800	811.00	7,136,800
ユアサ商事	8,200	4,100.00	33,620,000
神鋼商事	1,900	3,245.00	6,165,500
小林産業	5,500	344.00	1,892,000
阪和興業	16,200	3,795.00	61,479,000
正栄食品工業	4,600	4,200.00	19,320,000
カナデン	8,400	1,235.00	10,374,000
菱電商事	6,300	1,710.00	10,773,000
フルサト工業	4,800	1,882.00	9,033,600
岩谷産業	19,200	4,045.00	77,664,000
すてきナイスグループ	3,800	1,345.00	5,111,000
昭光通商	3,000	965.00	2,895,000
ニチモウ	1,400	1,681.00	2,353,400
極東貿易	2,500	2,217.00	5,542,500
イワキ	10,500	603.00	6,331,500
三愛石油	23,300	1,390.00	32,387,000
稲畑産業	20,800	1,766.00	36,732,800
G S Iクレオス	2,300	1,481.00	3,406,300
明和産業	8,000	498.00	3,984,000
ワキタ	18,500	1,413.00	26,140,500
東邦ホールディングス	25,700	2,945.00	75,686,500
サンゲツ	28,400	2,220.00	63,048,000
ミツウロコグループホールディングス	12,600	839.00	10,571,400
シナネンホールディングス	3,600	2,894.00	10,418,400
伊藤忠エネクス	19,300	1,152.00	22,233,600
サンリオ	24,400	2,308.00	56,315,200
サンワテクノス	5,600	1,417.00	7,935,200

リョーサン	9,600	4,125.00	39,600,000
新光商事	9,500	1,646.00	15,637,000
トーホー	3,900	2,295.00	8,950,500
三信電気	8,000	1,996.00	15,968,000
東陽テクニカ	10,100	931.00	9,403,100
モスフードサービス	11,400	2,954.00	33,675,600
加賀電子	7,900	2,393.00	18,904,700
ソーダニッカ	9,100	697.00	6,342,700
立花エレテック	5,900	1,966.00	11,599,400
フォーバル	3,900	1,001.00	3,903,900
PALTAC	12,200	6,140.00	74,908,000
三谷産業	10,100	358.00	3,615,800
西本Wismettacホールディングス	2,000	5,450.00	10,900,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	1,437.00	1,005,900
国際紙パルプ商事	15,500	362.00	5,611,000
ヤマタネ	4,300	2,113.00	9,085,900
丸紅建材リース	900	2,526.00	2,273,400
日鉄住金物産	6,800	5,600.00	38,080,000
泉州電業	2,900	3,100.00	8,990,000
トラスコ中山	18,100	3,085.00	55,838,500
オートバックスセブン	34,500	1,942.00	66,999,000
モリト	6,400	910.00	5,824,000
加藤産業	13,600	3,825.00	52,020,000
イノテック	7,600	1,381.00	10,495,600
イエローハット	8,200	3,045.00	24,969,000
J Kホールディングス	8,700	831.00	7,229,700
日伝	7,200	2,000.00	14,400,000
北沢産業	7,400	245.00	1,813,000
杉本商事	4,700	2,018.00	9,484,600
因幡電機産業	11,500	4,975.00	57,212,500
バイテックホールディングス	3,900	2,612.00	10,186,800
東テク	2,900	3,045.00	8,830,500
ミスミグループ本社	100,800	2,963.00	298,670,400
アルテック	6,400	374.00	2,393,600
タキヒヨー	2,900	2,168.00	6,287,200
蔵王産業	1,400	1,549.00	2,168,600
スズケン	39,600	5,360.00	212,256,000
ジェコス	6,100	1,226.00	7,478,600
ルネサスイーストン	8,000	554.00	4,432,000
ローソン	21,900	6,720.00	147,168,000
サンエー	6,600	5,150.00	33,990,000
カワチ薬品	6,800	2,284.00	15,531,200

エービーシー・マート	15,800	6,250.00	98,750,000
ハードオフコーポレーション	4,000	974.00	3,896,000
アスクル	7,600	3,375.00	25,650,000
ゲオホールディングス	14,400	1,706.00	24,566,400
アダストリア	13,400	1,531.00	20,515,400
ジーフット	5,400	764.00	4,125,600
くらコーポレーション	5,100	7,360.00	37,536,000
キャンドウ	4,200	1,731.00	7,270,200
パルグループホールディングス	4,500	2,798.00	12,591,000
エディオン	33,700	1,251.00	42,158,700
サーラコーポレーション	17,700	700.00	12,390,000
ワッツ	2,900	934.00	2,708,600
ハローズ	3,300	2,752.00	9,081,600
あみやき亭	1,900	4,580.00	8,702,000
ひらまつ	12,100	460.00	5,566,000
大黒天物産	2,100	4,490.00	9,429,000
ハニーズホールディングス	8,600	950.00	8,170,000
ファーマライズホールディングス	2,100	638.00	1,339,800
アルペン	6,700	2,035.00	13,634,500
ハブ	2,200	1,011.00	2,224,200
クオールホールディングス	9,600	2,441.00	23,433,600
ジーンズ	5,900	6,070.00	35,813,000
ビックカメラ	46,300	1,562.00	72,320,600
D C Mホールディングス	46,800	1,070.00	50,076,000
ペッパーフードサービス	6,800	4,015.00	27,302,000
Monotaro	54,800	3,220.00	176,456,000
東京一番フーズ	2,200	664.00	1,460,800
DDホールディングス	1,900	2,701.00	5,131,900
きちり	2,400	860.00	2,064,000
アークランドサービスホールディングス	6,400	2,159.00	13,817,600
J．フロント リテイリング	103,600	1,738.00	180,056,800
ドトール・日レスホールディングス	15,300	2,095.00	32,053,500
マツモトキヨシホールディングス	35,900	4,555.00	163,524,500
ブロンコビリー	4,600	3,615.00	16,629,000
Z O Z O	85,200	3,520.00	299,904,000
トレジャー・ファクトリー	2,600	766.00	1,991,600
物語コーポレーション	2,500	10,890.00	27,225,000
ココカラファイン	9,100	7,110.00	64,701,000
三越伊勢丹ホールディングス	162,200	1,376.00	223,187,200
Hamee	2,200	1,595.00	3,509,000
ウエルシアホールディングス	22,900	6,330.00	144,957,000
クリエイトSDホールディングス	12,800	2,968.00	37,990,400

丸善C H Iホールディングス	10,100	378.00	3,817,800
ティーライフ	1,300	1,079.00	1,402,700
エー・ピーカンパニー	1,700	607.00	1,031,900
チムニー	2,700	2,909.00	7,854,300
シュッピン	5,400	1,354.00	7,311,600
ネクステージ	13,400	895.00	11,993,000
ジョイフル本田	25,400	1,790.00	45,466,000
鳥貴族	2,900	2,423.00	7,026,700
キリン堂ホールディングス	3,100	1,886.00	5,846,600
ホットランド	4,600	1,363.00	6,269,800
すかいらーくホールディングス	80,900	1,673.00	135,345,700
綿半ホールディングス	3,300	2,915.00	9,619,500
ヨシックス	1,400	2,986.00	4,180,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,900	1,399.00	40,431,100
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,700	927.00	3,429,900
B E E N O S	2,100	1,920.00	4,032,000
あさひ	6,500	1,457.00	9,470,500
日本調剤	3,100	3,575.00	11,082,500
コスモス薬品	4,400	25,120.00	110,528,000
トーエル	4,200	1,016.00	4,267,200
一六堂	2,000	382.00	764,000
オンリー	1,500	894.00	1,341,000
セブン&アイ・ホールディングス	363,500	5,071.00	1,843,308,500
薬王堂	3,800	3,840.00	14,592,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	23,500	1,320.00	31,020,000
ツルハホールディングス	18,800	13,590.00	255,492,000
サンマルクホールディングス	6,300	2,650.00	16,695,000
フェリシモ	2,300	1,319.00	3,033,700
トリドールホールディングス	10,700	2,447.00	26,182,900
T O K Y O B A S E	7,900	659.00	5,206,100
ウイルプラスホールディングス	900	970.00	873,000
ジャパンミート	3,300	2,242.00	7,398,600
サツドラホールディングス	1,500	2,087.00	3,130,500
ダイユー・リックホールディングス	4,200	1,179.00	4,951,800
パロックジャパンリミテッド	7,000	1,023.00	7,161,000
クスリのアオキホールディングス	6,900	8,900.00	61,410,000
力の源ホールディングス	2,000	1,159.00	2,318,000
スシローグローバルホールディングス	9,500	6,580.00	62,510,000
L I X I L ビバ	11,000	1,753.00	19,283,000
メディカルシステムネットワーク	10,300	465.00	4,789,500
はるやまホールディングス	4,200	962.00	4,040,400

ノジマ	15,400	2,463.00	37,930,200
カップ・クリエイト	10,800	1,365.00	14,742,000
ライトオン	7,500	1,063.00	7,972,500
良品計画	11,500	33,600.00	386,400,000
三城ホールディングス	11,100	483.00	5,361,300
アドヴァン	8,900	1,006.00	8,953,400
アルビス	2,800	3,015.00	8,442,000
コナカ	11,400	516.00	5,882,400
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,899.00	2,088,900
G - 7ホールディングス	2,600	2,802.00	7,285,200
イオン北海道	8,900	841.00	7,484,900
コジマ	13,100	517.00	6,772,700
ヒマラヤ	2,700	985.00	2,659,500
コーナン商事	12,400	2,887.00	35,798,800
エコス	3,600	1,676.00	6,033,600
ワタミ	10,300	1,296.00	13,348,800
マルシェ	2,300	806.00	1,853,800
ドンキホーテホールディングス	56,200	5,730.00	322,026,000
西松屋チェーン	19,200	1,133.00	21,753,600
ゼンショーホールディングス	45,000	2,200.00	99,000,000
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,662.00	8,310,000
ハークスレイ	2,200	1,095.00	2,409,000
サイゼリヤ	14,300	2,206.00	31,545,800
V Tホールディングス	29,500	504.00	14,868,000
魚力	2,500	1,459.00	3,647,500
ポブラ	2,200	647.00	1,423,400
フジ・コーポレーション	1,800	2,389.00	4,300,200
ユナイテッドアローズ	10,800	4,695.00	50,706,000
ハイデイ日高	11,400	2,366.00	26,972,400
京都きもの友禅	5,800	542.00	3,143,600
コロワイド	28,800	2,938.00	84,614,400
ピーシーデポコーポレーション	13,200	544.00	7,180,800
壱番屋	6,100	4,580.00	27,938,000
P L A N T	2,100	1,266.00	2,658,600
スギホールディングス	19,100	5,740.00	109,634,000
ヴィア・ホールディングス	10,600	714.00	7,568,400
スクロール	13,400	682.00	9,138,800
ヨンドシーホールディングス	8,900	2,366.00	21,057,400
ユニー・ファミリーマートホールディングス	27,700	11,830.00	327,691,000
木曽路	10,700	2,690.00	28,783,000
S R Sホールディングス	10,300	1,008.00	10,382,400
タカキュー	6,700	205.00	1,373,500

ケーヨー	16,300	544.00	8,867,200
上新電機	10,300	3,300.00	33,990,000
日本瓦斯	15,900	5,600.00	89,040,000
ロイヤルホールディングス	15,400	2,934.00	45,183,600
いなげや	9,700	1,686.00	16,354,200
鳥忠	19,700	3,605.00	71,018,500
チヨダ	10,300	2,222.00	22,886,600
ライフコーポレーション	6,600	3,025.00	19,965,000
リンガーハット	10,700	2,404.00	25,722,800
MrMaxHD	11,100	615.00	6,826,500
テンアライド	8,000	451.00	3,608,000
AOKIホールディングス	17,400	1,527.00	26,569,800
オークワ	12,000	1,204.00	14,448,000
コメリ	13,400	2,664.00	35,697,600
青山商事	16,700	3,465.00	57,865,500
しまむら	10,100	10,520.00	106,252,000
はせがわ	4,600	489.00	2,249,400
高島屋	68,100	1,847.00	125,780,700
松屋	17,600	1,295.00	22,792,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	41,100	1,838.00	75,541,800
近鉄百貨店	3,300	3,910.00	12,903,000
パルコ	8,500	1,253.00	10,650,500
丸井グループ	79,500	2,736.00	217,512,000
アクシアル リテイリング	7,200	4,035.00	29,052,000
イオン	333,700	2,704.00	902,324,800
イズミ	15,700	7,410.00	116,337,000
平和堂	17,600	3,055.00	53,768,000
フジ	10,400	2,193.00	22,807,200
ヤオコー	9,900	6,830.00	67,617,000
ゼビオホールディングス	11,800	1,667.00	19,670,600
ケーズホールディングス	76,900	1,364.00	104,891,600
Olympicグループ	5,200	1,020.00	5,304,000
日産東京販売ホールディングス	12,900	365.00	4,708,500
Genky DrugStores	3,400	4,350.00	14,790,000
総合メディカルホールディングス	7,600	2,630.00	19,988,000
ブックオフグループホールディングス	5,000	756.00	3,780,000
アインホールディングス	11,600	8,960.00	103,936,000
元気寿司	2,200	6,330.00	13,926,000
ヤマダ電機	296,600	570.00	169,062,000
アークランドサカモト	14,800	1,532.00	22,673,600
ニトリホールディングス	34,400	16,225.00	558,140,000
グルメ杵屋	6,000	1,234.00	7,404,000

愛眼	7,000	371.00	2,597,000
ケーユーホールディングス	4,700	970.00	4,559,000
吉野家ホールディングス	28,500	1,837.00	52,354,500
松屋フーズホールディングス	4,200	3,625.00	15,225,000
サガミホールディングス	11,700	1,385.00	16,204,500
関西スーパーマーケット	6,700	1,185.00	7,939,500
王将フードサービス	6,400	7,790.00	49,856,000
プレナス	9,800	1,857.00	18,198,600
ミニストップ	6,500	2,141.00	13,916,500
アークス	16,300	3,065.00	49,959,500
パローホールディングス	20,200	2,601.00	52,540,200
ベルク	3,900	6,120.00	23,868,000
大庄	4,700	1,697.00	7,975,900
ファーストリテイリング	11,600	58,830.00	682,428,000
サンドラッグ	32,600	4,000.00	130,400,000
サクスパー ホールディングス	8,400	1,003.00	8,425,200
ヤマザワ	1,800	1,715.00	3,087,000
やまや	1,800	3,090.00	5,562,000
ペルーナ	21,400	1,318.00	28,205,200
島根銀行	2,500	1,219.00	3,047,500
じもとホールディングス	59,400	188.00	11,167,200
めぶきフィナンシャルグループ	453,200	392.00	177,654,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	12,100	2,335.00	28,253,500
九州フィナンシャルグループ	144,000	544.00	78,336,000
ゆうちょ銀行	246,600	1,336.00	329,457,600
富山第一銀行	23,700	467.00	11,067,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	519,900	556.00	289,064,400
西日本フィナンシャルホールディングス	56,200	1,307.00	73,453,400
関西みらいフィナンシャルグループ	38,900	1,031.00	40,105,900
三十三フィナンシャルグループ	7,600	2,371.00	18,019,600
第四北越フィナンシャルグループ	15,450	5,320.00	82,194,000
新生銀行	70,800	1,839.00	130,201,200
あおぞら銀行	51,700	4,050.00	209,385,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,047,800	713.50	4,315,105,300
りそなホールディングス	953,000	632.80	603,058,400
三井住友トラスト・ホールディングス	170,700	4,637.00	791,535,900
三井住友フィナンシャルグループ	650,200	4,618.00	3,002,623,600
千葉銀行	308,600	772.00	238,239,200
群馬銀行	175,000	577.00	100,975,000
武蔵野銀行	14,100	3,250.00	45,825,000
千葉興業銀行	25,400	500.00	12,700,000
筑波銀行	36,600	272.00	9,955,200



七十七銀行	27,500	2,665.00	73,287,500
青森銀行	7,000	3,410.00	23,870,000
秋田銀行	5,800	2,978.00	17,272,400
山形銀行	10,100	2,436.00	24,603,600
岩手銀行	6,200	4,830.00	29,946,000
東邦銀行	77,700	414.00	32,167,800
東北銀行	4,500	1,340.00	6,030,000
みちのく銀行	5,600	1,785.00	9,996,000
ふくおかフィナンシャルグループ	70,800	3,130.00	221,604,000
静岡銀行	219,400	1,022.00	224,226,800
十六銀行	11,900	2,866.00	34,105,400
八十二銀行	158,700	519.00	82,365,300
山梨中央銀行	11,100	1,986.00	22,044,600
大垣共立銀行	14,000	2,871.00	40,194,000
福井銀行	7,800	2,338.00	18,236,400
北國銀行	10,000	4,315.00	43,150,000
清水銀行	3,800	2,122.00	8,063,600
富山銀行	1,800	4,245.00	7,641,000
滋賀銀行	16,600	2,922.00	48,505,200
南都銀行	10,400	2,858.00	29,723,200
百五銀行	85,300	456.00	38,896,800
京都銀行	33,300	5,910.00	196,803,000
紀陽銀行	33,100	1,789.00	59,215,900
ほくほくフィナンシャルグループ	58,300	1,575.00	91,822,500
広島銀行	129,200	756.00	97,675,200
山陰合同銀行	52,300	1,000.00	52,300,000
中国銀行	60,700	1,121.00	68,044,700
鳥取銀行	3,200	1,671.00	5,347,200
伊予銀行	125,000	695.00	86,875,000
百十四銀行	9,500	3,300.00	31,350,000
四国銀行	13,900	1,362.00	18,931,800
阿波銀行	14,100	3,430.00	48,363,000
大分銀行	5,200	4,075.00	21,190,000
宮崎銀行	6,000	3,315.00	19,890,000
佐賀銀行	5,600	2,334.00	13,070,400
十八銀行	5,500	3,815.00	20,982,500
沖縄銀行	8,600	4,000.00	34,400,000
琉球銀行	19,200	1,352.00	25,958,400
セブン銀行	328,200	347.00	113,885,400
みずほフィナンシャルグループ	11,800,000	197.70	2,332,860,000
高知銀行	3,200	1,153.00	3,689,600
山口フィナンシャルグループ	109,000	1,200.00	130,800,000

長野銀行	3,300	1,746.00	5,761,800
名古屋銀行	7,200	3,835.00	27,612,000
北洋銀行	133,000	380.00	50,540,000
愛知銀行	3,100	5,050.00	15,655,000
中京銀行	3,900	2,326.00	9,071,400
大光銀行	3,300	2,279.00	7,520,700
愛媛銀行	12,700	1,246.00	15,824,200
トマト銀行	3,800	1,488.00	5,654,400
京葉銀行	39,200	943.00	36,965,600
栃木銀行	47,000	373.00	17,531,000
北日本銀行	3,000	2,625.00	7,875,000
東和銀行	15,300	1,032.00	15,789,600
福島銀行	7,300	705.00	5,146,500
大東銀行	4,200	1,218.00	5,115,600
トモニホールディングス	73,400	484.00	35,525,600
フィデアホールディングス	84,300	172.00	14,499,600
池田泉州ホールディングス	94,500	378.00	35,721,000
F P G	27,900	1,128.00	31,471,200
マーキュリアインベストメント	3,400	1,005.00	3,417,000
S B Iホールディングス	98,300	3,565.00	350,439,500
ジャフコ	12,500	4,445.00	55,562,500
大和証券グループ本社	743,500	690.80	513,609,800
野村ホールディングス	1,494,300	550.00	821,865,000
岡三証券グループ	74,000	587.00	43,438,000
丸三証券	27,900	959.00	26,756,100
東洋証券	32,000	265.00	8,480,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	96,400	654.00	63,045,600
光世証券	2,200	1,265.00	2,783,000
水戸証券	25,500	384.00	9,792,000
いちよし証券	18,400	1,175.00	21,620,000
松井証券	42,700	1,183.00	50,514,100
だいこう証券ビジネス	4,500	570.00	2,565,000
マネックスグループ	88,800	548.00	48,662,400
カブドットコム証券	56,200	386.00	21,693,200
極東証券	11,800	1,440.00	16,992,000
岩井コスモホールディングス	9,000	1,619.00	14,571,000
藍澤証券	16,400	772.00	12,660,800
マネーパートナーズグループ	11,500	402.00	4,623,000
かんぽ生命保険	32,800	2,705.00	88,724,000
S O M P Oホールディングス	170,300	4,787.00	815,226,100
アニコム ホールディングス	6,000	3,765.00	22,590,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	227,100	3,768.00	855,712,800

ソニーフィナンシャルホールディングス	71,400	2,541.00	181,427,400
第一生命ホールディングス	491,200	2,411.50	1,184,528,800
東京海上ホールディングス	327,200	5,617.00	1,837,882,400
T & Dホールディングス	268,600	1,912.00	513,563,200
アドバンスクリエイト	2,000	2,527.00	5,054,000
全国保証	24,500	4,485.00	109,882,500
ジェイリース	1,600	710.00	1,136,000
イントラスト	1,800	612.00	1,101,600
アルヒ	9,900	2,289.00	22,661,100
クレディセゾン	65,900	1,896.00	124,946,400
アクリーティブ	4,600	414.00	1,904,400
芙蓉総合リース	9,900	6,860.00	67,914,000
興銀リース	16,300	3,015.00	49,144,500
東京センチュリー	17,500	7,000.00	122,500,000
日本証券金融	35,700	688.00	24,561,600
アイフル	145,700	343.00	49,975,100
リコーリース	6,800	3,700.00	25,160,000
イオンフィナンシャルサービス	61,600	2,379.00	146,546,400
アコム	174,500	452.00	78,874,000
ジャックス	10,500	2,390.00	25,095,000
オリエントコーポレーション	187,900	167.00	31,379,300
日立キャピタル	23,900	3,115.00	74,448,500
アプラスフィナンシャル	42,300	109.00	4,610,700
オリックス	579,400	1,835.50	1,063,488,700
三菱UFJリース	220,400	671.00	147,888,400
九州リースサービス	3,800	748.00	2,842,400
日本取引所グループ	249,200	1,970.00	490,924,000
イー・ギャランティ	9,200	1,226.00	11,279,200
アサックス	3,700	627.00	2,319,900
NECキャピタルソリューション	3,500	1,938.00	6,783,000
いちご	124,500	428.00	53,286,000
日本駐車場開発	105,400	177.00	18,655,800
ヒューリック	181,300	1,102.00	199,792,600
三栄建築設計	3,500	1,748.00	6,118,000
スター・マイカ	4,000	1,698.00	6,792,000
野村不動産ホールディングス	57,900	2,281.00	132,069,900
三重交通グループホールディングス	17,800	547.00	9,736,600
サムティ	8,300	1,686.00	13,993,800
ディア・ライフ	10,800	552.00	5,961,600
コーセーアールイー	2,100	890.00	1,869,000
エー・ディー・ワークス	115,000	39.00	4,485,000
日本商業開発	5,000	1,827.00	9,135,000

プレサンスコーポレーション	12,100	1,462.00	17,690,200
ユニゾホールディングス	11,900	2,192.00	26,084,800
THEグローバル社	4,200	870.00	3,654,000
日本管理センター	5,900	1,341.00	7,911,900
サンセイランディック	2,500	1,271.00	3,177,500
エストラスト	1,200	854.00	1,024,800
フージャースホールディングス	21,200	698.00	14,797,600
オープンハウス	14,200	5,550.00	78,810,000
東急不動産ホールディングス	210,300	787.00	165,506,100
飯田グループホールディングス	72,500	2,020.00	146,450,000
イーランド	1,400	803.00	1,124,200
ムゲンエステート	6,100	686.00	4,184,600
ファーストブラザーズ	2,400	1,478.00	3,547,200
ハウストゥ	3,200	2,493.00	7,977,600
シーアールイー	3,000	901.00	2,703,000
ケイアイスター不動産	3,200	2,392.00	7,654,400
グッドコムアセット	1,500	1,903.00	2,854,500
ジェイ・エス・ビー	300	5,250.00	1,575,000
パーク24	50,700	3,415.00	173,140,500
パラカ	2,300	2,235.00	5,140,500
三井不動産	433,700	2,677.50	1,161,231,750
三菱地所	646,400	1,915.00	1,237,856,000
平和不動産	15,400	2,002.00	30,830,800
東京建物	95,000	1,363.00	129,485,000
ダイビル	22,400	1,218.00	27,283,200
京阪神ビルディング	14,600	858.00	12,526,800
住友不動産	208,000	4,086.00	849,888,000
大京	13,900	2,334.00	32,442,600
テーオーシー	30,200	826.00	24,945,200
東京楽天地	1,400	5,240.00	7,336,000
レオパレス21	103,600	643.00	66,614,800
スターツコーポレーション	11,900	2,483.00	29,547,700
フジ住宅	11,200	883.00	9,889,600
空港施設	8,900	658.00	5,856,200
明和地所	4,900	656.00	3,214,400
ゴールドクレスト	6,900	1,876.00	12,944,400
日本エスリード	3,500	1,598.00	5,593,000
日神不動産	11,900	597.00	7,104,300
日本エスコン	15,900	797.00	12,672,300
タカラレーベン	41,000	345.00	14,145,000
サンヨーハウジング名古屋	5,100	1,114.00	5,681,400
イオンモール	56,000	1,939.00	108,584,000

ファースト住建	3,300	1,476.00	4,870,800
カチタス	11,900	3,370.00	40,103,000
トーセイ	12,100	1,169.00	14,144,900
穴吹興産	1,000	3,270.00	3,270,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	54,100	1,290.00	69,789,000
サンフロンティア不動産	10,700	1,290.00	13,803,000
エフ・ジェー・ネクスト	6,800	902.00	6,133,600
インテリックス	2,600	825.00	2,145,000
ランドビジネス	4,500	462.00	2,079,000
グランディハウス	7,700	490.00	3,773,000
日本空港ビルデング	25,400	5,180.00	131,572,000
日本工営	5,700	2,984.00	17,008,800
L I F U L L	29,500	634.00	18,703,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,800	2,611.00	17,754,800
日本M&Aセンター	58,300	3,440.00	200,552,000
メンバーズ	2,900	1,312.00	3,804,800
中広	1,000	789.00	789,000
タケエイ	8,900	838.00	7,458,200
E・Jホールディングス	1,100	1,416.00	1,557,600
トラスト・テック	4,100	4,340.00	17,794,000
コシダカホールディングス	22,700	1,302.00	29,555,400
アルトナー	1,400	1,037.00	1,451,800
パソナグループ	8,000	1,680.00	13,440,000
C D S	2,200	1,440.00	3,168,000
リンクアンドモチベーション	15,500	1,430.00	22,165,000
G C A	8,700	978.00	8,508,600
エス・エム・エス	33,300	2,188.00	72,860,400
パーソルホールディングス	77,700	2,724.00	211,654,800
リニカル	5,500	1,869.00	10,279,500
クックパッド	27,000	450.00	12,150,000
エスクリ	3,000	797.00	2,391,000
アイ・ケイ・ケイ	4,200	797.00	3,347,400
学情	3,500	1,787.00	6,254,500
スタジオアリス	4,300	2,349.00	10,100,700
シミックホールディングス	4,700	2,382.00	11,195,400
N J S	1,900	1,803.00	3,425,700
総合警備保障	33,500	4,945.00	165,657,500
カカクコム	63,400	2,262.00	143,410,800
アイロムグループ	2,900	1,916.00	5,556,400
セントケア・ホールディング	3,800	688.00	2,614,400
サイネックス	1,300	792.00	1,029,600
ルネサンス	4,100	2,387.00	9,786,700

ディップ	11,900	2,827.00	33,641,300
オプトホールディング	5,200	3,510.00	18,252,000
ツクイ	19,900	1,126.00	22,407,400
キャリアデザインセンター	2,200	1,655.00	3,641,000
エムスリー	177,100	2,521.00	446,469,100
ツカダ・グローバルホールディング	5,500	643.00	3,536,500
プラス	700	681.00	476,700
アウトソーシング	40,700	1,760.00	71,632,000
ウェルネット	8,700	1,036.00	9,013,200
ワールドホールディングス	2,300	3,465.00	7,969,500
ディー・エヌ・エー	45,400	2,025.00	91,935,000
博報堂D Yホールディングス	116,900	2,007.00	234,618,300
ぐるなび	13,400	932.00	12,488,800
エスアールジータカミヤ	10,200	686.00	6,997,200
ジャパンベストレスキューシステム	6,700	1,271.00	8,515,700
ファンコミュニケーションズ	23,300	702.00	16,356,600
ライク	3,400	1,790.00	6,086,000
ビジネス・ブレークスルー	4,200	410.00	1,722,000
WDBホールディングス	3,900	4,050.00	15,795,000
ティア	4,000	897.00	3,588,000
C D G	800	1,656.00	1,324,800
バリューコマース	5,700	2,441.00	13,913,700
インフォマート	46,200	1,466.00	67,729,200
J Pホールディングス	26,700	315.00	8,410,500
エコナックホールディングス	17,500	121.00	2,117,500
E P Sホールディングス	12,700	2,406.00	30,556,200
レグス	2,200	1,351.00	2,972,200
プレステージ・インターナショナル	17,600	1,359.00	23,918,400
アミューズ	5,600	3,340.00	18,704,000
ドリームインキュベータ	2,900	2,202.00	6,385,800
クイック	5,300	2,151.00	11,400,300
T A C	5,600	274.00	1,534,400
ケネディクス	78,800	649.00	51,141,200
電通	102,500	5,300.00	543,250,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,000	2,393.00	9,572,000
ぴあ	2,800	5,850.00	16,380,000
イオンファンタジー	2,700	4,230.00	11,421,000
シーティーエス	8,500	790.00	6,715,000
ネクシィーズグループ	2,600	2,061.00	5,358,600
みらかホールディングス	25,100	2,897.00	72,714,700
アルプス技研	7,400	2,586.00	19,136,400
ダイオーズ	1,700	1,410.00	2,397,000

日本空調サービス	8,900	826.00	7,351,400
オリエンタルランド	99,400	11,710.00	1,163,974,000
ダスキン	22,700	2,795.00	63,446,500
明光ネットワークジャパン	10,800	1,059.00	11,437,200
ファルコホールディングス	4,400	1,893.00	8,329,200
ラウンドワン	26,200	1,477.00	38,697,400
リゾートトラスト	35,700	1,856.00	66,259,200
ビー・エム・エル	10,900	3,475.00	37,877,500
ワタベウェディング	1,500	560.00	840,000
りらいあコミュニケーションズ	13,400	1,421.00	19,041,400
リソー教育	14,300	941.00	13,456,300
早稲田アカデミー	1,200	1,974.00	2,368,800
ユー・エス・エス	102,800	2,106.00	216,496,800
東京個別指導学院	3,000	1,465.00	4,395,000
サイバーエージェント	51,900	6,130.00	318,147,000
楽天	392,300	859.80	337,299,540
クリーク・アンド・リバー社	4,500	1,275.00	5,737,500
テー・オー・ダブリュー	8,300	849.00	7,046,700
セントラルスポーツ	3,200	4,245.00	13,584,000
フルキャストホールディングス	8,500	2,648.00	22,508,000
エン・ジャパン	7,200	5,710.00	41,112,000
リソルホールディングス	900	4,430.00	3,987,000
テクノプロ・ホールディングス	15,900	7,110.00	113,049,000
アトラ	1,800	1,010.00	1,818,000
インターワークス	1,900	896.00	1,702,400
Keeper 技研	2,800	1,197.00	3,351,600
ファーストロジック	1,700	941.00	1,599,700
三機サービス	1,300	2,440.00	3,172,000
Gunosy	5,200	2,016.00	10,483,200
デザインワン・ジャパン	1,700	872.00	1,482,400
イー・ガーディアン	4,000	2,891.00	11,564,000
リブセンス	4,900	357.00	1,749,300
ジャパンマテリアル	23,100	1,595.00	36,844,500
ベクトル	10,200	2,589.00	26,407,800
ウチヤマホールディングス	4,200	507.00	2,129,400
ライクキッズネクスト	1,400	1,398.00	1,957,200
キャリアリンク	3,000	512.00	1,536,000
I B J	5,800	728.00	4,222,400
アサンテ	3,100	2,427.00	7,523,700
N・フィールド	5,500	1,937.00	10,653,500
バリューHR	1,800	2,361.00	4,249,800
M&Aキャピタルパートナーズ	2,100	6,580.00	13,818,000

ライドオンエクスプレスホールディングス	3,500	1,637.00	5,729,500
E R Iホールディングス	2,500	1,110.00	2,775,000
アビスト	1,300	4,205.00	5,466,500
シグマクシス	4,600	1,333.00	6,131,800
ウィルグループ	3,800	1,059.00	4,024,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,900	479.00	5,700,100
日本ビューホテル	2,700	1,417.00	3,825,900
リクルートホールディングス	649,100	3,826.00	2,483,456,600
エラン	2,900	3,260.00	9,454,000
土木管理総合試験所	3,900	619.00	2,414,100
日本郵政	477,500	1,356.00	647,490,000
ベルシステム24ホールディングス	14,100	1,774.00	25,013,400
鎌倉新書	6,200	1,516.00	9,399,200
一蔵	1,100	845.00	929,500
L I T A L I C O	2,000	2,678.00	5,356,000
グローバルグループ	1,100	1,859.00	2,044,900
エボラブルアジア	2,400	2,811.00	6,746,400
アトラエ	1,600	2,501.00	4,001,600
ストライク	2,100	3,670.00	7,707,000
ソラスト	15,400	1,452.00	22,360,800
セラク	2,100	749.00	1,572,900
インソース	2,800	2,576.00	7,212,800
アイモバイル	1,900	803.00	1,525,700
キャリアインデックス	2,400	1,466.00	3,518,400
M S - J a p a n	3,400	2,343.00	7,966,200
船場	1,400	1,032.00	1,444,800
グレイステクノロジー	2,000	3,525.00	7,050,000
フルテック	1,000	1,197.00	1,197,000
グリーンズ	1,900	1,475.00	2,802,500
ツナグ・ソリューションズ	900	1,037.00	933,300
日総工産	2,800	3,005.00	8,414,000
キュービーネットホールディングス	4,400	2,255.00	9,922,000
スプリックス	2,400	2,860.00	6,864,000
アドバンテッジリスクマネジメント	2,900	1,227.00	3,558,300
リログループ	46,000	3,320.00	152,720,000
東祥	5,300	4,585.00	24,300,500
エイチ・アイ・エス	15,000	3,830.00	57,450,000
ラックランド	1,600	2,913.00	4,660,800
共立メンテナンス	15,000	4,830.00	72,450,000
イチネンホールディングス	9,500	1,521.00	14,449,500
建設技術研究所	5,900	1,686.00	9,947,400
スペース	5,500	1,394.00	7,667,000



長大	3,400	870.00	2,958,000	
燦ホールディングス	2,000	2,770.00	5,540,000	
スバル興業	600	5,900.00	3,540,000	
東京テアトル	3,600	1,360.00	4,896,000	
タナベ経営	1,700	1,766.00	3,002,200	
ナガワ	1,700	5,370.00	9,129,000	
よみうりランド	1,800	4,470.00	8,046,000	
東京都競馬	5,500	4,475.00	24,612,500	
カナモト	11,900	4,005.00	47,659,500	
東京ドーム	34,300	1,000.00	34,300,000	
西尾レントオール	8,600	3,730.00	32,078,000	
トランス・コスモス	9,400	2,908.00	27,335,200	
乃村工藝社	19,700	2,330.00	45,901,000	
藤田観光	3,400	3,485.00	11,849,000	
KNT-CTホールディングス	5,300	1,295.00	6,863,500	
日本管財	9,100	2,152.00	19,583,200	
トーカイ	8,200	2,636.00	21,615,200	
白洋舎	1,000	3,170.00	3,170,000	
セコム	89,300	9,417.00	840,938,100	
セントラル警備保障	4,100	5,010.00	20,541,000	
丹青社	17,400	1,178.00	20,497,200	
メイテック	9,900	5,450.00	53,955,000	
応用地質	9,100	1,543.00	14,041,300	
船井総研ホールディングス	17,500	2,604.00	45,570,000	
進学会ホールディングス	4,100	642.00	2,632,200	
オオバ	6,800	632.00	4,297,600	
いであ	1,800	1,151.00	2,071,800	
学究社	3,100	1,800.00	5,580,000	
ベネッセホールディングス	30,800	3,185.00	98,098,000	
イオンディライト	10,400	4,150.00	43,160,000	
ナック	5,800	1,129.00	6,548,200	
ニチイ学館	16,100	970.00	15,617,000	
ダイセキ	14,100	3,145.00	44,344,500	
ステップ	3,100	1,556.00	4,823,600	
合計	100,612,985		228,398,082,175	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	サムティ株式会社第19回新株予約権	8,300	1,917,300	
	合計	8,300	1,917,300	

(注)券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2018年10月 1日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
コール・ローン	4,207,499,994
国債証券	343,481,835,450
地方債証券	23,127,832,624
特殊債券	29,465,689,851
社債券	17,035,483,500
未収入金	2,986,400,400
未収利息	494,599,359
前払費用	14,498,073
差入委託証拠金	100,000
流動資産合計	420,813,939,251
<b>資産合計</b>	<b>420,813,939,251</b>
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
未払金	6,675,238,888
未払解約金	99,877,178
未払利息	10,515
その他未払費用	3,480
流動負債合計	6,775,130,061
<b>負債合計</b>	<b>6,775,130,061</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	299,993,190,511
<b>剰余金</b>	
剰余金又は欠損金( )	114,045,618,679
元本等合計	414,038,809,190
<b>純資産合計</b>	<b>414,038,809,190</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>420,813,939,251</b>

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2018年10月 1日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日まで個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2018年10月 1日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	299,993,190,511口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 99,859,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3802円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,802円)</p>

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

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2018年10月 1日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2018年10月 1日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年10月 1日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2018年10月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年10月 3日
期首元本額	233,671,181,126円
期中追加設定元本額	81,463,737,101円
期中一部解約元本額	15,141,727,716円
期末元本額	299,993,190,511円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,019,294,641円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,375,396円
S M T 国内債券インデックス・オープン	14,041,741,447円
世界経済インデックスファンド	1,774,280,203円
D C マイセレクション 2 5	19,864,955,453円
D C マイセレクション 5 0	22,878,499,400円
D C マイセレクション 7 5	6,515,512,797円
D C 日本債券インデックス・オープン	451,705,483円
D C 日本債券インデックス・オープン S	78,110,708,120円
D C 日本債券インデックス・オープン P	35,922,933,598円
D C マイセレクション S 2 5	7,917,791,252円
D C マイセレクション S 5 0	9,115,841,900円
D C マイセレクション S 7 5	1,870,409,143円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,212,326,028円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,191,688,269円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	394,003,709円
D C 世界経済インデックスファンド	1,452,289,897円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	89,733,087円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,927,625円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	64,136,099円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	16,311,643円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	987,888円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	300,637,471円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	428,672,744円

区分	2018年10月 1日現在
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	76,409,942円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	210,858,436円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	5,214,794,264円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,121,439,243円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,260,320,649円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	907,883,546円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	128,066,704円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,504,604,951円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	269,706,148円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,667,005,569円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,150,983,535円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	180,988,823円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	6,979,763,005円
日本債券ファンド・シリーズ 1	10,221,577,526円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	44,629,479円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	658,838,566円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	53,454,076円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,755,421円
S M T インデックスバランス・オープン	66,602,192円
S M T 世界経済インデックス・オープン	4,517,226円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	7,158,803円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	18,242,568円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	957,825円
グローバル経済コア	289,267,559円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	6,020,270円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	297,614円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンド P（適格機関投資家専用）	56,251,056,038円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年10月 1日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,459,713,150
地方債証券	181,524,095
特殊債券	192,914,706
社債券	99,931,910
合計	4,934,083,861

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第382回利付国債(2年)	310,000,000	310,799,800	
	第383回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,303,523,000	
	第384回利付国債(2年)	1,720,000,000	1,724,988,000	
	第385回利付国債(2年)	700,000,000	702,163,000	
	第386回利付国債(2年)	2,990,000,000	2,999,747,400	
	第387回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,715,899,500	
	第388回利付国債(2年)	2,130,000,000	2,137,753,200	
	第389回利付国債(2年)	2,780,000,000	2,790,397,200	
	第390回利付国債(2年)	5,290,000,000	5,310,313,600	
	第391回利付国債(2年)	2,850,000,000	2,861,485,500	
	第392回利付国債(2年)	420,000,000	421,772,400	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,529,856,000	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,150,110,800	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,957,371,000	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,625,270,300	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,973,793,600	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,804,186,800	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,618,758,400	
	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,218,560,000	
	第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,368,554,400	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,576,564,000	
	第132回利付国債(5年)	4,000,000,000	4,027,560,000	
	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,773,938,400	
	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	3,193,458,000	
	第135回利付国債(5年)	8,360,000,000	8,425,458,800	
	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	5,947,436,000	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	555,240,000		
第2回利付国債(40年)	420,000,000	563,333,400		

第3回利付国債（40年）	520,000,000	699,472,800	
第4回利付国債（40年）	730,000,000	984,492,600	
第5回利付国債（40年）	890,000,000	1,153,635,800	
第6回利付国債（40年）	500,000,000	634,020,000	
第7回利付国債（40年）	720,000,000	871,329,600	
第8回利付国債（40年）	800,000,000	895,064,000	
第9回利付国債（40年）	1,090,000,000	880,556,500	
第10回利付国債（40年）	1,960,000,000	1,876,876,400	
第11回利付国債（40年）	540,000,000	497,469,600	
第305回利付国債（10年）	1,910,000,000	1,943,272,200	
第306回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,196,055,900	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	714,567,000	
第308回利付国債（10年）	1,490,000,000	1,526,356,000	
第309回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,501,352,000	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,440,991,800	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,099,472,400	
第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	3,920,871,000	
第313回利付国債（10年）	1,250,000,000	1,293,362,500	
第314回利付国債（10年）	310,000,000	319,222,500	
第315回利付国債（10年）	3,060,000,000	3,168,293,400	
第316回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,125,599,400	
第317回利付国債（10年）	890,000,000	921,639,500	
第318回利付国債（10年）	1,270,000,000	1,311,376,600	
第319回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,775,629,800	
第320回利付国債（10年）	2,920,000,000	3,022,667,200	
第321回利付国債（10年）	1,340,000,000	1,390,732,400	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	775,792,500	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,005,599,000	
第324回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,322,214,400	
第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,370,195,800	
第326回利付国債（10年）	860,000,000	888,190,800	
第327回利付国債（10年）	740,000,000	767,387,400	
第328回利付国債（10年）	2,320,000,000	2,389,576,800	
第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	2,342,047,500	
第330回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,501,689,600	
第331回利付国債（10年）	1,380,000,000	1,425,374,400	
第332回利付国債（10年）	3,430,000,000	3,545,659,600	
第333回利付国債（10年）	2,330,000,000	2,410,967,500	
第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	2,890,607,400	
第335回利付国債（10年）	4,220,000,000	4,351,073,200	
第336回利付国債（10年）	510,000,000	526,340,400	
第337回利付国債（10年）	3,880,000,000	3,956,048,000	



第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,514,141,000	
第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	3,839,147,400	
第340回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,153,350,500	
第341回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,193,132,100	
第342回利付国債(10年)	2,910,000,000	2,925,161,100	
第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	3,164,521,500	
第344回利付国債(10年)	3,050,000,000	3,060,858,000	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	1,985,662,800	
第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,407,140,000	
第347回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,433,134,700	
第348回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,230,541,200	
第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,208,523,400	
第350回利付国債(10年)	4,820,000,000	4,813,203,800	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	2,340,000,000	2,334,384,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	141,146,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	199,297,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	148,388,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	144,669,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	61,861,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	241,026,400	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	227,140,200	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	59,888,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	274,497,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	176,275,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	106,853,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	236,781,800	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	357,578,700	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	388,503,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	445,896,400	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	486,250,300	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	741,906,300	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	443,845,950	
第19回利付国債(30年)	280,000,000	360,805,200	
第20回利付国債(30年)	420,000,000	555,723,000	
第21回利付国債(30年)	270,000,000	348,975,000	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	531,044,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	571,345,300	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	505,707,800	
第25回利付国債(30年)	290,000,000	376,208,300	
第26回利付国債(30年)	410,000,000	539,391,900	
第27回利付国債(30年)	600,000,000	802,326,000	
第28回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,514,731,100	

第 2 9 回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,629,122,700
第 3 0 回利付国債(30年)	880,000,000	1,151,594,400
第 3 1 回利付国債(30年)	940,000,000	1,215,570,400
第 3 2 回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,631,505,200
第 3 3 回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,799,354,700
第 3 4 回利付国債(30年)	1,265,000,000	1,646,093,900
第 3 5 回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,095,268,600
第 3 6 回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,934,730,900
第 3 7 回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,755,450,000
第 3 8 回利付国債(30年)	870,000,000	1,065,428,100
第 3 9 回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,258,732,700
第 4 0 回利付国債(30年)	820,000,000	1,005,287,200
第 4 1 回利付国債(30年)	890,000,000	1,071,560,000
第 4 2 回利付国債(30年)	830,000,000	999,643,700
第 4 3 回利付国債(30年)	900,000,000	1,084,311,000
第 4 4 回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,337,727,600
第 4 5 回利付国債(30年)	800,000,000	927,384,000
第 4 6 回利付国債(30年)	890,000,000	1,031,688,000
第 4 7 回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,584,670,600
第 4 8 回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,724,196,800
第 4 9 回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,236,169,000
第 5 0 回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,055,736,900
第 5 1 回利付国債(30年)	980,000,000	845,808,600
第 5 2 回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,400,799,400
第 5 3 回利付国債(30年)	1,070,000,000	998,887,800
第 5 4 回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,462,867,100
第 5 5 回利付国債(30年)	1,000,000,000	980,530,000
第 5 6 回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,410,148,800
第 5 7 回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,134,468,400
第 5 8 回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,074,381,000
第 5 9 回利付国債(30年)	170,000,000	161,272,200
第 4 4 回利付国債(20年)	170,000,000	176,526,300
第 4 5 回利付国債(20年)	290,000,000	300,709,700
第 4 6 回利付国債(20年)	170,000,000	176,798,300
第 4 7 回利付国債(20年)	90,000,000	94,113,000
第 4 8 回利付国債(20年)	130,000,000	137,532,200
第 4 9 回利付国債(20年)	140,000,000	147,639,800
第 5 0 回利付国債(20年)	220,000,000	230,916,400
第 5 1 回利付国債(20年)	100,000,000	105,722,000
第 5 2 回利付国債(20年)	110,000,000	117,173,100
第 5 3 回利付国債(20年)	80,000,000	85,651,200
第 5 4 回利付国債(20年)	200,000,000	214,774,000
第 5 5 回利付国債(20年)	140,000,000	150,172,400

第56回利付国債(20年)	150,000,000	161,625,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	257,704,800	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	323,574,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	214,970,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	371,756,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	251,496,000	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	333,091,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	217,640,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	351,158,400	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	242,371,800	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	361,831,800	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,768,300	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	213,242,700	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	435,571,500	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	455,512,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	225,468,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	709,789,500	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	405,007,200	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	226,248,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	147,691,700	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	303,253,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	327,589,800	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	191,624,000	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	306,158,400	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	250,938,600	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	444,030,600	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	687,306,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	333,346,300	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	536,862,200	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	334,697,700	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	245,496,300	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	638,869,000	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	493,004,400	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	408,145,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	737,188,200	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	530,136,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,026,352,800	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	476,370,800	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	713,876,900	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	726,571,000	
第96回利付国債(20年)	320,000,000	375,616,000	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	475,076,000	

第98回利付国債(20年)	440,000,000	518,667,600
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,360,036,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	573,681,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	867,938,500
第102回利付国債(20年)	410,000,000	499,769,500
第103回利付国債(20年)	400,000,000	483,736,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	428,450,400
第105回利付国債(20年)	680,000,000	811,811,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	457,398,400
第107回利付国債(20年)	150,000,000	179,521,500
第108回利付国債(20年)	660,000,000	776,608,800
第109回利付国債(20年)	230,000,000	271,321,800
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,140,237,500
第111回利付国債(20年)	490,000,000	594,987,400
第112回利付国債(20年)	790,000,000	950,449,000
第113回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,628,761,500
第114回利付国債(20年)	910,000,000	1,100,881,600
第115回利付国債(20年)	700,000,000	854,518,000
第116回利付国債(20年)	880,000,000	1,076,618,400
第117回利付国債(20年)	850,000,000	1,030,395,500
第118回利付国債(20年)	690,000,000	830,739,300
第119回利付国債(20年)	270,000,000	318,718,800
第120回利付国債(20年)	790,000,000	914,504,000
第121回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,982,853,400
第122回利付国債(20年)	200,000,000	236,570,000
第123回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,502,408,100
第124回利付国債(20年)	500,000,000	604,440,000
第125回利付国債(20年)	620,000,000	766,121,600
第126回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,247,855,300
第127回利付国債(20年)	670,000,000	803,611,400
第128回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,369,265,400
第129回利付国債(20年)	220,000,000	261,538,200
第130回利付国債(20年)	935,000,000	1,113,519,550
第131回利付国債(20年)	380,000,000	447,795,800
第132回利付国債(20年)	840,000,000	991,384,800
第133回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,288,396,800
第134回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,194,870,000
第135回利付国債(20年)	550,000,000	649,638,000
第136回利付国債(20年)	570,000,000	665,885,400
第137回利付国債(20年)	710,000,000	839,276,800
第138回利付国債(20年)	340,000,000	392,968,600
第139回利付国債(20年)	510,000,000	596,547,000
第140回利付国債(20年)	1,680,000,000	1,988,616,000

	第141回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,302,862,000	
	第142回利付国債（20年）	520,000,000	623,376,000	
	第143回利付国債（20年）	1,010,000,000	1,183,790,700	
	第144回利付国債（20年）	1,720,000,000	1,990,917,200	
	第145回利付国債（20年）	1,955,000,000	2,321,093,300	
	第146回利付国債（20年）	1,720,000,000	2,044,409,200	
	第147回利付国債（20年）	1,990,000,000	2,337,533,600	
	第148回利付国債（20年）	1,300,000,000	1,507,142,000	
	第149回利付国債（20年）	2,030,000,000	2,354,921,800	
	第150回利付国債（20年）	1,990,000,000	2,278,410,700	
	第151回利付国債（20年）	1,765,000,000	1,966,545,350	
	第152回利付国債（20年）	1,850,000,000	2,059,494,000	
	第153回利付国債（20年）	1,930,000,000	2,178,236,600	
	第154回利付国債（20年）	1,810,000,000	2,012,882,900	
	第155回利付国債（20年）	1,910,000,000	2,059,744,000	
	第156回利付国債（20年）	1,730,000,000	1,691,334,500	
	第157回利付国債（20年）	2,010,000,000	1,891,852,200	
	第158回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,761,114,200	
	第159回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,707,004,000	
	第160回利付国債（20年）	1,950,000,000	1,987,362,000	
	第161回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,638,606,000	
	第162回利付国債（20年）	1,990,000,000	1,984,925,500	
	第163回利付国債（20年）	1,680,000,000	1,671,348,000	
	第164回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,735,357,600	
	第165回利付国債（20年）	870,000,000	845,709,600	
	国債証券合計	320,730,000,000	343,481,835,450	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,827,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,135,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	128,400,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	125,746,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,857,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,911,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	233,114,000	
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	231,870,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	102,879,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	103,142,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	102,929,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	206,464,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,031,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,561,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	103,811,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,989,000	

第764回東京都公募公債	150,000,000	150,363,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,124,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,785,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	102,953,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	206,140,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,142,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,219,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,142,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,040,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	132,555,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	115,968,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,037,000	
第172回神奈川県公募公債	100,000,000	101,919,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,092,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,285,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	199,748,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	233,964,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,719,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,412,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,189,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,228,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,637,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,414,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	153,805,580	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,450,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,211,000	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	196,750,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	102,246,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	116,797,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,590,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,747,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	105,581,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,659,000	
第4回兵庫県公募公債（12年）	200,000,000	208,066,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	107,704,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,200,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,539,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,004,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	112,421,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	95,275,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	106,450,674	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,994,000	

平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,710,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,700,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,914,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,867,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	120,343,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,456,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,117,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,024,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,545,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,105,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,592,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,312,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,874,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	94,458,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	120,105,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,213,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,095,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,072,721	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	199,234,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	118,860,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,857,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	198,790,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,579,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,344,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,026,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,245,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,133,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,321,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,700,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,878,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	117,402,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,737,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,131,000	

平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	206,264,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,450,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	125,043,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,210,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	94,242,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	115,984,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	122,503,200	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,728,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,904,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,727,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,134,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	220,000,000	219,549,000	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,797,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,720,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,801,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,000,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	368,285,560	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,026,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,419,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,352,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,576,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,057,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,007,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,759,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,404,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,630,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,028,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,947,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,036,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,153,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,894,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,669,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,352,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,534,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,438,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,894,898	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,411,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,477,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,968,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,994,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,796,000	



第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,795,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,288,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,312,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	192,759,201	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,821,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	205,990,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,103,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,731,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	238,396,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,303,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	130,523,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	117,776,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,037,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,857,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	104,103,240	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,274,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,990,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,388,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,588,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	141,711,600	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	240,144,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,547,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,828,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,198,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,754,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	200,256,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,440,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	110,642,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,092,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,916,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	116,759,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,636,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,050,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	198,660,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	144,588,200	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	119,157,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,116,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,125,000	

	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,588,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,081,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,658,750	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,685,500	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	206,362,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,584,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	118,084,000	
	地方債証券合計	22,080,220,000	23,127,832,624	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,242,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,882,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,244,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,472,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,674,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,380,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,632,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,560,000	
	第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,582,000	
	第14回道路債券	100,000,000	107,763,000	
	第17回道路債券	100,000,000	106,206,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	466,700,000	
	第21回道路債券	100,000,000	130,935,000	
	第28回道路債券	200,000,000	265,342,000	
	第33回道路債券	200,000,000	268,868,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,499,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,069,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,192,000	
	第42回道路債券	100,000,000	113,123,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,279,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,133,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,569,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,386,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	238,706,000	

第 9 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,832,000	
第 1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,894,000	
第 1 0 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,333,000	
第 1 0 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,899,000	
第 1 1 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,990,000	
第 1 1 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,310,000	
第 1 1 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,067,000	
第 1 2 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,028,000	
第 1 2 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,512,000	
第 1 2 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,501,000	
第 1 2 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,852,000	
第 1 3 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,403,000	
第 1 3 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,167,000	
第 1 4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,980,000	
第 1 4 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,303,000	
第 1 5 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,364,000	
第 1 5 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	310,105,250	
第 1 6 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,636,000	
第 1 6 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,370,000	
第 1 7 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,116,000	
第 1 8 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,141,000	
第 1 8 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,079,000	
第 1 8 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,525,000	
第 1 8 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,512,000	
第 1 8 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,772,000	
第 1 8 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,714,000	
	300,000,000	308,103,000	

第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,130,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	153,693,560	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,257,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	227,250,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	105,482,280	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,370,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,143,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,873,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,431,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,647,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,054,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,220,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	105,748,100	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	314,198,800	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	204,323,500	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,832,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,364,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,780,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	519,755,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,766,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,828,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	317,556,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	114,732,200	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,328,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,245,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	131,860,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,606,800	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	237,416,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,271,000	

第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,104,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,002,830	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,709,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	117,349,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,271,390	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,386,530	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,594,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	115,938,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,009,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	514,970,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,058,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,480,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,347,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,678,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,930,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,542,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,290,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,954,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,558,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,957,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,298,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,783,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,472,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,671,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,470,390	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,869,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,781,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,948,300	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,409,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,173,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,793,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,836,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	112,831,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,717,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,869,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,236,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	102,503,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,819,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	106,639,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,913,200	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,126,000	16,896,016	

第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,361,000	17,223,715	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,653,000	17,681,988	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,919,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,999,000	17,971,002	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,842,000	18,855,425	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,378,000	14,865,845	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,034,000	31,592,464	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,440,000	18,347,926	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,847,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,820,000	16,671,274	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,298,000	19,320,675	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,776,000	16,638,000	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,994,000	18,919,611	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,227,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,667,000	19,127,141	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,054,000	19,509,390	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,848,000	26,757,320	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,403,000	27,409,074	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,391,000	29,650,209	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,820,000	32,962,298	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,965,000	35,264,308	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,004,000	36,280,227	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,404,000	76,236,622	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,357,000	17,018,640	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,510,000	38,729,808	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,272,000	16,915,720	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,812,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,076,000	16,946,515	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,462,000	42,011,639	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,945,000	15,722,588	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,441,000	42,083,941	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,081,000	39,573,955	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,823,000	17,840,623	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,994,000	78,288,611	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,825,000	42,163,524	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,035,000	17,923,034	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,639,000	54,409,432	

第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,415,000	52,061,667	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,279,000	51,967,169	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,013,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	105,054,000	110,329,811	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,896,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,959,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,692,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	112,326,000	116,766,246	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,751,000	58,912,078	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,524,000	59,177,801	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,911,000	60,719,104	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,706,000	54,037,423	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,971,000	53,889,249	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,466,000	60,292,177	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,436,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,009,000	54,951,249	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,960,000	62,008,233	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,047,000	63,172,046	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,145,000	63,097,971	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,169,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,519,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,408,000	134,540,629	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,904,000	67,705,156	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,902,000	138,633,630	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,654,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,933,000	77,709,072	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,985,000	81,563,903	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,879,000	80,898,302	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,070,000	166,742,478	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,644,000	81,812,706	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,429,000	86,765,150	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,794,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,116,000	91,719,901	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,387,000	91,755,996	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,576,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,582,000	92,397,761	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,098,000	93,385,672	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,635,000	93,753,916	

第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,269,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,448,000	95,372,596	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,834,000	95,939,417	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,054,000	95,851,326	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,421,000	96,206,945	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,629,000	96,457,000	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,266,000	193,504,477	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,086,000	96,861,731	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,246,000	195,310,431	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,984,000	97,748,838	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,828,000	195,944,242	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,955,000	98,608,657	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,976,000	197,784,133	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,634,000	198,394,272	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	124,165,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,909,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,097,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,982,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,695,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,688,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	112,420,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,219,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,711,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,534,000	
い第780号農林債	100,000,000	100,412,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,941,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,878,000	
第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,654,000	
第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,297,000	
第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,406,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,998,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	99,978,000	
第218号商工債（3年）	300,000,000	300,072,000	
第221号商工債（3年）	200,000,000	199,996,000	



	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,970,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,176,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,751,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,454,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,447,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,184,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,048,000	
	特殊債券合計	28,006,634,000	29,465,689,851	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,797,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,894,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,458,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,551,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,138,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,655,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,259,000	
	第7回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,452,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,686,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,456,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	100,177,000	
	第1回HSBC・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,429,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	106,942,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,154,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,604,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	199,586,000	
	第9回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	100,299,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,746,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,435,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,567,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,396,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,665,000	

第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,876,000	
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,656,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,954,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,778,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,726,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,172,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,934,000	
第11回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,798,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,700,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,856,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,098,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,632,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,398,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,515,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,193,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	99,746,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,456,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,675,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,975,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,392,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,379,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,958,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,408,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,936,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,403,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,666,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,335,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,631,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,224,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,629,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,077,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,098,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,040,000	

第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,208,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,263,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,384,000	
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	100,444,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,903,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,174,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,374,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,422,000	
第2回ユニバーファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,123,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,190,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,063,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,535,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	123,685,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,448,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,933,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,669,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,981,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	102,357,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,815,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,544,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	308,601,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,540,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,579,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,348,000	
第23回リコー株式会社無担保社債	100,000,000	99,659,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,430,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,201,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,342,000	

第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,266,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,613,000	
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,295,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,943,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,597,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,832,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,211,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,815,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,044,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,031,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,279,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,361,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,659,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,261,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,118,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,450,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,943,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,283,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,436,020	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,509,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	90,613,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,606,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,508,800	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	128,487,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,829,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	95,757,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,778,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,591,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,564,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,707,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,700,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	120,140,400	

第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,085,300	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,235,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,980,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,532,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,617,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,781,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,338,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,849,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,793,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,226,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,549,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,872,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,643,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,028,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,494,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,633,460	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,911,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,437,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,552,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,947,000	
第449回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,752,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,922,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,620,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,264,520	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,590,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,917,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,605,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,074,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,527,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,633,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,320,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担 保社債	100,000,000	101,316,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担 保社債	100,000,000	99,549,000	
社債券合計	16,696,000,000	17,035,483,500	
合計		413,110,841,425	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2018年10月 1日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,038,225,770
コール・ローン	435,342,924
株式	343,200,267,590
投資信託受益証券	262,915,699
投資証券	7,826,228,568
派生商品評価勘定	142,928,532
未収入金	3,246,386
未収配当金	432,344,892
差入委託証拠金	2,721,838,437
流動資産合計	366,063,338,798
資産合計	366,063,338,798
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,472,444
前受金	140,428,288
未払解約金	105,806,442
未払利息	1,087
その他未払費用	369
流動負債合計	247,708,630
負債合計	247,708,630
純資産の部	
元本等	
元本	136,878,559,539
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	228,937,070,629
元本等合計	365,815,630,168
純資産合計	365,815,630,168
負債純資産合計	366,063,338,798

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年10月 1日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

	2018年10月 1日現在
	<p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p>

	2018年10月 1日現在
	約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年10月 1日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	136,878,559,539口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.6726円 (1万口当たり純資産額) (26,726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

	2018年10月 1日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項



2018年10月 1日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2018年10月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年10月 3日
期首元本額	137,670,547,577円
期中追加設定元本額	20,114,459,781円

区分	2018年10月 1日現在
期中一部解約元本額	20,906,447,819円
期末元本額	136,878,559,539円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,284,822,952円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,814,149円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,132,129,821円
世界経済インデックスファンド	7,182,262,377円
外国株式インデックス・オープン	870,308,386円
D C マイセレクション 2 5	964,501,805円
D C マイセレクション 5 0	4,636,279,976円
D C マイセレクション 7 5	5,071,048,517円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,789,231,609円
D C マイセレクション S 2 5	380,340,471円
D C マイセレクション S 5 0	1,847,050,040円
D C マイセレクション S 7 5	1,454,153,991円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	108,363,789円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	172,714,339円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	111,346,738円
D C 世界経済インデックスファンド	5,797,923,931円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,654,688,588円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	13,066,857円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	12,692,257円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	60,008,269円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	79,141,989円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	270,056,066円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	41,448,752円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	392,166,660円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	804,838,793円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	405,622,345円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,708,901,782円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,996,728,366円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	92,120,843円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	393,207,687円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	83,028,649円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	131,814,645円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,024,775,339円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,324,017,044円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,441,621,464円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,820,124,979円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,387,163,139円
分散投資コア戦略ファンド A	2,053,181,773円
分散投資コア戦略ファンド S	4,281,932,557円

区分	2018年10月 1日現在
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	713,040,075円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	858,470,605円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,764,499,775円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	858,435,068円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	44,552,408円
S M T インデックスバランス・オープン	294,897,440円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,968,406,936円
外国株式 S M T B セレクション（S M A 専用）	29,797,799,734円
S M T 世界経済インデックス・オープン	33,475,070円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	270,303,221円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	40,220,605円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	617,653円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	29,163,822円
グローバル経済コア	1,288,233,766円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	3,420,282円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	189,588円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	1,520,717,617円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,332,503,541円
外株インデックス・ファンド 2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	774,970,599円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年10月 1日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,052,560,498
投資信託受益証券	15,761,674
投資証券	310,857,728
合計	14,379,179,900

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2018年10月 1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	15,345,377,962	-	15,485,806,250	140,428,288
	合計	15,345,377,962	-	15,485,806,250	140,428,288

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2018年10月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,312,120,300	-	1,313,148,100	1,027,800
	アメリカドル	1,025,226,800	-	1,026,263,100	1,036,300
	カナダドル	88,604,000	-	88,600,000	4,000
	ユーロ	198,289,500	-	198,285,000	4,500
合計		1,312,120,300	-	1,313,148,100	1,027,800

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,380	67.41	2,991,655.80	
	ANDEAVOR	11,677	153.50	1,792,419.50	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	17.71	330,043.56	
	APACHE CORP	29,810	47.67	1,421,042.70	
	BAKER HUGHES A GE CO	35,210	33.83	1,191,154.30	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	22.52	807,995.08	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	69.49	1,090,367.59	
	CHEVRON CORP	154,681	122.28	18,914,392.68	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	92.94	706,251.06	

CONCHO RESOURCES INC	16,193	152.75	2,473,480.75
CONOCOPHILLIPS	96,082	77.40	7,436,746.80
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	68.28	522,137.16
DEVON ENERGY CORPORATION	43,420	39.94	1,734,194.80
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,239	135.19	1,113,830.41
EOG RESOURCES INC	46,520	127.57	5,934,556.40
EQT CORPORATION	22,120	44.23	978,367.60
EXXON MOBIL	342,921	85.02	29,155,143.42
HALLIBURTON CO	71,448	40.53	2,895,787.44
HELMERICH & PAYNE	8,315	68.77	571,822.55
HESS CORP	22,081	71.58	1,580,557.98
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	69.90	986,289.00
KINDER MORGAN INC	157,150	17.73	2,786,269.50
MARATHON OIL CORP	65,596	23.28	1,527,074.88
MARATHON PETROLEUM CORP	38,566	79.97	3,084,123.02
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	43.08	1,305,797.88
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	28.83	463,384.59
NOBLE ENERGY INC	38,291	31.19	1,194,296.29
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,287	82.17	5,118,122.79
ONEOK INC	33,743	67.79	2,287,437.97
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	29.25	598,893.75
PHILLIPS 66	36,131	112.72	4,072,686.32
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	174.19	2,342,855.50
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	24.53	242,601.70
SCHLUMBERGER	112,385	60.92	6,846,494.20
TARGA RESOURCES CORP	16,467	56.31	927,256.77
TECHNIPFMC PLC	36,005	31.25	1,125,156.25
VALERO ENERGY CORP	35,381	113.75	4,024,588.75
WILLIAMS COS	98,038	27.19	2,665,653.22
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,922	167.05	2,993,870.10
ALBEMARLE CORP	8,647	99.78	862,797.66
AVERY DENNISON CORP	7,457	108.35	807,965.95
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	29.16	513,390.96
BALL CORP	27,142	43.99	1,193,976.58
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	114.00	1,260,042.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	54.44	964,731.24
CHEMOURS CO/THE	15,493	39.44	611,043.92
CROWN HOLDINGS INC	10,321	48.00	495,408.00
DOWDUPONT INC	187,231	64.31	12,040,825.61
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	95.72	1,135,047.76
ECOLAB INC	20,812	156.78	3,262,905.36
FMC CORP	10,402	87.18	906,846.36

FREEMPORT-MCMORAN INC	111,396	13.92	1,550,632.32
INT'L PAPER CO	30,605	49.15	1,504,235.75
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	139.12	844,458.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	102.51	2,739,067.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	181.95	907,748.55
MOSAIC CO/THE	27,677	32.48	898,948.96
NEWMONT MINING CORP	42,952	30.20	1,297,150.40
NUCOR CORP	24,915	63.45	1,580,856.75
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	109.69	790,316.45
PPG INDUSTRIES INC	19,958	109.13	2,178,016.54
PRAXAIR INC	23,446	160.73	3,768,475.58
SEALED AIR CORP	14,689	40.15	589,763.35
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,932	455.21	3,155,515.72
STEEL DYNAMICS INC	18,273	45.19	825,756.87
VULCAN MATERIALS CO	10,740	111.20	1,194,288.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	83.11	287,145.05
WESTROCK CO	21,244	53.44	1,135,279.36
3 M COMPANY	48,314	210.71	10,180,242.94
ACUITY BRANDS INC	3,505	157.20	550,986.00
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	57.52	651,701.60
AGCO CORP	4,669	60.79	283,828.51
ALLEGION PLC	7,168	90.57	649,205.76
AMETEK INC	18,866	79.12	1,492,677.92
ARCONIC INC	36,550	22.01	804,465.50
BOEING CO	45,238	371.90	16,824,012.20
CATERPILLAR	48,537	152.49	7,401,407.13
CUMMINS INC	12,421	146.07	1,814,335.47
DEERE&CO	25,056	150.33	3,766,668.48
DOVER CORP	12,008	88.53	1,063,068.24
EATON CORP	35,279	86.73	3,059,747.67
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	76.58	3,899,989.66
FASTENAL CO	23,228	58.02	1,347,688.56
FLOWSERVE CORP	10,826	54.69	592,073.94
FLUOR CORP	11,267	58.10	654,612.70
FORTIVE CORP	25,813	84.20	2,173,454.60
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	52.36	670,731.60
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	204.72	4,107,092.64
GENERAL ELECTRIC CO	704,286	11.29	7,951,388.94
GRAINGER (WW) INC	3,976	357.41	1,421,062.16
HARRIS CORP	9,793	169.21	1,657,073.53
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	42.79	651,520.54
HONEYWELL INTL INC	61,022	166.40	10,154,060.80

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	256.08	901,913.76
IDEX CORP	5,756	150.66	867,198.96
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	141.12	3,461,391.36
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	102.30	2,071,472.70
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	76.50	741,514.50
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	62.75	1,041,650.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	36.30	598,950.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	35.00	2,607,080.00
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	212.62	1,300,596.54
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	218.40	630,084.00
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	345.96	7,226,066.52
MASCO CORP	24,547	36.60	898,420.20
MIDDLEBY CORP	4,364	129.35	564,483.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,479	317.37	4,277,830.23
OWENS CORNING	7,979	54.27	433,020.33
PACCAR INC	27,548	68.19	1,878,498.12
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	183.93	1,904,411.22
PENTAIR PLC	13,583	43.35	588,823.05
RAYTHEON COMPANY	23,492	206.66	4,854,856.72
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	187.52	1,971,022.72
ROCKWELL COLLIN	13,112	140.47	1,841,842.64
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	296.21	2,399,301.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	49.55	685,177.40
SMITH (A.O.) CORP	12,146	53.37	648,232.02
SNAP-ON INC	4,900	183.60	899,640.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	91.67	777,453.27
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	146.44	1,759,476.60
TEXTRON	21,877	71.47	1,563,549.19
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	372.30	1,516,005.60
UNITED RENTALS INC	6,446	163.60	1,054,565.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,841	139.81	8,506,180.21
WABCO HOLDINGS INC	3,841	117.94	453,007.54
WABTEC CORP	7,158	104.88	750,731.04
XYLEM INC	13,941	79.87	1,113,467.67
CINTAS CORP	7,034	197.81	1,391,395.54
COPART INC	17,540	51.53	903,836.20
COSTAR GROUP INC	3,008	420.84	1,265,886.72
EQUIFAX INC	9,276	130.57	1,211,167.32
IHS MARKIT LTD	32,775	53.96	1,768,539.00
MANPOWER GROUP	5,123	85.96	440,373.08
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	27.66	760,760.64
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	72.66	1,341,376.26

ROBERT HALF INTL INC	9,566	70.38	673,255.08
ROLLINS INC	7,031	60.69	426,711.39
STERICYCLE INC	6,767	58.68	397,087.56
TRANSUNION	15,344	73.58	1,129,011.52
VERISK ANALYTICS INC	12,301	120.55	1,482,885.55
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	79.77	1,627,946.16
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	90.36	3,156,365.16
AMERCO	602	356.65	214,703.30
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	41.33	409,993.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	97.92	1,120,988.16
CSX CORP	68,519	74.05	5,073,831.95
DELTA AIR LINES INC	15,095	57.83	872,943.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	73.53	1,014,934.59
FEDEX CORP	20,716	240.79	4,988,205.64
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	118.94	848,517.96
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	113.28	990,407.04
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	34.48	368,936.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	180.50	4,115,219.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	161.26	845,808.70
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	62.45	715,989.25
UNION PACIFIC CORP	63,871	162.83	10,400,114.93
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	89.06	534,627.18
UNITED PARCEL SERVICE B	55,212	116.75	6,446,001.00
XPO LOGISTICS INC	10,037	114.17	1,145,924.29
APTIV PLC	20,954	83.90	1,758,040.60
AUTOLIV INC	6,639	86.68	575,468.52
BORGWARNER INC	15,953	42.78	682,469.34
FORD MOTOR COMPANY	299,765	9.25	2,772,826.25
GENERAL MOTORS CO	101,158	33.67	3,405,989.86
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	23.39	505,855.53
HARLEY-DAVIDSON	14,677	45.30	664,868.10
LEAR CORP	5,287	145.00	766,615.00
TESLA INC	10,369	264.77	2,745,400.13
DR HORTON INC	28,586	42.18	1,205,757.48
GARMIN LTD	9,564	70.05	669,958.20
HANESBRANDS INC	31,136	18.43	573,836.48
HASBRO INC	9,007	105.12	946,815.84
LEGGETT & PLATT INC	10,594	43.79	463,911.26
LENNAR CORP-CL A	23,545	46.69	1,099,316.05
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	162.49	1,376,615.28
MATTEL INC	27,399	15.70	430,164.30
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	68.56	791,662.32



MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	175.35	887,621.70
NEWELL BRANDS INC	37,563	20.30	762,528.90
NIKE B	105,293	84.72	8,920,422.96
NVR INC	264	2,470.80	652,291.20
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	100.95	473,556.45
PULTE GROUP INC	21,959	24.77	543,924.43
PVH CORP	5,820	144.40	840,408.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	137.55	629,703.90
TAPESTRY INC	22,032	50.27	1,107,548.64
TOLL BROTHERS INC	11,211	33.03	370,299.33
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	21.22	338,459.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	19.46	316,867.18
VF CORP	26,718	93.45	2,496,797.10
WHIRLPOOL CORP	5,324	118.75	632,225.00
ARAMARK	19,980	43.02	859,539.60
BLOCK H & R INC	16,984	25.75	437,338.00
CARNIVAL CORPORATION	35,126	63.77	2,239,985.02
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	454.52	897,677.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	111.19	1,115,346.89
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	294.80	1,017,944.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	80.78	1,900,187.94
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	59.33	1,918,791.53
MARRIOTT INTL A	25,016	132.03	3,302,862.48
MCDONALD'S CORP	63,834	167.29	10,678,789.86
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	21.15	373,551.30
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	27.91	1,246,348.96
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	57.43	1,024,436.34
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	129.94	1,804,216.90
STARBUCKS CORP	113,248	56.84	6,437,016.32
VAIL RESORTS INC	2,987	274.42	819,692.54
WYNN RESORTS LTD	8,052	127.06	1,023,087.12
YUM BRANDS INC	27,323	90.91	2,483,933.93
CBS CORP-CL B	28,628	57.45	1,644,678.60
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	325.88	4,442,396.16
COMCAST CORP-CL A	373,142	35.41	13,212,958.22
DISCOVERY INC - A	12,804	32.00	409,728.00
DISCOVERY INC-C	23,672	29.58	700,217.76
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	35.76	651,475.68
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	22.87	773,783.58
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	84.30	730,290.90
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	28.93	448,877.88
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	28.16	1,302,991.36

LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	37.19	521,031.90
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	43.45	661,873.85
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	43.44	277,320.96
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	54.47	688,337.39
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.19	441,588.01
OMNICOM GROUP	19,030	68.02	1,294,420.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.32	818,471.60
THE WALT DISNEY CO	121,890	116.94	14,253,816.60
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,135	46.33	3,990,634.55
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,459	45.82	1,670,551.38
VIACOM INC-CLASS B	26,755	33.76	903,248.80
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	168.33	1,041,289.38
AMAZON.COM	33,277	2,003.00	66,653,831.00
AUTOZONE INC	2,151	775.70	1,668,530.70
BEST BUY COMPANY INC	21,836	79.36	1,732,904.96
BOOKING HOLDINGS INC	3,909	1,984.00	7,755,456.00
CARMAX INC	14,253	74.67	1,064,271.51
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	109.30	2,440,669.00
DOLLAR TREE INC	19,550	81.55	1,594,302.50
EXPEDIA GROUP INC	9,800	130.48	1,278,704.00
GAP	16,326	28.85	471,005.10
GENUINE PARTS CO	11,245	99.40	1,117,753.00
HOME DEPOT	94,571	207.15	19,590,382.65
KOHL'S CORP	12,602	74.55	939,479.10
L BRANDS INC	19,499	30.30	590,819.70
LKQ CORP	24,693	31.67	782,027.31
LOWES COMPANIES	66,782	114.82	7,667,909.24
MACY'S INC	25,926	34.73	900,409.98
NETFLIX INC	35,175	374.13	13,160,022.75
NORDSTROM INC	10,094	59.81	603,722.14
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	347.32	2,293,353.96
QURATE RETAIL INC	35,071	22.21	778,926.91
ROSS STORES INC	30,239	99.10	2,996,684.90
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	88.21	3,690,353.56
TIFFANY & CO	9,326	128.97	1,202,774.22
TJX COMPANIES INC	51,517	112.02	5,770,934.34
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	90.88	859,361.28
TRIPADVISOR INC	10,393	51.07	530,770.51
ULTA BEAUTY INC	4,911	282.12	1,385,491.32
COSTCO WHOLESALE CORP	35,674	234.88	8,379,109.12
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	9.00	305,100.00
KROGER CO	72,735	29.11	2,117,315.85

SYSCO CORP	40,229	73.25	2,946,774.25
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,797	72.90	4,942,401.30
WALMART INC	119,581	93.91	11,229,851.71
ALTRIA GROUP INC	152,862	60.31	9,219,107.22
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	50.27	2,240,383.09
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	50.55	1,114,122.00
BUNGE LIMITED	11,767	68.71	808,510.57
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	36.63	515,457.36
COCA-COLA CO	328,376	46.19	15,167,687.44
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	45.47	776,445.72
CONAGRA BRANDS INC	33,243	33.97	1,129,264.71
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	215.62	3,022,561.16
GENERAL MILLS INC	44,875	42.92	1,926,035.00
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	102.00	1,142,400.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	39.40	924,521.00
INGREDION INC	5,835	104.96	612,441.60
JM SMUCKER CO	9,442	102.61	968,843.62
KELLOGG CO	21,051	70.02	1,473,991.02
KRAFT HEINZ CO/THE	49,892	55.11	2,749,548.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	131.75	1,222,113.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	61.50	928,650.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,242	42.96	5,165,596.32
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	58.28	2,035,836.96
PEPSICO INC	115,115	111.80	12,869,857.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,990	81.54	10,273,224.60
TYSON FOODS INC	24,363	59.53	1,450,329.39
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	59.37	1,132,957.71
CLOROX COMPANY	10,045	150.41	1,510,868.45
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,784	66.95	4,538,138.80
COTY INC-CL A	39,000	12.56	489,840.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	145.32	2,589,893.04
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	113.64	3,180,783.60
PROCTER & GAMBLE CO	202,806	83.23	16,879,543.38
ABBOTT LABORATORIES	142,028	73.36	10,419,174.08
ABIOMED INC	3,502	449.75	1,575,024.50
AETNA INC	26,686	202.85	5,413,255.10
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	391.22	2,450,602.08
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	92.22	1,184,750.34
ANTHEM INC	20,871	274.05	5,719,697.55
BAXTER INTERNATIONAL	42,071	77.09	3,243,253.39
BECTON DICKINSON & CO	21,729	261.00	5,671,269.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,569	38.50	4,333,906.50

CARDINAL HEALTH	25,252	54.00	1,363,608.00
CENTENE CORP	16,736	144.78	2,423,038.08
CERNER CORP	23,088	64.41	1,487,098.08
CIGNA CORP	19,408	208.25	4,041,716.00
CVS HEALTH CORP	81,494	78.72	6,415,207.68
DANAHER CORP	50,460	108.66	5,482,983.60
DAVITA INC	11,875	71.63	850,606.25
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	37.74	673,055.16
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	174.10	2,920,701.60
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,189	95.01	4,388,416.89
HCA HEALTHCARE INC	23,027	139.12	3,203,516.24
HENRY SCHEIN INC	12,492	85.03	1,062,194.76
HOLOGIC INC	21,094	40.98	864,432.12
HUMANA INC	11,281	338.52	3,818,844.12
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	249.66	1,798,800.30
INTUITIVE SURGICAL INC	9,061	574.00	5,201,014.00
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	173.68	1,381,277.04
MCKESSON CORP	16,655	132.65	2,209,285.75
MEDTRONIC PLC	110,187	98.37	10,839,095.19
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	107.91	1,136,508.12
RESMED INC	10,895	115.34	1,256,629.30
STRYKER CORP	27,181	177.68	4,829,520.08
TELEFLEX INC	3,697	266.09	983,734.73
THE COOPER COS INC	4,135	277.15	1,146,015.25
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,518	266.04	20,888,928.72
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	127.84	926,584.32
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	111.93	786,420.18
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	108.87	1,062,680.07
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	131.47	2,111,802.61
ABBVIE INC	122,922	94.58	11,625,962.76
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	70.54	1,786,284.42
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	139.01	2,464,508.29
ALKERMES PLC	12,547	42.44	532,494.68
ALLERGAN PLC	26,330	190.48	5,015,338.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	87.52	647,560.48
AMGEN	54,777	207.29	11,354,724.33
BIOGEN INC	17,262	353.31	6,098,837.22
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	96.97	1,390,646.77
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,920	62.08	8,251,673.60
CELGENE CORP	61,389	89.49	5,493,701.61
GILEAD SCIENCES INC	106,635	77.21	8,233,288.35
ILLUMINA INC	12,043	367.06	4,420,503.58

INCYTE CORP	14,121	69.08	975,478.68
IQVIA HOLDINGS INC	13,021	129.74	1,689,344.54
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	168.13	835,774.23
JOHNSON & JOHNSON	217,581	138.17	30,063,166.77
LILLY (ELI) & CO	79,730	107.31	8,555,826.30
MERCK & CO	218,364	70.94	15,490,742.16
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	608.98	1,221,613.88
MYLAN NV	42,644	36.60	1,560,770.40
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	60.96	823,386.72
PERRIGO CO PLC	11,333	70.80	802,376.40
PFIZER	483,121	44.07	21,291,142.47
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,550	404.04	2,646,462.00
SEATTLE GENETICS INC	9,601	77.12	740,429.12
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	21.54	1,738,062.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,238	244.08	7,868,651.04
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	127.88	415,226.36
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,799	192.74	4,008,799.26
WATERS CORP	6,513	194.68	1,267,950.84
ZOETIS INC	39,742	91.56	3,638,777.52
BANK OF AMERICA CORP	787,725	29.46	23,206,378.50
BB&T CORP	64,293	48.54	3,120,782.22
CIT GROUP INC	10,713	51.61	552,897.93
CITIGROUP	208,262	71.74	14,940,715.88
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	38.57	1,543,185.70
COMERICA INC	14,360	90.20	1,295,272.00
EAST WEST BANCORP INC	10,794	60.37	651,633.78
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	27.92	1,625,418.64
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	96.00	1,207,488.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	14.92	1,304,276.56
JPMORGAN CHASE & CO	276,972	112.84	31,253,520.48
KEY CORP	87,033	19.89	1,731,086.37
M & T BANK CORP	11,745	164.54	1,932,522.30
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	10.37	405,415.15
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	17.12	468,814.08
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	136.19	5,161,464.81
REGIONS FINL CORP	96,209	18.35	1,765,435.15
SIGNATURE BANK	4,354	114.84	500,013.36
SUNTRUST BANKS	38,353	66.79	2,561,596.87
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	310.83	1,364,543.70
US BANCORP	127,580	52.81	6,737,499.80
WELLS FARGO & CO	378,753	52.56	19,907,257.68
ZIONS BANCORPORATION	15,186	50.15	761,577.90

AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	136.72	606,079.76
ALLY FINANCIAL INC	36,028	26.45	952,940.60
AMERICAN EXPRESS	59,473	106.49	6,333,279.77
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	147.66	1,749,771.00
BANK NEW YORK CO	81,361	50.99	4,148,597.39
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,404	214.11	22,139,830.44
BLACKROCK INC	9,812	471.33	4,624,689.96
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,702	94.93	3,768,910.86
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	95.96	908,741.20
CME GROUP INC	27,733	170.21	4,720,433.93
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	76.45	2,260,244.25
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	52.39	1,105,848.12
EATON VANCE CORP	10,061	52.56	528,806.16
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	30.41	792,788.70
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,328	224.24	6,576,510.72
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,906	74.89	3,512,790.34
INVESCO LTD	30,943	22.88	707,975.84
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	21.96	564,503.76
MOODY'S CORP	14,116	167.20	2,360,195.20
MORGAN STANLEY	108,682	46.57	5,061,320.74
MSCI INC	6,934	177.41	1,230,160.94
NASDAQ INC	9,070	85.80	778,206.00
NORTHERN TRUST CORP	17,320	102.13	1,768,891.60
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	109.18	2,190,805.88
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	92.05	914,240.60
S&P GLOBAL INC	20,491	195.39	4,003,736.49
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,603	49.15	4,846,337.45
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	61.10	660,002.20
STATE STREET CORP	29,345	83.78	2,458,524.10
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	31.08	1,875,584.76
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	52.83	1,236,433.32
VOYA FINANCIAL INC	14,081	49.67	699,403.27
AFLAC	61,894	47.07	2,913,350.58
ALLEGHANY CORP	1,276	652.53	832,628.28
ALLSTATE CORP	28,446	98.70	2,807,620.20
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	110.97	615,772.53
AMERICAN INT'L GROUP	72,511	53.24	3,860,485.64
AON PLC	20,163	153.78	3,100,666.14
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	29.81	1,029,965.31
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	74.44	1,114,515.68
ASSURANT INC	4,769	107.95	514,813.55
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	51.66	689,506.02

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	57.71	421,398.42
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	44.24	300,655.04
CHUBB LTD	37,790	133.64	5,050,255.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	76.81	953,442.53
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	228.47	766,059.91
FNF GROUP	20,786	39.35	817,929.10
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	49.96	1,431,953.52
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	67.66	1,203,671.40
LOEWS CORP	22,051	50.23	1,107,621.73
MARKEL CORP	1,132	1,188.49	1,345,370.68
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	82.72	3,378,119.36
METLIFE INC	71,520	46.72	3,341,414.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	58.59	1,356,651.45
PROGRESSIVE CORP	46,702	71.04	3,317,710.08
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	101.32	3,398,880.72
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	144.56	785,105.36
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	133.58	434,001.42
TORCHMARK CORP	8,473	86.69	734,524.37
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	129.71	2,829,104.81
UNUM GROUP	18,574	39.07	725,686.18
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	140.94	1,540,474.20
WR BERKLEY CORP	7,296	79.93	583,169.28
CBRE GROUP INC-A	26,855	44.10	1,184,305.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.62	653,394.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	144.32	530,087.36
WEYERHAEUSER CO	62,107	32.27	2,004,192.89
ACCENTURE PLC-CL A	52,076	170.20	8,863,335.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,926	83.19	4,818,863.94
ADOBE SYSTEMS INC	39,430	269.95	10,644,128.50
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	73.15	1,037,120.70
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	236.16	948,418.56
ALPHABET INC-CL A	24,157	1,207.08	29,159,431.56
ALPHABET INC-CL C	25,480	1,193.47	30,409,615.60
ANSYS INC	6,865	186.68	1,281,558.20
AUTODESK INC	18,086	156.11	2,823,405.46
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,768	150.66	5,388,806.88
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	131.95	1,273,317.50
CA INC	26,520	44.15	1,170,858.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	45.32	978,232.20
CDK GLOBAL INC	10,687	62.56	668,578.72
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	117.67	1,270,953.67
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	111.16	1,261,888.32

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,020	77.15	3,704,743.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	97.12	1,537,118.24
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	93.52	2,197,532.96
EBAY	78,686	33.02	2,598,211.72
ELECTRONIC ARTS INC	25,070	120.49	3,020,684.30
FACEBOOK INC-A	193,825	164.46	31,876,459.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,125	109.07	2,958,523.75
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,258	24.47	960,643.26
FISERV INC	33,784	82.38	2,783,125.92
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	227.84	1,632,017.92
FORTINET INC	10,871	92.27	1,003,067.17
GARTNER INC	7,002	158.50	1,109,817.00
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	127.40	1,594,156.20
GODADDY INC - CLASS A	12,570	83.39	1,048,212.30
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	216.72	1,379,206.08
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,706	151.21	11,296,294.26
INTUIT INC	19,851	227.40	4,514,117.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	160.08	957,118.32
LEIDOS HOLDINGS	10,999	69.16	760,690.84
MASTERCARD INC-CLASS A	75,127	222.61	16,724,021.47
MERCADOLIBRE INC	3,264	340.47	1,111,294.08
MICROSOFT CORP	591,521	114.37	67,652,256.77
ORACLE CORP	250,503	51.56	12,915,934.68
PAYCHEX INC	25,506	73.65	1,878,516.90
PAYPAL HOLDINGS INC	91,607	87.84	8,046,758.88
RED HAT INC	13,963	136.28	1,902,877.64
SABRE CORP	17,243	26.08	449,697.44
SALESFORCE.COM INC	55,092	159.03	8,761,280.76
SERVICENOW INC	13,794	195.63	2,698,520.22
SPLUNK INC	11,773	120.91	1,423,473.43
SQUARE INC - A	22,319	99.01	2,209,804.19
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,681	56.83	1,004,811.23
SYMANTEC CORP	48,508	21.28	1,032,250.24
SYNOPSIS INC	12,264	98.61	1,209,353.04
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	137.99	1,318,080.48
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	98.74	1,245,111.40
TWITTER INC	55,701	28.46	1,585,250.46
VERISIGN INC	7,289	160.12	1,167,114.68
VISA INC-CLASS A SHARES	145,964	150.09	21,907,736.76
VMWARE INC-CLASS A	5,821	156.06	908,425.26
WESTERN UNION CO	38,757	19.06	738,708.42
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	145.98	1,560,672.18



WORLDPAY INC-CLASS A	23,418	101.27	2,371,540.86
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	44.25	440,818.50
AMPHENOL CORPORATION	24,215	94.02	2,276,694.30
APPLE INC	398,252	225.74	89,901,406.48
ARISTA NETWORKS INC	4,324	265.86	1,149,578.64
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	73.72	491,417.52
AVNET INC	10,936	44.77	489,604.72
CDW CORP/DE	12,482	88.92	1,109,899.44
CISCO SYSTEMS	390,187	48.65	18,982,597.55
COGNEX CORP	12,660	55.82	706,681.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	30.76	459,339.08
CORNING	71,752	35.30	2,532,845.60
F5 NETWORKS INC	5,350	199.42	1,066,897.00
FLEX LTD	40,465	13.12	530,900.80
FLIR SYSTEMS INC	11,686	61.47	718,338.42
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	16.31	2,115,994.16
HP INC	134,066	25.77	3,454,880.82
IPG PHOTONICS CORP	3,207	156.07	500,516.49
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	29.97	938,180.88
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	66.28	1,050,736.84
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	130.14	1,642,366.80
NETAPP INC	20,821	85.89	1,788,315.69
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	225.26	1,624,349.86
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	47.35	1,081,284.60
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	87.93	2,462,831.37
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	43.46	896,232.12
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	58.54	1,380,197.58
XEROX CORP	16,718	26.98	451,051.64
AT&T INC	587,152	33.58	19,716,564.16
CENTURYLINK INC	73,994	21.20	1,568,672.80
SPRINT CORP	64,825	6.54	423,955.50
T-MOBILE US INC	28,273	70.18	1,984,199.14
VERIZON COMMUNICATIONS	334,367	53.39	17,851,854.13
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	34.72	530,834.08
AES CORP	52,646	14.00	737,044.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	42.57	819,727.92
AMEREN CORPORATION	18,723	63.22	1,183,668.06
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	70.88	2,755,247.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	87.97	1,256,475.51
ATMOS ENERGY CORP	9,385	93.91	881,345.35
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	27.65	869,343.65
CMS ENERGY CORP	21,593	49.00	1,058,057.00

CONSOLIDATED EDISON INC	25,571	76.19	1,948,254.49
DOMINION ENERGY INC	53,227	70.28	3,740,793.56
DTE ENERGY COMPANY	14,355	109.13	1,566,561.15
DUKE ENERGY CORP	57,060	80.02	4,565,941.20
EDISON INTL	26,184	67.68	1,772,133.12
ENERGY CORP	13,854	81.13	1,123,975.02
EVERGY INC	21,492	54.92	1,180,340.64
EVERSOURCE ENERGY	25,381	61.44	1,559,408.64
EXELON CORP	77,742	43.66	3,394,215.72
FIRSTENERGY CORP	39,519	37.17	1,468,921.23
NEXTERA ENERGY INC	37,780	167.60	6,331,928.00
NISOURCE INC	26,021	24.92	648,443.32
OGE ENERGY CORP	15,686	36.32	569,715.52
PG&E CORP	41,241	46.01	1,897,498.41
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	79.18	745,558.88
PPL CORPORATION	53,473	29.26	1,564,619.98
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	52.79	2,143,590.74
SCANA CORP	11,459	38.89	445,640.51
SEMPRA ENERGY	19,952	113.75	2,269,540.00
SOUTHERN CO	81,059	43.60	3,534,172.40
UGI CORP	13,950	55.48	773,946.00
VISTRA ENERGY CORP	29,561	24.88	735,477.68
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	66.76	1,688,160.12
XCEL ENERGY INC	40,763	47.21	1,924,421.23
ADVANCED MICRO DEVICES	77,168	30.89	2,383,719.52
ANALOG DEVICES	30,277	92.46	2,799,411.42
APPLIED MATERIALS	84,218	38.65	3,255,025.70
BROADCOM INC	33,321	246.73	8,221,290.33
INTEL CORP	378,881	47.29	17,917,282.49
KLA-TENCOR CORP	12,266	101.71	1,247,574.86
LAM RESEARCH CORP	12,814	151.70	1,943,883.80
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	37,753	19.30	728,632.90
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	56.39	1,230,937.31
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	78.91	1,469,619.84
MICRON TECHNOLOGY	92,766	45.23	4,195,806.18
NVIDIA CORP	46,674	281.02	13,116,327.48
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	85.50	2,332,696.50
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	18.43	663,406.28
QORVO INC	10,609	76.89	815,726.01
QUALCOMM	107,270	72.03	7,726,658.10
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	90.71	1,316,202.10
TEXAS INSTRUMENTS	79,005	107.29	8,476,446.45

	XILINX INC	20,299	80.17	1,627,370.83
	アメリカドル 小計	24,839,242		2,048,571,506.45 (233,373,266,014)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	27,117	14.40	390,484.80
	CAMECO CORP	28,709	14.73	422,883.57
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,090	42.20	4,223,798.00
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	12.97	1,009,104.91
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	8.22	355,465.68
	ENBRIDGE	138,840	41.68	5,786,851.20
	ENCANA CORP	76,271	16.93	1,291,268.03
	HUSKY ENERGY INC	31,439	22.68	713,036.52
	IMPERIAL OIL	24,763	41.80	1,035,093.40
	INTER PIPELINE LTD	30,317	22.40	679,100.80
	KEYERA CORP	14,929	34.61	516,692.69
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	43.89	1,855,493.64
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	22.69	416,361.50
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	15.40	308,154.00
	SUNCOR ENERGY	134,041	49.98	6,699,369.18
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	22.74	454,004.10
	TRANSCANADA CORP	70,703	52.26	3,694,938.78
	VERMILION ENERGY INC	10,067	42.56	428,451.52
	AGNICO EAGLE MINES	17,661	44.12	779,203.32
	BARRICK GOLD CORP	94,395	14.29	1,348,904.55
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	58.22	764,952.58
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	14.71	836,999.00
	FRANCO-NEVADA CORP	14,257	80.80	1,151,965.60
	GOLDCORP INC	68,688	13.16	903,934.08
	KINROSS GOLD CORP	107,615	3.52	378,804.80
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.84	425,742.12
	METHANEX CORP	7,099	101.96	723,814.04
	NUTRIEN LTD	51,428	74.58	3,835,500.24
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	31.13	1,421,925.01
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	2.75	195,250.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	73.51	318,077.77
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	22.60	832,538.80
	BOMBARDIER B	157,835	4.60	726,041.00
	CAE INC	18,372	26.22	481,713.84
	FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	31.55	371,154.20
	SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	52.67	774,933.71
	WSP GLOBAL INC	9,471	70.69	669,504.99
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,539	115.90	7,016,470.10
	CP RAILWAY LIMITED	11,959	273.23	3,267,557.57

LINAMAR CORP	3,889	59.51	231,434.39
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	67.85	1,898,307.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	39.30	693,998.70
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	76.48	1,405,090.56
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	25.17	904,785.99
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	151.34	818,598.06
DOLLARAMA INC	26,700	40.69	1,086,423.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	64.61	2,200,810.43
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	23.54	270,686.46
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	66.36	1,036,410.48
METRO INC	19,179	40.18	770,612.22
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	97.77	466,851.75
SAPUTO INC	20,412	38.42	784,229.04
AURORA CANNABIS INC	53,000	12.41	657,730.00
BANK MONTREAL	52,905	106.54	5,636,498.70
BANK NOVA SCOTIA	96,431	76.99	7,424,222.69
CANADIAN IMPERIAL BANK	35,345	121.03	4,277,805.35
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	64.51	1,820,988.28
ROYAL BANK OF CANADA	116,879	103.54	12,101,651.66
TORONTO-DOMINION BANK	148,256	78.49	11,636,613.44
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,319	57.49	3,927,659.31
CI FINANCIAL CORP	18,671	20.51	382,942.21
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.50	272,817.50
ONEX CORP	6,603	88.33	583,242.99
THOMSON REUTERS CORP	22,284	58.94	1,313,418.96
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	701.74	1,617,510.70
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.34	745,515.92
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	51.65	425,079.50
INTACT FINANCIAL CORP	10,466	107.40	1,124,048.40
MANULIFE FINANCIAL CORP	160,538	23.09	3,706,822.42
POWER CORP OF CANADA	29,774	28.06	835,458.44
POWER FINANCIAL CORP	20,740	29.59	613,696.60
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	51.35	2,543,673.60
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	19.50	243,067.50
BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.62	576,028.00
CGI GROUP INC - CL A	21,192	83.28	1,764,869.76
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	949.87	1,615,728.87
OPEN TEXT CORP	19,994	49.15	982,705.10
SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	212.30	1,558,706.60
BCE INC	12,539	52.33	656,165.87
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	66.43	1,918,564.83
TELUS CORP	16,454	47.61	783,374.94

	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	20.55	244,257.30
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	37.75	197,847.75
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.76	327,890.24
	EMERA INC	4,086	40.16	164,093.76
	FORTIS INC	34,128	41.88	1,429,280.64
	HYDRO ONE LTD	21,742	19.64	427,012.88
	カナダドル 小計	3,293,712		144,610,768.73 (12,813,960,217)
ユーロ	ENAGAS	18,299	23.25	425,451.75
	ENI	202,686	16.28	3,300,133.45
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	17.09	681,327.03
	NESTE OIL OYJ	11,086	71.20	789,323.20
	OMV AG	12,139	48.39	587,406.21
	REPSOL SA	110,036	17.16	1,888,767.94
	SNAM SPA	173,485	3.58	622,637.66
	TENARIS SA	40,648	14.43	586,550.64
	TOTAL SA	195,662	55.84	10,925,766.08
	VOPAK	6,360	42.44	269,918.40
	AIR LIQUIDE	34,556	113.30	3,915,194.80
	AKZO NOBEL	19,791	80.54	1,593,967.14
	ARCELORMITTAL	53,985	26.80	1,446,798.00
	ARKEMA	5,335	106.70	569,244.50
	BASF SE	73,727	76.55	5,643,801.85
	COVESTRO AG	16,178	69.86	1,130,195.08
	CRH PLC	71,124	28.18	2,004,274.32
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	30.85	415,055.90
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	48.12	277,267.44
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	67.32	767,919.24
	IMERYS SA	3,000	63.60	190,800.00
	K+S AG	14,355	18.08	259,538.40
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	91.24	1,389,950.16
	LANXESS	7,293	63.08	460,042.44
	LINDE AG - TENDER	15,262	203.70	3,108,869.40
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	34.06	666,383.90
	SOLVAY SA	5,511	115.50	636,520.50
	STORA ENSO OYJ R	47,237	16.47	778,229.57
	SYMRISE AG	9,083	78.62	714,105.46
	THYSSEN KRUPP	33,044	21.74	718,376.56
	UMICORE	17,605	48.17	848,032.85
	UPM KYMMENE OYJ	43,990	33.80	1,486,862.00
	VOESTALPINE AG	8,140	39.40	320,716.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,591	36.68	755,277.88

AIRBUS SE	46,842	108.18	5,067,367.56
ALSTOM	13,816	38.49	531,777.84
ANDRITZ AG	5,242	50.25	263,410.50
BOUYGUES ORD	16,815	37.23	626,022.45
BRENTAG AG	11,626	53.16	618,038.16
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	10.35	793,358.55
DASSAULT AVIATION SA	213	1,594.00	339,522.00
EIFFAGE	6,079	96.16	584,556.64
FERROVIAL SA	37,634	17.87	672,519.58
GEA GROUP AG	13,382	30.68	410,559.76
HOCHTIEF AG	1,354	142.80	193,351.20
KION GROUP AG	5,887	52.94	311,657.78
KONE OYJ-B	26,924	46.02	1,239,042.48
LEGRAND SA	21,312	62.78	1,337,967.36
LEONARDO SPA	35,425	10.38	367,711.50
MAN SE	3,262	93.65	305,486.30
METSO OYJ	9,561	30.54	291,992.94
MTU AERO ENGINES AG	3,907	194.10	758,348.70
OSRAM LICHT AG	7,440	34.26	254,894.40
PRYSMIAN SPA	14,715	20.06	295,182.90
REXEL SA	24,339	12.93	314,824.96
SAFRAN SA	27,252	120.70	3,289,316.40
SAINT-GOBAIN	39,044	37.14	1,450,289.38
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	69.30	3,105,610.20
SIEMENS	61,389	110.34	6,773,662.26
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	10.90	190,651.90
THALES SA	8,109	122.35	992,136.15
VINCI S.A.	40,049	82.02	3,284,818.98
WARTSILA OYJ	34,386	16.79	577,340.94
BUREAU VERITAS SA	19,558	22.23	434,774.34
EDENRED	18,941	32.83	621,833.03
RANDSTAD NV	9,588	45.98	440,856.24
SOCIETE BIC SA	2,424	78.85	191,132.40
TELEPERFORMANCE	4,523	162.50	734,987.50
WOLTERS KLUWER	23,031	53.68	1,236,304.08
ADP	2,382	193.90	461,869.80
AENA SME SA	5,610	149.50	838,695.00
ATLANTIA SPA	42,039	17.87	751,236.93
BOLLORE	61,805	3.72	229,914.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	21.16	358,217.64
DEUTSCHE POST AG-REG	78,592	30.71	2,413,560.32
FRAPORT AG	3,561	76.10	270,992.10

GETLINK	36,478	11.00	401,258.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.40	343,023.48
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,892	77.71	2,089,777.32
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	67.70	337,890.70
CONTINENTAL AG	8,828	149.95	1,323,758.60
DAIMLER AG	74,263	54.35	4,036,194.05
FAURECIA	5,945	51.84	308,188.80
FERRARI NV	9,947	118.60	1,179,714.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	15.14	1,310,607.19
MICHELIN	13,802	102.95	1,420,915.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	35.29	363,204.68
PEUGEOT SA	46,029	23.23	1,069,253.67
PIRELLI & C SPA	39,097	7.22	282,593.11
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	58.00	674,772.00
RENAULT SA	15,041	74.50	1,120,554.50
SCHAEFFLER AG	15,247	11.01	167,869.47
VALEO SA	19,350	37.40	723,690.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	151.60	2,240,648.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	150.10	389,359.40
ADIDAS AG	14,964	210.90	3,155,907.60
HERMES INTERNATIONAL	2,561	570.60	1,461,306.60
HUGO BOSS AG	4,852	66.32	321,784.64
KERING	6,060	461.70	2,797,902.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	58.52	779,427.88
LVMH	22,399	304.60	6,822,735.40
MONCLER SPA	15,736	37.10	583,805.60
PUMA AG	772	425.00	328,100.00
SEB SA	2,075	146.60	304,195.00
ACCOR	14,931	44.22	660,248.82
PADDY POWER PLC	7,143	73.50	525,010.50
SODEXO	7,035	91.34	642,576.90
AXEL SPRINGER SE	3,827	57.95	221,774.65
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	20.36	243,831.36
JC DECAUX SA	4,674	31.50	147,231.00
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	22.37	428,922.38
PUBLICIS GROUPE	17,601	51.48	906,099.48
RTL GROUP	3,513	61.60	216,400.80
SES	31,369	18.90	592,874.10
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	47.42	237,005.16
VIVENDI	83,098	22.17	1,842,282.66
INDITEX	86,470	26.11	2,257,731.70
ZALANDO SE	9,155	33.51	306,784.05

CARREFOUR	43,442	16.50	716,793.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	36.22	133,543.14
COLRUYT SA	4,160	48.75	202,800.00
JERONIMO MARTINS	20,234	12.68	256,668.29
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	19.75	1,985,566.25
METRO AG	13,712	13.50	185,112.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,839	75.22	4,576,309.58
DANONE (GROUPE)	48,771	66.70	3,253,025.70
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	7.33	311,928.21
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	78.00	700,440.00
HEINEKEN NV	20,246	80.76	1,635,066.96
KERRY GROUP PLC-A	13,146	95.25	1,252,156.50
PERNOD-RICARD	17,495	141.30	2,472,043.50
REMY COINTREAU	1,575	112.20	176,715.00
BEIERSDORF AG	7,693	97.18	747,605.74
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	91.45	788,116.10
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	101.05	1,446,429.70
LOREAL	20,321	207.70	4,220,671.70
UNILEVER NV-CVA	125,731	47.96	6,030,687.41
BIOMERIEUX	3,246	71.80	233,062.80
ESSILOR INTERNATIONAL	17,239	127.45	2,197,110.55
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	88.58	1,594,085.68
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,850	63.24	2,140,674.00
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	39.23	2,921,438.10
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	139.80	453,790.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	37.87	473,437.50
BAYER	72,150	76.51	5,520,196.50
EUROFINS SCIENTIFIC	971	489.00	474,819.00
GRIFOLS SA	22,128	24.26	536,825.28
IPSEN	2,722	144.80	394,145.60
MERCK KGAA	10,480	89.00	932,720.00
ORION OYJ-CLASS B	7,975	32.62	260,144.50
QIAGEN N.V.	17,548	32.60	572,064.80
RECORDATI SPA	7,493	29.16	218,495.88
SANOFI	91,271	76.56	6,987,707.76
UCB (GROUPE)	10,465	77.40	809,991.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	23.45	778,282.05
BANCO BILBAO VIZCAYA	541,619	5.49	2,973,488.31
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.33	593,124.77
BANCO SANTANDER SA	1,302,544	4.33	5,647,179.51
BANKIA SA	110,053	3.37	371,648.98
BANKINTER SA	58,881	7.93	467,044.09



BNP PARIBAS	90,844	52.71	4,788,387.24
CAIXABANK	277,342	3.93	1,092,172.79
COMMERZBANK AG	80,494	8.97	722,433.65
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	12.38	1,149,841.92
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	35.78	826,804.24
ING GROEP NV-CVA	314,846	11.18	3,521,237.66
INTESA SANPAOLO	1,163,318	2.20	2,560,462.91
KBC GROEP NV	20,232	64.10	1,296,871.20
MEDIOBANCA	53,990	8.60	464,529.96
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	24.80	309,752.00
SOCIETE GENERALE	63,719	36.97	2,355,691.43
UNICREDIT SPA	163,189	12.96	2,115,582.19
AMUNDI SA	4,764	64.54	307,468.56
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	9.82	1,583,841.16
DEUTSCHE BOERSE	15,552	115.40	1,794,700.80
EURAZEO SA	3,198	67.85	216,984.30
EXOR NV	7,813	57.82	451,747.66
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	90.30	564,104.10
NATIXIS	69,996	5.84	409,056.62
WENDEL	2,023	128.20	259,348.60
AEGON	133,499	5.58	745,992.41
AGEAS	16,065	46.31	743,970.15
ALLIANZ SE-REG	36,019	192.00	6,915,648.00
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	14.88	1,512,537.12
AXA	157,703	23.15	3,650,824.45
CNP ASSURANCES	11,830	20.76	245,590.80
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	121.70	572,720.20
MAPFRE SA	90,939	2.70	245,717.17
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	190.75	2,415,848.75
NN GROUP NV	23,899	38.43	918,438.57
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.88	316,812.87
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	44.60	1,615,099.80
SCOR SE	13,354	40.00	534,160.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	41.32	1,138,489.96
VONOVIA SE	40,469	42.08	1,702,935.52
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,186	80.02	2,895,603.72
ATOS SE	7,634	102.50	782,485.00
CAPGEMINI SA	13,238	108.40	1,434,999.20
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	128.75	1,347,883.75
DELIVERY HERO SE	8,671	41.42	359,152.82
SAP SE	78,835	106.00	8,356,510.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	93.42	638,058.60

	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	40.75	387,654.75	
	WIRECARD AG	9,864	186.70	1,841,608.80	
	INGENICO GROUP	4,681	65.44	306,324.64	
	NOKIA OYJ	458,694	4.77	2,191,181.23	
	1&1 DRILLISCH AG	3,773	41.90	158,088.70	
	DEUTSCHE TELEKOM	268,918	13.88	3,733,926.43	
	ELISA A	11,722	36.53	428,204.66	
	ILIAD SA	2,053	112.50	230,962.50	
	KPN (KON.)	261,596	2.27	594,346.11	
	ORANGE	164,543	13.73	2,259,998.10	
	PROXIMUS	13,141	20.58	270,441.78	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.52	445,884.69	
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.46	217,866.11	
	TELEFONICA	377,880	6.81	2,576,385.84	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.64	243,826.84	
	E.ON SE	183,255	8.78	1,608,978.90	
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	15.12	752,257.00	
	ENDESA	24,774	18.61	461,044.14	
	ENEL	656,974	4.41	2,898,569.28	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.17	614,123.07	
	ENGIE	151,158	12.66	1,914,416.07	
	FORTUM OYJ	38,328	21.59	827,501.52	
	IBERDROLA SA	476,207	6.33	3,018,199.96	
	INNOGY SE	11,000	38.49	423,390.00	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	26,034	23.51	612,059.34	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	18.04	593,191.28	
	RWE STAMM	42,828	21.25	910,095.00	
	SUEZ	28,043	12.24	343,246.32	
	TERNA SPA	105,905	4.60	487,268.90	
	UNIPER SE	14,751	26.51	391,049.01	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	17.19	786,304.98	
	ASML HOLDING NV	33,413	160.90	5,376,151.70	
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	19.57	1,775,840.51	
	STMICROELECTRONICS	57,598	15.67	902,560.66	
	ユーロ 小計	15,446,524		315,074,313.76 (41,649,673,535)	
イギリスポンド	BP PLC	1,616,893	5.89	9,528,350.44	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	373,089	26.36	9,836,491.48	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	304,218	26.89	8,180,422.02	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	7.71	416,664.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	87,426	17.23	1,506,349.98	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.55	306,568.80	

BHP BILLITON PLC	168,203	16.71	2,811,008.53
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	52.02	532,840.86
FRESNILLO PLC	17,743	8.21	145,741.00
GLENCORE PLC	943,407	3.31	3,129,281.01
JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	35.62	502,633.82
MONDI PLC	27,192	21.04	572,119.68
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	54.50	397,523.00
RIO TINTO PLC REG	96,058	38.80	3,727,050.40
ASHTREAD GROUP PLC	42,021	24.37	1,024,051.77
BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.29	1,617,855.43
BUNZL PLC	27,712	24.13	668,690.56
DCC PLC	7,320	69.65	509,838.00
FERGUSON PLC	19,208	65.15	1,251,401.20
MEGGITT PLC	66,268	5.66	375,341.95
MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.99	816,563.51
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	9.87	1,321,269.56
SMITHS GROUP PLC	28,628	14.95	428,131.74
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	10.65	197,703.52
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	17.63	327,671.18
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	7.23	142,380.39
EXPERIAN PLC	75,041	19.70	1,478,682.90
G4S PLC	132,555	2.42	320,783.10
INTERTEK GROUP PLC	12,430	49.92	620,505.60
RELX PLC	162,365	16.16	2,623,818.40
EASYJET PLC	11,633	13.14	152,857.62
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.77	358,459.54
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	5.67	405,132.84
BURBERRY GROUP PLC	35,328	20.15	711,859.20
PERSIMMON PLC	26,389	23.65	624,099.85
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.71	464,883.92
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	36.79	389,937.21
CARNIVAL PLC	13,721	47.64	653,668.44
COMPASS GROUP PLC	126,022	17.06	2,149,935.32
GVC HOLDINGS PLC	42,500	9.18	390,362.50
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	47.80	667,479.20
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.00	260,652.39
TUI AG-DI	37,945	14.73	558,929.85
WHITBREAD PLC	14,664	47.17	691,700.88
INFORMA PLC	100,899	7.62	769,052.17
ITV PLC	295,435	1.57	466,344.14
PEARSON	66,305	8.90	590,114.50
SKY PLC	83,042	17.29	1,435,796.18

WPP PLC	98,371	11.24	1,106,181.89
KINGFISHER PLC	170,994	2.58	441,164.52
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.88	390,639.54
NEXT PLC	11,202	54.94	615,437.88
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.59	436,116.25
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.21	477,342.03
TESCO	786,019	2.39	1,884,873.56
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	22.90	660,550.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	186,419	35.84	6,682,189.05
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.13	469,294.80
DIAGEO	200,277	27.19	5,445,531.63
IMPERIAL BRANDS PLC	76,948	26.71	2,055,281.08
RECKITT BENCKISER PLC	53,639	70.16	3,763,312.24
UNILEVER PLC	99,877	42.16	4,210,814.32
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.32	261,601.06
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	4.29	128,815.83
NMC HEALTH PLC	9,509	33.94	322,735.46
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.99	994,022.86
ASTRAZENECA	101,347	59.63	6,043,321.61
GLAXOSMITHKLINE	403,375	15.36	6,199,067.00
SHIRE PLC	74,526	46.23	3,445,709.61
BARCLAYS	1,365,547	1.71	2,345,736.63
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,634,371	6.69	10,947,016.95
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,929,966	0.59	3,514,690.84
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.50	738,810.00
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.36	1,486,114.91
3I GROUP PLC	79,251	9.41	745,910.41
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	22.35	457,482.15
INVESTEC PLC	54,280	5.39	292,894.88
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	45.86	1,205,934.56
SCHRODERS PLC	8,614	30.95	266,603.30
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.44	511,940.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	3.05	676,445.84
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.80	338,104.00
AVIVA PIC	318,261	4.89	1,557,887.59
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.23	368,322.88
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.62	1,272,768.61
PRUDENTIAL	212,799	17.59	3,744,198.40
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.75	497,593.50
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.46	357,324.66
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	14.29	500,839.62
SAGE GROUP PLC	89,321	5.86	523,778.34

	BT GROUP PLC	663,615	2.25	1,495,124.59
	VODAFONE GROUP PLC	2,177,524	1.64	3,582,026.98
	CENTRICA PLC	440,558	1.54	682,424.34
	NATIONAL GRID PLC	272,668	7.91	2,157,894.55
	SEVERN TRENT PLC	18,112	18.49	334,890.88
	SSE PLC	80,824	11.46	926,243.04
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.04	414,585.60
	イギリスbond 小計	24,593,938		155,036,590.35 (23,018,282,569)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	25.54	444,344.92
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	585.00	393,120.00
	GIVAUDAN-REG	740	2,413.00	1,785,620.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	48.45	1,954,182.30
	SIKA AG-BR	10,500	142.90	1,500,450.00
	ABB LTD	149,127	23.19	3,458,255.13
	GEBERIT AG-REG	3,021	455.20	1,375,159.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	236.80	350,227.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	244.60	731,109.40
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	51.54	681,564.96
	SGS SA	437	2,584.00	1,129,208.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	155.50	616,557.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	80.00	3,319,600.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	390.30	969,114.90
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	76.50	301,257.00
	DUFREY AG-REG	2,548	110.65	281,936.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,860.00	297,600.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	80,500.00	644,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	6,880.00	516,000.00
	NESTLE SA - REGISTERED	252,246	81.82	20,638,767.72
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	195.30	808,542.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	738.00	574,902.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	335.00	1,928,595.00
	NOVARTIS	180,510	84.40	15,235,044.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,037	237.75	13,560,546.75
	VIFOR PHARMA AG	3,601	170.15	612,710.15
	CREDIT SUISSE GROUP AG	211,677	14.75	3,122,235.75
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	49.11	847,343.94
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	78.85	267,853.45
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	778.50	1,160,743.50
	UBS GROUP AG	317,371	15.50	4,919,250.50
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	149.70	580,386.90
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	372.00	1,097,028.00

	SWISS RE LTD	26,239	90.60	2,377,253.40
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,305	310.20	3,817,011.00
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	83.65	525,071.05
	TEMENOS AG - REG	5,252	159.20	836,118.40
	SWISSCOM	2,064	445.40	919,305.60
	スイスフラン 小計	1,408,816		94,578,015.82 (10,981,453,416)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	340.20	4,827,778.20
	BOLIDEN AB	20,141	247.90	4,992,953.90
	ALFA LAVAL AB	25,639	241.00	6,178,999.00
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	178.65	14,344,701.75
	ATLAS COPCO A	53,833	256.20	13,792,014.60
	ATLAS COPCO B	29,972	237.15	7,107,859.80
	EPIROC AB-A	53,833	99.30	5,345,616.90
	EPIROC AB-B	29,972	91.50	2,742,438.00
	SANDVIK AB	87,313	157.75	13,773,625.75
	SKANSKA B	28,530	174.55	4,979,911.50
	SKF AB-B	28,335	175.35	4,968,542.25
	VOLVO B	123,214	157.10	19,356,919.40
	SECURITAS B	22,844	154.75	3,535,109.00
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	196.00	3,561,320.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	75.70	2,930,498.40
	HENNES & MAURITZ B	73,962	164.24	12,147,518.88
	ICA GRUPPEN AB	5,730	282.00	1,615,860.00
	SWEDISH MATCH AB	15,149	455.00	6,892,795.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	223.40	10,850,761.40
	NORDEA BANK AB	244,135	96.86	23,646,916.10
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	99.24	13,765,580.40
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	112.25	13,489,868.25
	SWEDBANK AB-A	71,353	220.30	15,719,065.90
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	197.50	2,526,420.00
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	410.70	15,094,046.40
	KINNEVIK AB - B	18,104	269.10	4,871,786.40
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	299.60	2,181,088.00
	ERICSSON (LM) B	248,169	78.88	19,575,570.72
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	521.00	11,203,584.00
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	510.50	3,162,037.00	
TELE2 AB-B SHS	33,266	107.00	3,559,462.00	
TELIA CO AB	235,437	40.82	9,610,538.34	
	スウェーデンクローナ 小計	1,992,279		282,351,187.24 (3,616,918,708)
	AKER BP ASA	10,311	345.40	3,561,419.40

ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	92,696	229.50	21,273,732.00
	NORSK HYDRO	106,150	48.86	5,186,489.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	399.70	5,383,959.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	282.00	1,965,822.00
	MARINE HARVEST	32,238	188.55	6,078,474.90
	ORKLA	69,804	68.76	4,799,723.04
	DNB ASA	80,217	171.25	13,737,161.25
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	137.20	2,548,352.80
	TELENOR ASA	60,821	159.10	9,676,621.10
ノルウェークローネ 小計		491,252		74,211,754.49 (1,037,480,327)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	652.00	4,825,452.00
	NOVOZYMES A/S	17,687	352.60	6,236,436.20
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	434.40	7,697,568.00
	ISS A/S	14,253	226.00	3,221,178.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,425.00	2,519,075.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,020.00	4,582,160.00
	DSV A/S	14,599	584.00	8,525,816.00
	PANDORA A/S	8,431	401.10	3,381,674.10
	CARLSBERG AS-B	8,236	770.40	6,345,014.40
	COLOPLAST-B	9,476	656.80	6,223,836.80
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	241.40	1,791,188.00
	GENMAB A/S	4,512	1,010.00	4,557,120.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	396.70	1,932,325.70
	NOVO NORDISK A/S-B	143,942	302.40	43,528,060.80
	DANSKE BANK A/S	59,378	168.70	10,017,068.60
	TRYG A/S	9,828	159.90	1,571,497.20
ORSTED A/S	15,908	436.30	6,940,660.40	
デンマーククローネ 小計		344,469		123,896,131.20 (2,196,678,406)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	29.90	616,807.10
	OIL SEARCH LTD	118,781	9.03	1,072,592.43
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	8.26	1,108,508.52
	SANTOS	156,437	7.26	1,135,732.62
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	38.58	2,967,419.28
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.77	472,168.66
	AMCOR	88,486	13.68	1,210,488.48
	BHP BILLITON LTD	258,265	34.63	8,943,716.95
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	16.98	837,589.44
	BORAL LIMITED	81,732	6.91	564,768.12
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	3.92	527,929.92
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.98	599,384.02

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	20.96	783,128.48
NEWCREST MINING LIMITED	61,159	19.41	1,187,096.19
ORICA LTD	29,211	17.03	497,463.33
RIO TINTO LTD	32,522	78.76	2,561,432.72
SOUTH32 LTD	408,172	3.92	1,600,034.24
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	51.36	473,539.20
BRAMBLES LTD	129,297	10.90	1,409,337.30
SEEK LTD	26,358	20.76	547,192.08
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.11	655,491.57
TRANSURBAN GROUP	214,921	11.22	2,411,413.62
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	28.44	1,243,539.00
CROWN RESORTS LTD	30,328	13.69	415,190.32
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	53.20	293,823.60
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	53.16	173,461.08
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.87	812,540.02
HARVEY NORMAN HDG LTD-RIGHTS	2,656	0.80	2,124.80
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.52	158,973.76
WESFARMERS LTD	93,277	49.85	4,649,858.45
WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	28.08	2,887,213.68
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.76	450,228.80
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	17.49	1,020,978.75
COCHLEAR LIMITED	4,811	200.64	965,279.04
HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.10	294,585.90
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	54.93	672,782.64
SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	24.91	791,565.07
CSL LIMITED	36,265	201.11	7,293,254.15
AUST AND NZ BANKING GROUP	234,871	28.18	6,618,664.78
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	11.02	392,312.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.75	456,165.50
COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,283	71.41	10,017,609.03
NATIONAL AUSTRALIA BANK	222,533	27.81	6,188,642.73
WESTPAC BANKING	277,750	27.93	7,757,557.50
AMP LTD	244,230	3.19	779,093.70
ASX LTD	15,814	63.66	1,006,719.24
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	11.20	493,561.60
MACQUARIE GROUP LIMITED	26,778	126.04	3,375,099.12
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	7.32	1,336,309.92
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.91	624,229.92
QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.12	1,257,594.16
SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	14.46	1,488,237.66
COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	19.95	649,651.80
REA GROUP LTD	3,593	85.93	308,746.49



	TELSTRA CORP	342,339	3.19	1,092,061.41	
	TPG TELECOM LTD	31,475	8.54	268,796.50	
	AGL ENERGY LTD	51,344	19.50	1,001,208.00	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.62	195,373.75	
	オーストラリアドル 小計	5,850,694		99,616,268.14 (8,193,438,054)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	6.54	501,251.76	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	7.30	620,135.00	
	A2 MILK CO LTD	66,854	11.26	752,776.04	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.05	684,895.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.00	508,438.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.05	589,068.45	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	3.28	363,137.04	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,019,701.69 (303,085,507)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	90.20	19,212,239.20	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	15.48	1,532,520.00	
	MTR CORP	114,000	41.20	4,696,800.00	
	MINTH GROUP LTD	46,000	32.30	1,485,800.00	
	LI & FUNG	554,800	1.75	970,900.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	50.00	5,950,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	21.75	1,489,875.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	49.65	9,830,700.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.40	833,280.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	35.45	7,189,260.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	11.64	1,140,720.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.24	955,680.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	18.00	2,534,400.00	
	WH GROUP LTD	699,000	5.51	3,851,490.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	29.20	3,187,472.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	37.20	11,532,000.00	
	HANG SENG BANK	61,100	212.60	12,989,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,900	224.00	21,705,600.00	
	AIA GROUP LTD	968,600	69.90	67,705,140.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	58.75	12,689,765.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	20.80	1,684,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.30	2,646,900.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	39.35	4,479,761.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	39.55	2,333,450.00	
KERRY PROPERTIES LTD	64,500	26.55	1,712,475.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.68	5,249,220.00		
SINO LAND CO	235,400	13.42	3,159,068.00		

	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	114.00	15,048,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	85.75	3,472,875.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	29.65	2,852,330.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	21.30	1,938,300.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	50.50	4,595,500.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	46.95	3,051,750.00	
	PCCW LTD	357,000	4.56	1,627,920.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	62.00	3,100,000.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	91.65	12,235,275.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	737,913	15.54	11,467,168.02	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	54.50	6,049,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	79.70	1,888,890.00	
	香港ドル 小計	7,660,909		280,076,683.62 (4,075,115,746)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.96	781,608.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	3.09	330,630.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.56	388,040.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.24	247,876.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.43	404,595.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.74	422,063.42	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.22	267,264.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	1.06	450,500.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.87	364,777.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	31.99	316,701.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.25	104,750.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.22	575,092.00	
	DBS GROUP	145,600	26.09	3,798,704.00	
	OCBC BANK	260,000	11.44	2,974,400.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,700	27.08	2,997,756.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.37	459,151.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.37	630,527.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.11	284,232.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.89	327,275.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.63	453,091.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.24	2,076,655.32		
	シンガポールドル 小計	3,459,876		18,655,687.74 (1,554,951,573)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,032	376.50	1,141,548.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	22.20	1,504,183.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	461.20	673,352.00	
	BANK HAPOALIM BM	84,067	26.64	2,239,544.88	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	23.99	2,777,898.06	

MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	63.72	522,504.00
AZRIELI GROUP	4,323	186.80	807,536.40
NICE LTD	4,894	411.50	2,013,881.00
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	4.18	646,716.89
イスラエルシェケル 小計	444,132		12,327,164.43 (385,963,518)
合 計	90,392,109		343,200,267,590 (343,200,267,590)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	893,918.58	
		LENDLEASE GROUP	44,009	865,216.94	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	619,135.40	
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,378,270.92 (195,612,783)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,741,950.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,883,680.00	
	香港ドル 小計		488,500	4,625,630.00 (67,302,916)	
投資信託受益証券合計			711,940	262,915,699 (262,915,699)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	35,976	670,232.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,479	1,066,573.41	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,899	5,216,124.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	96,808	990,345.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,957,506.90	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,514,253.18	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,000	397,670.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	663,598.44	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,801	3,651,735.33	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	1,892,363.52	
		DUKE REALTY CORP	29,929	849,085.73	
		EQUINIX INC	6,496	2,812,053.44	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,902,920.94	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,252,546.67	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	874,370.88	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	762,487.63	
		HCP INC	36,011	947,809.52	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,253,086.80			

	INVITATION HOMES INC	24,000	549,840.00	
	IRON MOUNTAIN INC	20,489	707,280.28	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	592,713.18	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	499,479.50	
	MACERICH CO/THE	10,128	559,977.12	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	873,168.88	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	493,916.40	
	PROLOGIS INC	50,653	3,433,766.87	
	PUBLIC STORAGE	12,835	2,587,921.05	
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,234,000.99	
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	757,738.39	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,504,460.58	
	SIMON PROPERTY GROUP	26,119	4,616,533.25	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	786,774.51	
	UDR INC	20,960	847,412.80	
	VENTAS INC	27,813	1,512,470.94	
	VEREIT INC	77,798	564,813.48	
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	970,535.00	
	WELLTOWER INC	29,615	1,904,836.80	
	アメリカドル 小計	889,239	53,672,405.83 (6,114,360,472)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	187,870.85	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	382,293.20	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	171,801.81	
	カナダドル 小計	30,576	741,965.86 (65,745,594)	
ユーロ	COVIVIO	3,578	321,125.50	
	GECINA SA	3,549	510,346.20	
	ICADE	2,845	226,462.00	
	KLEPIERRE	17,225	525,879.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,790	1,869,043.80	
	ユーロ 小計	37,987	3,452,856.75 (456,433,133)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	489,825.55	
	HAMMERSON PLC	61,184	279,427.32	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	517,230.70	
	SEGRO PLC	81,695	521,050.71	
	イギリスポンド 小計	280,843	1,807,534.28 (268,364,614)	
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	782,390.40	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,453,207.56	
	GPT GROUP	136,015	708,638.15	

	MIRVAC GROUP	306,089	737,674.49
	SCENTRE GROUP	426,663	1,693,852.11
	STOCKLAND	207,412	860,759.80
	VICINITY CENTERS	291,115	762,721.30
	オーストラリアドル 小計	1,581,655	6,999,243.81 (575,687,803)
香港ドル	LINK REIT	179,500	13,830,475.00
	香港ドル 小計	179,500	13,830,475.00 (201,233,411)
シンガポールドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	521,400.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	432,540.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	444,666.00
	SUNTEC REIT	173,000	333,890.00
	シンガポールドドル 小計	813,800	1,732,496.00 (144,403,541)
	投資証券合計	3,813,600	7,826,228,568 (7,826,228,568)
	合計		8,089,144,267 (8,089,144,267)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 598銘柄	97.4%			66.4%
	投資証券 37銘柄			2.6%	1.7%
カナダドル	株式 87銘柄	99.5%			3.6%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 236銘柄	98.9%			11.9%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 97銘柄	98.8%			6.6%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%

オーストラリアドル	株式	58銘柄	91.4%			2.3%
	投資信託受 益証券	3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券	7銘柄			6.4%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	39銘柄	93.8%			1.2%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.5%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.6%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	91.5%			0.4%
	投資証券	4銘柄			8.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2018年10月 1日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	139,903,034
コール・ローン	3,780,389,705
国債証券	259,925,887,927
派生商品評価勘定	25,524,437
未収入金	3,244,898,568
未収利息	2,028,673,008
前払金	2,440,457
前払費用	116,819,009
差入委託証拠金	114,707,423
流動資産合計	269,379,243,568
資産合計	269,379,243,568
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,532,375
未払金	4,720,465,197
未払解約金	232,351,065
未払利息	9,447
その他未払費用	2,421
流動負債合計	4,958,360,505

	2018年10月 1日現在
項目	金額（円）
負債合計	4,958,360,505
純資産の部	
元本等	
元本	95,813,127,162
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	168,607,755,901
元本等合計	264,420,883,063
純資産合計	264,420,883,063
負債純資産合計	269,379,243,568

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年10月 1日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p>

	2018年10月 1日現在
	約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年10月 1日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	95,813,127,162口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7598円 (27,598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

	2018年10月 1日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項



2018年10月 1日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2018年10月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年10月 3日
期首元本額	92,043,899,595円
期中追加設定元本額	22,136,930,833円

区分	2018年10月 1日現在
期中一部解約元本額	18,367,703,266円
期末元本額	95,813,127,162円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,994,561,106円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	823,648,985円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	544,931,793円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,065,585,234円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,874,775円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,154,723,357円
世界経済インデックスファンド	6,578,988,370円
DCマイセレクション25	1,578,287,979円
DCマイセレクション50	1,290,701,956円
DCマイセレクション75	858,879,638円
DC外国債券インデックス・オープン	1,754,410,472円
DCマイセレクションS25	633,287,451円
DCマイセレクションS50	515,491,215円
DCマイセレクションS75	248,227,349円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	51,432,577円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	60,713,402円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	28,557,233円
DC世界経済インデックスファンド	5,330,668,690円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	596,250,410円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	44,953,739円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,570,393円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,192,335円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	61,021,420円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	168,628,273円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	249,907,601円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	191,880,938円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	605,148,820円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,513,561,004円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	695,290,883円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,484,473,961円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	949,975,263円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	102,329,333円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	720,854,152円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	333,779,954円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	268,081,917円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	345,945,415円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,103,916,941円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	968,270,991円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	900,767,498円

区分	2018年10月 1日現在
外国債券ファンド・シリーズ1	603,945,318円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,418,903,803円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,519,193,317円
分散投資コア戦略ファンドA	1,035,875,714円
分散投資コア戦略ファンドS	2,993,891,423円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,663,994円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,331,928,436円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,225,459,313円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	264,596,482円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	119,321,618円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	988,545,754円
SMT インデックスバランス・オープン	268,944,587円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	25,374,919,682円
SMT 世界経済インデックス・オープン	30,600,652円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	87,520,403円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	108,611,033円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	576,273円
グローバル経済コア	1,183,918,732円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	3,093,083円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	40,281円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	975,305,989円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	7,861,268,000円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	359,230,452円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年10月 1日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,713,132,574
合計	2,713,132,574

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2018年10月 1日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				

	買建	1,570,495,527	-	1,568,055,070	2,440,457
	合計	1,570,495,527	-	1,568,055,070	2,440,457

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2018年10月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,724,942,061	-	3,747,422,494	22,480,433
	アメリカドル	2,022,969,065	-	2,037,640,379	14,671,314
	カナダドル	113,825,579	-	115,986,774	2,161,195
	メキシコペソ	31,841,736	-	31,799,850	41,886
	ユーロ	1,240,705,261	-	1,245,646,293	4,941,032
	イギリスポンド	128,315,190	-	129,116,700	801,510
	ノルウェークローネ	14,841,961	-	14,834,559	7,402
	デンマーククローネ	22,795,522	-	22,796,902	1,380
	ポーランドズロチ	6,323,888	-	6,318,194	5,694
	オーストラリアドル	55,739,918	-	55,727,863	12,055
	シンガポールドル	28,529,557	-	28,531,645	2,088
	マレーシアリングット	25,276,116	-	25,287,143	11,027
	南アフリカランド	33,778,268	-	33,736,192	42,076
	売建	269,843,714	-	269,891,628	47,914
	カナダドル	123,159,560	-	123,154,000	5,560
	ユーロ	41,224,456	-	41,280,667	56,211
	イギリスポンド	91,326,710	-	91,322,548	4,162
	スウェーデンクローナ	14,132,988	-	14,134,413	1,425
	合計		3,994,785,775	-	4,017,314,122

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,239,389.32	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,898,788.96	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,352,051.80	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,763,390.05	
		T 1.125% 09/30/21	15,300,000.00	14,532,678.53	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,914,137.75	
		T 1.25% 01/31/20	9,620,000.00	9,435,407.68	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,329,902.67	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,365,645.25	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,205,451.47	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,416,653.16	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,520,956.60	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,915,589.60	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,912,498.70	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,641,182.40	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,905,725.65	
		T 1.375% 03/31/20	8,280,000.00	8,113,061.04	
		T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	978,515.85	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,151,847.51	
		T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,514,686.42	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,407,185.09	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,655,657.90	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,321,439.55	
		T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,888,707.32	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,418,844.88	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,824,582.74	
		T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,531,165.51	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,301,369.10	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,338,821.41	

T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,759,438.64	
T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,641,395.61	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,037,441.35	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,764,114.70	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	11,790,267.72	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,912,858.54	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,931,757.20	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,353,373.67	
T 1.625% 03/15/20	4,500,000.00	4,428,912.78	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,304,186.93	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,483,741.16	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,715,920.10	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,940,517.98	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,895,190.30	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,381,860.75	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,322,164.65	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,440,366.14	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,789,746.24	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	2,972,913.59	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,187,635.78	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,407,219.00	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,185,819.72	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,761,195.42	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,648,867.50	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,604,770.70	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,166,440.48	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,712,655.11	
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	4,956,123.10	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,701,943.17	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,913,315.48	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,006,441.54	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,417,041.35	
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,691,401.86	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,661,245.85	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,845,696.44	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,060,506.70	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,236,504.41	
T 1.875% 12/15/20	12,500,000.00	12,244,613.75	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,935,747.52	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,178,630.37	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,951,348.52	
T 2.125% 02/29/24	15,750,000.00	15,093,152.55	

T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,086,266.86
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	11,367,333.23
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,353,784.50
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,041,528.14
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,581,554.35
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	5,974,842.64
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,416,908.68
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,956,811.68
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	7,624,980.80
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,921,043.74
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,393,529.55
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,427,509.38
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,005,791.53
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,447,404.83
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,949,342.12
T 2.25% 08/15/27	12,150,000.00	11,397,424.62
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	9,823,403.23
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,043,299.06
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,731,232.51
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,183,923.48
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	13,716,705.47
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,931,752.32
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,047,407.31
T 2.375% 05/15/27	11,950,000.00	11,349,613.95
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,092,141.87
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,276,855.07
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,857,883.10
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,516,888.76
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	14,397,567.36
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	3,975,766.13
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,829,593.91
T 2.5% 05/15/46	2,550,000.00	2,223,325.69
T 2.5% 05/31/20	13,950,000.00	13,885,879.66
T 2.5% 06/30/20	6,500,000.00	6,467,806.54
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,459,150.28
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,382,385.69
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,089,760.86
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,114,688.43
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,327,705.08
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,481,666.74
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	10,952,268.69
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,969,212.68
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,143,506.88

T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,538,809.58	
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	5,948,256.24	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,778,401.07	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	9,110,501.18	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,836,054.87	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,886,806.79	
T 2.75% 11/15/47	9,900,000.00	9,061,083.58	
T 2.875% 05/15/28	6,900,000.00	6,797,897.11	
T 2.875% 05/15/43	6,000,000.00	5,672,217.95	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,261,823.20	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,428,359.70	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,500,881.68	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	7,914,506.71	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,920,733.96	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,716,197.23	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	9,961,486.18	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,126,294.26	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,900,927.82	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,530,217.41	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,634,482.90	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,920,953.40	
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,503,540.58	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,337,052.27	
T 2% 11/15/26	3,350,000.00	3,100,571.69	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,403,775.90	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,927,401.70	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,139,228.21	
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,325,877.88	
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	4,939,443.20	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,335,395.04	
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	5,923,361.34	
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,217,979.05	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	5,783,804.58	
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	8,816,176.77	
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,160,762.05	
T 3.5% 05/15/20	5,650,000.00	5,714,415.02	
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,083,553.75	
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,294,126.67	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,370,198.20	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,145,783.70	
T 3.75% 11/15/43	7,050,000.00	7,719,046.97	
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,497,464.08	



T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,888,727.89	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,376,499.56	
T 3% 05/15/47	7,750,000.00	7,463,241.70	
T 3% 08/15/48	2,800,000.00	2,693,911.58	
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	5,838,887.17	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,049,636.84	
T 4.25% 11/15/40	1,150,000.00	1,345,730.16	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,180,310.40	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,257,816.79	
T 4.375% 05/15/41	4,150,000.00	4,946,593.41	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,204,187.14	
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,183,668.17	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,200,112.28	
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	301,226.03	
T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	4,783,045.80	
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	3,690,967.63	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,392,356.60	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,492,789.07	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,546,757.95	
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	1,977,873.92	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,449,138.28	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,035,759.29	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,804,702.07	
T 6.25% 05/15/30	400,000.00	524,100.62	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,897,830.29	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,958,856.39	
アメリカドル 小計	1,055,470,000.00	1,025,117,844.18 (116,781,424,808)	
カナダドル			
CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,920,370.50	
CAN 0.75% 03/01/21	5,000,000.00	4,826,475.00	
CAN 0.75% 09/01/20	4,200,000.00	4,085,340.00	
CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,561,303.65	
CAN 1.25% 02/01/20	2,500,000.00	2,470,875.00	
CAN 1.5% 03/01/20	6,100,000.00	6,044,429.00	
CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,313,468.00	
CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,155,962.50	
CAN 1.75% 03/01/23	1,050,000.00	1,025,141.25	
CAN 1% 06/01/27	2,570,000.00	2,287,197.20	
CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,427,527.50	
CAN 2.25% 06/01/25	2,050,000.00	2,032,933.75	
CAN 2.5% 06/01/24	2,980,000.00	3,002,409.60	
CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,591,641.50	
CAN 2.75% 12/01/48	1,750,000.00	1,875,816.25	

	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	684,957.40
	CAN 2% 06/01/28	1,300,000.00	1,253,070.00
	CAN 2% 12/01/51	400,000.00	362,770.00
	CAN 3.25% 06/01/21	2,130,000.00	2,185,081.80
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,838,484.00
	CAN 3.5% 12/01/45	2,500,000.00	3,031,125.00
	CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,541,280.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,900,000.00	2,487,679.50
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,249,296.00
	CAN 5% 06/01/37	1,710,000.00	2,362,766.85
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	516,758.40
	カナダドル 小計	58,000,000.00	60,134,159.65 (5,328,487,886)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	17,350,000.00	20,518,023.25
	MBONO 10% 12/05/24	51,130,000.00	56,690,898.80
	MBONO 5.75% 03/05/26	21,750,000.00	19,194,701.25
	MBONO 5% 12/11/19	35,680,000.00	34,537,169.60
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	44,859,786.50
	MBONO 6.5% 06/10/21	35,950,000.00	34,889,475.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,410,000.00	37,387,333.75
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	16,738,164.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	23,529,579.75
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,950,000.00	5,774,921.25
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	16,195,920.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	15,850,000.00	16,476,788.25
	MBONO 8% 06/11/20	30,750,000.00	30,882,378.75
	MBONO 8% 11/07/47	9,250,000.00	9,131,276.25
MBONO 8% 12/07/23	8,800,000.00	8,891,432.00	
	メキシコペソ 小計	374,720,000.00	375,697,848.40 (2,291,756,875)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	1,700,000.00	1,707,607.50
	BGB 0.5% 10/22/24	880,000.00	891,211.20
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,157,634.50
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,128,177.65
	BGB 0.8% 06/22/28	1,750,000.00	1,745,423.75
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	855,185.00
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	802,420.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,350,000.00	1,315,973.25
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,183,347.00
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,170,885.50
	BGB 1% 06/22/31	1,300,000.00	1,289,008.50
	BGB 2.15% 06/22/66	760,000.00	797,365.40

BGB 2.25% 06/22/23	1,760,000.00	1,948,038.40
BGB 2.25% 06/22/57	450,000.00	491,244.75
BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,725,524.00
BGB 3.75% 06/22/45	1,380,000.00	2,010,108.00
BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	2,981,591.25
BGB 3% 06/22/34	1,850,000.00	2,308,346.75
BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	3,507,330.75
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,672,643.25
BGB 4.25% 09/28/22	1,580,000.00	1,858,198.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,420,000.00	1,840,746.00
BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,584,192.50
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,407,623.75
BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,250,851.80
BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,500,893.50
BKO 0% 12/13/19	800,000.00	805,772.00
BTPS 0.05% 04/15/21	1,550,000.00	1,492,123.00
BTPS 0.35% 06/15/20	4,350,000.00	4,301,976.00
BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,646,955.00
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,359,253.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,196,455.00
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,531,322.50
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	1,989,590.00
BTPS 0.9% 08/01/22	500,000.00	478,605.00
BTPS 0.95% 03/01/23	1,300,000.00	1,231,223.50
BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,894,070.00
BTPS 1.05% 12/01/19	3,250,000.00	3,263,633.75
BTPS 1.25% 12/01/26	2,600,000.00	2,308,943.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,835,692.50
BTPS 1.45% 05/15/25	700,000.00	645,949.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,024,191.00
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	2,964,064.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,468,960.00
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,597,862.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	1,926,620.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	2,974,080.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,525,562.50
BTPS 2.2% 06/01/27	2,950,000.00	2,784,534.50
BTPS 2.25% 09/01/36	1,750,000.00	1,498,892.50
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,173,789.50
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,357,408.00
BTPS 2.7% 03/01/47	2,600,000.00	2,223,325.00
BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	764,101.40
BTPS 2.8% 12/01/28	950,000.00	923,860.75

BTPS 2.95% 09/01/38	1,450,000.00	1,334,833.75	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,522,686.00	
BTPS 2% 12/01/25	1,300,000.00	1,233,830.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,462,688.50	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,310,000.00	2,212,529.55	
BTPS 3.5% 03/01/30	4,110,000.00	4,215,072.15	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,050,000.00	4,261,713.75	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,100,000.00	3,261,618.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,217,440.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,279,569.75	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,705,200.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,728,267.75	
BTPS 4.5% 03/01/24	5,450,000.00	5,983,010.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	4,725,511.25	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,263,616.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,653,348.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,280,970.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	3,998,161.45	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	2,822,268.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,700,000.00	3,991,060.50	
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,629,328.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,250,000.00	3,906,240.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,355,472.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,827,601.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,886,701.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,431,308.50	
BTPS 5% 03/01/22	3,000,000.00	3,302,280.00	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,009,936.25	
BTPS 5% 08/01/34	3,750,000.00	4,495,275.00	
BTPS 5% 09/01/40	2,900,000.00	3,471,619.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,550,000.00	4,521,226.75	
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	4,976,400.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,838,151.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,049,928.00	
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,433,757.50	
DBR 0.25% 08/15/28	1,800,000.00	1,762,074.00	
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,287,392.00	
DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,479,543.00	
DBR 0.5% 02/15/28	3,270,000.00	3,297,010.20	
DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,089,573.75	
DBR 0% 08/15/26	3,160,000.00	3,101,050.20	
DBR 1.25% 08/15/48	1,580,000.00	1,649,717.50	

DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,741,989.50
DBR 1.5% 05/15/23	2,050,000.00	2,209,315.75
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,486,699.55
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,997,288.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,810,602.75
DBR 1.75% 07/04/22	3,650,000.00	3,933,951.75
DBR 1% 08/15/24	3,000,000.00	3,174,135.00
DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,233,137.25
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,635,962.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,157,490.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,543,080.00
DBR 2.5% 07/04/44	3,350,000.00	4,475,868.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,390,000.00	4,585,534.35
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,557,581.50
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,319,397.50
DBR 3.25% 01/04/20	2,450,000.00	2,572,034.50
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,749,214.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,050,000.00	3,052,890.75
DBR 3% 07/04/20	5,940,000.00	6,315,853.50
DBR 4.0% 01/04/37	3,050,000.00	4,692,928.25
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,032,002.00
DBR 4.75% 07/04/28	940,000.00	1,330,640.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,750,000.00	4,394,087.50
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,703,623.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,300,000.00	3,646,282.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	2,960,980.00
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,666,500.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,039,062.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,612,917.00
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,072,625.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,743,882.00
FRTR 0.5% 05/25/25	4,750,000.00	4,808,092.50
FRTR 0.5% 05/25/26	6,280,000.00	6,300,504.20
FRTR 0.5% 11/25/19	2,750,000.00	2,783,440.00
FRTR 0.75% 05/25/28	3,600,000.00	3,602,880.00
FRTR 0.75% 11/25/28	2,700,000.00	2,686,297.50
FRTR 0% 03/25/23	1,950,000.00	1,951,550.25
FRTR 0% 03/25/24	2,450,000.00	2,427,950.00
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,137,207.50
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,587,240.50
FRTR 1.25% 05/25/34	1,350,000.00	1,362,190.50
FRTR 1.25% 05/25/36	4,400,000.00	4,370,960.00
FRTR 1.5% 05/25/31	6,650,000.00	7,040,388.25

FRTR 1.75% 05/25/23	4,800,000.00	5,194,272.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,550,000.00	1,502,105.00	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,150,000.00	2,286,084.25	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,284,491.25	
FRTR 1% 05/25/27	3,650,000.00	3,770,979.25	
FRTR 1% 11/25/25	7,050,000.00	7,359,847.50	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,465,862.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000.00	7,784,582.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,400,000.00	5,172,112.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,783,076.75	
FRTR 2.75% 10/25/27	6,200,000.00	7,359,865.00	
FRTR 2% 05/25/48	3,000,000.00	3,239,955.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,587,372.75	
FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,596,855.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	11,691,075.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	2,130,000.00	2,623,180.20	
FRTR 3.75% 04/25/21	7,970,000.00	8,815,218.50	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,267,537.20	
FRTR 3% 04/25/22	2,800,000.00	3,120,782.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,586,343.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,250,000.00	6,777,453.75	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,627,245.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,296,656.25	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,715,264.75	
FRTR 4% 10/25/38	3,800,000.00	5,602,511.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	5,987,621.25	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,637,223.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,652,077.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,390,670.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,228,404.80	
IRISH 0.8% 03/15/22	970,000.00	1,000,210.65	
IRISH 0.9% 05/15/28	600,000.00	595,512.00	
IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	509,979.60	
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	760,890.00	
IRISH 1% 05/15/26	1,950,000.00	1,995,552.00	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,450,000.00	1,642,262.75	
IRISH 2% 02/18/45	1,100,000.00	1,153,025.50	
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,344,557.00	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,230,000.00	1,440,606.75	
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,239,296.80	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,550,000.00	2,031,778.75	
IRISH 5.9% 10/18/19	310,000.00	330,921.90	

IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	877,855.90
NETHER 0.25% 01/15/20	1,320,000.00	1,335,001.80
NETHER 0.25% 07/15/25	2,160,000.00	2,164,892.40
NETHER 0.5% 07/15/26	3,800,000.00	3,847,196.00
NETHER 0.75% 07/15/27	2,050,000.00	2,098,687.50
NETHER 0.75% 07/15/28	1,100,000.00	1,118,172.00
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,818,198.00
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	898,245.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,119,991.25
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,818,222.90
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,270,495.75
NETHER 2.75% 01/15/47	1,730,000.00	2,428,426.95
NETHER 2% 07/15/24	2,750,000.00	3,054,755.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,261,508.75
NETHER 3.5% 07/15/20	2,800,000.00	3,004,330.00
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,572,493.00
NETHER 3.75% 01/15/42	2,030,000.00	3,194,966.25
NETHER 4% 01/15/37	2,090,000.00	3,184,355.35
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,662,199.80
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	266,027.00
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,370,973.75
OBL 0.25% 10/16/20	3,800,000.00	3,861,674.00
OBL 0% 04/14/23	1,790,000.00	1,803,908.30
OBL 0% 04/17/20	3,800,000.00	3,834,618.00
OBL 0% 10/07/22	3,600,000.00	3,637,242.00
OBL 0% 10/08/21	3,800,000.00	3,847,899.00
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,058,636.25
RAGB 0.5% 04/20/27	1,100,000.00	1,092,272.50
RAGB 0.75% 02/20/28	600,000.00	604,026.00
RAGB 0.75% 10/20/26	3,420,000.00	3,489,084.00
RAGB 0% 07/15/23	630,000.00	630,000.00
RAGB 0% 09/20/22	670,000.00	673,299.75
RAGB 1.2% 10/20/25	2,120,000.00	2,246,309.60
RAGB 1.5% 02/20/47	640,000.00	651,740.80
RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	365,852.00
RAGB 1.65% 10/21/24	1,750,000.00	1,906,187.50
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,522,479.00
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	557,020.00
RAGB 2.4% 05/23/34	940,000.00	1,120,926.50
RAGB 3.15% 06/20/44	1,030,000.00	1,445,053.95
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,720,462.50
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,417,672.95
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,251,723.00

RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	803,815.15
RAGB 3.9% 07/15/20	1,750,000.00	1,887,278.75
RAGB 4.15% 03/15/37	1,870,000.00	2,807,290.75
RAGB 4.85% 03/15/26	500,000.00	665,537.50
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,266,215.25
RFGB 0.375% 09/15/20	790,000.00	803,497.15
RFGB 0.5% 04/15/26	650,000.00	653,763.50
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	346,927.00
RFGB 0.5% 09/15/28	350,000.00	342,637.75
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	532,075.50
RFGB 0.875% 09/15/25	850,000.00	882,512.50
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	544,077.00
RFGB 0% 09/15/23	760,000.00	759,027.20
RFGB 1.125% 04/15/34	570,000.00	578,601.30
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	696,065.50
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	824,354.30
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	774,009.20
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	861,937.20
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	662,796.00
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	742,290.50
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	879,908.00
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,410,720.25
SPGB 0.05% 01/31/21	1,100,000.00	1,101,908.50
SPGB 0.35% 07/30/23	480,000.00	476,136.00
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,064,616.50
SPGB 0.45% 10/31/22	2,350,000.00	2,362,572.50
SPGB 0.75% 07/30/21	3,400,000.00	3,469,649.00
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,073,995.00
SPGB 1.3% 10/31/26	3,100,000.00	3,122,599.00
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,413,041.00
SPGB 1.4% 04/30/28	2,220,000.00	2,213,828.40
SPGB 1.4% 07/30/28	2,090,000.00	2,071,263.15
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,617,823.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,097,061.50
SPGB 1.6% 04/30/25	2,900,000.00	3,031,993.50
SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,125,923.25
SPGB 1.95% 07/30/30	2,700,000.00	2,772,913.50
SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,823,527.50
SPGB 2.35% 07/30/33	2,200,000.00	2,307,679.00
SPGB 2.7% 10/31/48	1,210,000.00	1,241,163.55
SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,571,296.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,100,000.00	2,266,488.00



	SPGB 3.45% 07/30/66	1,210,000.00	1,397,090.20	
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,620,149.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,680,000.00	3,540,266.60	
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,095,663.00	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,082,395.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	3,050,000.00	3,794,154.25	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,850,000.00	4,053,441.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,711,377.25	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,316,730.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,270,307.50	
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,200,775.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,763,247.00	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,000,000.00	3,047,910.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,400,000.00	4,133,261.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,800,000.00	4,338,821.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,420,000.00	5,073,552.90	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,250,000.00	5,053,590.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,221,758.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,500,098.25	
	ユーロ 小計	702,370,000.00	788,503,427.80 (104,232,268,120)	
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,431,190.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	3,230,000.00	3,167,822.50	
	UKT 1.25% 07/22/27	4,200,000.00	4,122,384.00	
	UKT 1.5% 01/22/21	4,320,000.00	4,383,504.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,624,674.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,670,000.00	2,426,269.05	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,350,000.00	1,357,134.75	
	UKT 1.625% 10/22/71	800,000.00	759,488.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	1,980,000.00	1,939,439.70	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,492,684.00	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,940,000.00	1,897,620.70	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,895,145.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,300,000.00	2,823,066.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,390,762.00	
	UKT 2% 07/22/20	4,360,000.00	4,452,257.60	
	UKT 2% 09/07/25	2,250,000.00	2,356,132.50	
	UKT 3.25% 01/22/44	3,650,000.00	4,604,602.75	
	UKT 3.5% 01/22/45	3,860,000.00	5,096,531.70	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,400,000.00	3,752,916.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,013,428.25	
UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	792,116.25		
UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,435,040.00		

	UKT 4.25% 03/07/36	2,800,000.00	3,808,014.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,400,000.00	3,138,996.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,950,000.00	2,743,513.50	
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	831,975.85	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,490,000.00	3,547,565.25	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,250,000.00	3,383,302.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,770,000.00	2,747,809.95	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,370,000.00	3,906,577.65	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,430,000.00	3,340,338.75	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,825,204.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,799,128.75	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,270,000.00	3,045,602.25	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,819,752.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,195,338.25	
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,598,929.50	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,338,054.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,778,131.25	
	UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,842,051.00	
	イギリスポンド 小計	95,410,000.00	114,904,493.70 (17,059,870,179)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,650,000.00	7,738,548.75	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,200,000.00	13,070,470.00	
	SGB 1% 11/12/26	8,250,000.00	8,610,896.25	
	SGB 2.5% 05/12/25	8,150,000.00	9,332,646.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,850,000.00	8,147,265.75	
	SGB 3.5% 06/01/22	14,070,000.00	15,952,354.95	
	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	13,427,640.00	
	スウェーデンクローナ 小計	68,170,000.00	76,279,822.20 (977,144,522)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,610,000.00	4,518,929.45	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,650,000.00	4,609,266.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,400,000.00	6,412,416.00	
	NGB 2% 04/26/28	2,930,000.00	2,949,953.30	
	NGB 2% 05/24/23	8,650,000.00	8,831,606.75	
	NGB 3.75% 05/25/21	11,320,000.00	12,056,422.60	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	5,945,187.75	
	ノルウェークローネ 小計	44,110,000.00	45,323,781.85 (633,626,470)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	3,500,000.00	3,559,185.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	7,700,000.00	7,769,377.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,300,000.00	7,891,300.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	14,230,000.00	15,829,167.40	

	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,842,867.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,850,000.00	30,560,271.00	
	DGB 4% 11/15/19	12,590,000.00	13,249,716.00	
デンマーククローネ 小計		73,870,000.00	90,701,883.40 (1,608,144,392)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,200,000.00	2,201,375.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,089,647.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	2,006,650.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,300,000.00	5,319,610.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,456,583.25	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	3,885,816.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,530,000.00	2,431,165.55	
	POLGB 2% 04/25/21	6,760,000.00	6,798,937.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,080,000.00	4,157,989.20	
	POLGB 4% 10/25/23	4,250,000.00	4,541,465.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,150,000.00	3,385,257.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,715,037.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	738,429.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,071,438.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,282,750.25	
ポーランドズロチ 小計		52,070,000.00	53,082,150.60 (1,642,892,561)	
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,834,168.25	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,800,000.00	3,666,867.00	
	ACGB 2.25% 11/21/22	400,000.00	401,170.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,510,000.00	1,477,784.15	
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,582,814.95	
	ACGB 2.75% 05/21/41	440,000.00	415,489.80	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,250,000.00	1,219,706.25	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,100,000.00	2,118,112.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,550,000.00	3,580,707.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,072,265.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,650,000.00	1,660,023.75	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,391,857.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,850,000.00	4,033,702.75	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,470,000.00	2,599,699.70	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,200,000.00	1,238,580.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,664,385.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,600,000.00	1,555,424.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,460,000.00	4,982,176.80	
ACGB 4.5% 04/15/20	4,090,000.00	4,246,033.50		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,518,425.00		
ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,482,054.50		

	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,564,940.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	4,170,000.00	4,562,918.25	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,473,428.70	
	オーストラリアドル 小計	63,870,000.00	67,342,734.35 (5,538,939,900)	
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	244,113.75	
	SIGB 1.625% 10/01/19	410,000.00	409,214.85	
	SIGB 1.75% 04/01/22	510,000.00	503,892.75	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	832,358.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	874,663.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	240,000.00	221,614.80	
	SIGB 2.375% 06/01/25	720,000.00	719,719.20	
	SIGB 2.625% 05/01/28	170,000.00	171,978.80	
	SIGB 2.75% 03/01/46	700,000.00	688,044.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	609,636.70	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	828,844.65	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	288,225.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	481,566.70	
	SIGB 2% 07/01/20	1,100,000.00	1,101,815.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,141,629.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,096,375.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	838,289.40	
	SIGB 3.5% 03/01/27	950,000.00	1,024,527.50	
SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	829,868.00		
	シンガポールドドル 小計	12,700,000.00	12,906,377.55 (1,075,746,568)	
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,471,137.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,662,834.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,002,320.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,293,824.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	960,000.00	962,697.60	
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,154,502.25	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,267,539.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,102,304.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	400,000.00	399,632.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,065,314.00	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	756,585.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,512,562.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,104,575.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,080,000.00	1,066,694.40	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,696,017.50	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,075,594.25	
MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,908,398.00		

	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,391,028.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,674,642.75	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,950,000.00	2,987,155.25	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,230,000.00	2,178,821.50	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,330,784.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,224,585.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,831,572.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,650,000.00	1,662,457.50	
	MGS 4.736% 03/15/46	400,000.00	390,432.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,650,000.00	1,660,007.25	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,866,428.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	645,690.00	
	マレーシアリングット 小計	46,600,000.00	46,346,135.75 (1,275,909,117)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	27,500,000.00	29,876,275.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,858,362.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,714,416.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,115,346.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	5,350,000.00	5,328,974.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,482,089.50	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,577,355.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	14,160,000.00	12,731,680.80	
	SAGB 8.5% 01/31/37	21,180,000.00	18,824,572.20	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,178,211.80	
	SAGB 8.75% 02/28/48	16,450,000.00	14,632,028.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	10,550,000.00	9,820,203.75	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	14,190,523.50	
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,480,710.25	
	南アフリカランド 小計	201,800,000.00	183,810,749.05 (1,479,676,529)	
	合計		259,925,887,927 (259,925,887,927)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 182銘柄	100.0%	44.9%

カナダドル	国債証券	26銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	286銘柄	100.0%	40.1%
イギリスポンド	国債証券	40銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	24銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	29銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2018年10月2日から2019年4月1日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

## 【DCマイセレクション25】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2018年10月 1日現在)	第18期中間計算期間 (2019年 4月 1日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	70,402,909
コール・ローン	2,275,015,346	2,281,095,068
親投資信託受益証券	43,544,955,986	45,333,357,715
未収入金	90,340,000	13,190,000
流動資産合計	45,910,311,332	47,698,045,692
資産合計	45,910,311,332	47,698,045,692
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	50,993,247	51,000,123
未払受託者報酬	7,187,487	7,383,052
未払委託者報酬	55,104,005	56,603,366
未払利息	5,685	6,147
その他未払費用	1,687,016	857,926
流動負債合計	114,977,440	115,850,614
負債合計	114,977,440	115,850,614
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	27,543,792,919	28,765,378,873
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	18,251,540,973	18,816,816,205
(分配準備積立金)	6,917,160,120	6,676,634,989
元本等合計	45,795,333,892	47,582,195,078
純資産合計	45,795,333,892	47,582,195,078
負債純資産合計	45,910,311,332	47,698,045,692



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 2017年10月 3日 至 2018年 4月 2日	第18期中間計算期間 自 2018年10月 2日 至 2019年 4月 1日
営業収益		
受取利息	987	261
有価証券売買等損益	268,801,603	124,518,271
営業収益合計	268,802,590	124,518,010
営業費用		
支払利息	602,920	922,747
受託者報酬	6,716,561	7,383,052
委託者報酬	51,493,546	56,603,366
その他費用	851,863	937,512
営業費用合計	59,664,890	65,846,677
営業利益又は営業損失（ ）	209,137,700	190,364,687
経常利益又は経常損失（ ）	209,137,700	190,364,687
中間純利益又は中間純損失（ ）	209,137,700	190,364,687
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	27,976,698	34,861,505
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	14,865,937,193	18,251,540,973
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,497,273,642	1,377,381,727
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,497,273,642	1,377,381,727
剰余金減少額又は欠損金増加額	745,874,602	656,603,313
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	745,874,602	656,603,313
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	16,798,497,235	18,816,816,205

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 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 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第18期中間計算期間は2018年10月 2日から2019年 4月 1日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第17期 (2018年10月 1日現在)	第18期中間計算期間 (2019年 4月 1日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	27,543,792,919口	28,765,378,873口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6626円 (16,626円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6541円 (16,541円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第18期中間計算期間 (2019年 4月 1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第18期中間計算期間 (2019年 4月 1日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第17期 自 2017年10月 3日 至 2018年10月 1日	第18期中間計算期間 自 2018年10月 2日 至 2019年 4月 1日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	23,943,495,831円	27,543,792,919円
期中追加設定元本額	5,895,612,544円	2,214,836,324円
期中一部解約元本額	2,295,315,456円	993,250,370円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 4月 1日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	107,471,654
コール・ローン	3,482,143,919
株式	276,010,774,890
派生商品評価勘定	51,783,640
未収入金	294,638,324
未収配当金	3,100,927,198
差入委託証拠金	248,157,500
流動資産合計	283,295,897,125
資産合計	283,295,897,125
負債の部	
流動負債	
前受金	51,796,600
未払金	821,645,100
未払解約金	111,420,772
未払利息	9,383
その他未払費用	11,864
流動負債合計	984,883,719
負債合計	984,883,719
純資産の部	
元本等	
元本	190,025,317,175
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,285,696,231
元本等合計	282,311,013,406
純資産合計	282,311,013,406
負債純資産合計	283,295,897,125

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 4月 1日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

	2019年 4月 1日現在
	<p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2019年 4月 1日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	190,025,317,175口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4856円 (1万口当たり純資産額) (14,856円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 4月 1日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 4月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月 2日
期首元本額	140,967,747,516円
期中追加設定元本額	55,484,512,727円
期中一部解約元本額	6,426,943,068円
期末元本額	190,025,317,175円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	633,792,724円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,913,253,192円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,686,111円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,937,278,175円
世界経済インデックスファンド	2,016,952,310円
日本株式インデックス・オープン	5,579,067,677円
D C マイセレクション 2 5	6,677,830,919円
D C マイセレクション 5 0	18,998,067,805円
D C マイセレクション 7 5	17,509,470,626円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,531,413,152円
D C マイセレクション S 2 5	2,679,889,230円
D C マイセレクション S 5 0	7,653,274,283円
D C マイセレクション S 7 5	5,071,567,317円
D C 日本株式インデックス・オープン S	6,238,731,045円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	372,657,758円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	629,632,613円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	413,538,083円
D C 世界経済インデックスファンド	1,720,459,061円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,140,544,943円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,404,163円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	44,753,307円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	42,809,598円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	313,670,007円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,717,839円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	114,881,083円

区分	2019年 4月 1日現在
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	396,881,053円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	63,748,120円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	590,204,951円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,981,230,834円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	776,218,822円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,473,734,287円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	682,040,486円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	48,941,976円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	876,248,621円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	57,081,483円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	489,589,549円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	625,957,377円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	56,564,324円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	920,441,181円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,163,043,332円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,225,250,453円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	953,649,556円
分散投資コア戦略ファンドS	2,096,892,358円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	225,932,213円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	259,366,063円
コア投資戦略ファンド(切替型)	792,730,531円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	226,931,126円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,223,235円
SMT インデックスバランス・オープン	75,254,193円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,825,564,533円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	740,838,148円
SMT 世界経済インデックス・オープン	10,610,318円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	54,715,532円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	7,868,192円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,870,103円
グローバル経済コア	333,389,279円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	9,227,596円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	42,263,671円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	830,761円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	99,506,532円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	21,142,228円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	51,000,794,692円

区分	2019年 4月 1日現在
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	681,614,841円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2019年 4月 1日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,229,153,400	-	6,280,950,000	51,796,600
	合計	6,229,153,400	-	6,280,950,000	51,796,600

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2019年 4月 1日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	56,943,070
コール・ローン	1,844,988,491
国債証券	377,776,883,550
地方債証券	24,937,291,821
特殊債券	31,267,263,142
社債券	18,535,153,310
未収入金	4,024,074,300
未収利息	527,121,775
前払費用	12,201,646
流動資産合計	458,981,921,105
資産合計	458,981,921,105
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	140,324
未払金	5,223,354,200
未払解約金	100,112,929
未払利息	4,971
その他未払費用	7,307
流動負債合計	5,323,619,731
負債合計	5,323,619,731
純資産の部	
元本等	
元本	320,476,745,194



	2019年 4月 1日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	133,181,556,180
元本等合計	453,658,301,374
純資産合計	453,658,301,374
負債純資産合計	458,981,921,105

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 4月 1日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 4月 1日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	320,476,745,194口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 102,086,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4156円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,156円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 4月 1日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 4月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月 2日
期首元本額	299,993,190,511円
期中追加設定元本額	34,600,164,801円
期中一部解約元本額	14,116,610,118円
期末元本額	320,476,745,194円
期末元本額の内訳	

区分	2019年 4月 1日現在
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,961,251,092円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,743,196円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,234,668,317円
世界経済インデックスファンド	1,823,591,359円
D C マイセレクション 2 5	19,869,745,100円
D C マイセレクション 5 0	21,754,137,767円
D C マイセレクション 7 5	5,842,724,018円
D C 日本債券インデックス・オープン	454,214,191円
D C 日本債券インデックス・オープン S	82,237,423,332円
D C 日本債券インデックス・オープン P	37,846,956,470円
D C マイセレクション S 2 5	7,973,246,677円
D C マイセレクション S 5 0	8,781,980,261円
D C マイセレクション S 7 5	1,693,716,305円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,162,357,492円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,238,851,855円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	414,480,939円
D C 世界経済インデックスファンド	1,556,459,716円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	86,239,675円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	7,727,289円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	51,179,428円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	14,273,337円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	228,709,703円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	324,070,285円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	62,805,308円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	169,593,729円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	4,565,423,852円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	978,692,082円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	3,696,861,040円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	839,927,160円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	110,500,371円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	1,319,219,010円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	41,959,093円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,493,842,056円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,885,509,078円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	168,312,276円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	6,524,281,333円
日本債券ファンド・シリーズ 1	9,929,140,624円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	63,892,287円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	750,638,272円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	59,275,446円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,759,737円

区分	2019年 4月 1日現在
S M T インデックスバランス・オープン	67,234,214円
S M T 世界経済インデックス・オープン	8,330,042円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	11,451,432円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	21,530,482円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,832,124円
グローバル経済コア	247,848,664円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	9,287,776円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	375,947円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	18,784円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	14,886円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,633円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	7,089円
F O F s用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	74,839,329,090円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2019年 4月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	153,300,000	-	153,160,000	140,000
	合計	153,300,000	-	153,160,000	140,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2019年 4月 1日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,229,205,851
金銭信託	6,744,585
コール・ローン	218,528,466
株式	341,119,529,208
投資信託受益証券	258,583,827
投資証券	9,153,881,192

	2019年 4月 1日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	93,287,069
未収入金	28,739,311
未収配当金	696,403,814
差入委託証拠金	3,479,597,045
流動資産合計	357,284,500,368
資産合計	357,284,500,368
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	155,051
前受金	92,933,218
未払解約金	50,291,226
未払利息	588
その他未払費用	1,664
流動負債合計	143,381,747
負債合計	143,381,747
純資産の部	
元本等	
元本	139,680,982,723
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	217,460,135,898
元本等合計	357,141,118,621
純資産合計	357,141,118,621
負債純資産合計	357,284,500,368

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 4月 1日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

2019年 4月 1日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月 1日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	139,680,982,723口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.5568円 (1万口当たり純資産額) (25,568円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 4月 1日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 4月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月 2日
期首元本額	136,878,559,539円
期中追加設定元本額	10,881,395,078円
期中一部解約元本額	8,078,971,894円
期末元本額	139,680,982,723円
期末元本額の内訳	

区分	2019年 4月 1日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,421,386,883円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,745,067円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,238,820,299円
世界経済インデックスファンド	7,540,957,917円
外国株式インデックス・オープン	982,935,412円
D C マイセレクション 2 5	1,069,626,258円
D C マイセレクション 5 0	4,875,916,491円
D C マイセレクション 7 5	5,156,364,806円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,247,027,349円
D C マイセレクション S 2 5	427,144,673円
D C マイセレクション S 5 0	1,962,848,709円
D C マイセレクション S 7 5	1,487,985,983円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	109,203,080円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	184,506,742円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	121,180,370円
D C 世界経済インデックスファンド	6,369,223,621円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,806,022,113円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	11,490,630円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	12,713,118円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	57,878,038円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	65,777,487円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	232,995,924円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	36,854,057円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	341,229,925円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	770,973,228円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	393,112,414円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,582,241,009円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,950,792,203円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	83,965,791円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	381,345,263円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	13,758,259円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	130,923,923円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,018,554,400円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,226,769,005円
外国株式ファンド・シリーズ 1	897,457,791円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,621,205,435円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,841,230,538円
分散投資コア戦略ファンド A	2,249,840,048円
分散投資コア戦略ファンド S	4,610,173,575円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	839,763,019円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	989,230,274円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,709,204,311円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	848,988,309円



区分	2019年 4月 1日現在
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	43,654,935円
SMT インデックスバランス・オープン	284,030,536円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,786,030,742円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	31,183,990,800円
SMT 世界経済インデックス・オープン	60,987,003円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	314,523,558円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	46,818,110円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,091,828円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	38,535,437円
グローバル経済コア	1,183,036,827円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,646,396円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	243,394円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	215,692,877円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	50,461,562円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	58,867円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	66,613円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	74,359円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	81,330円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,495,365,440円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	886,240,290円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,154,988,072円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2019年 4月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,615,652,442	-	6,708,585,660	92,933,218
	合計	6,615,652,442	-	6,708,585,660	92,933,218

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2019年 4月 1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	364,046,720	-	364,245,520	198,800
	アメリカドル	364,046,720	-	364,245,520	198,800
合計		364,046,720	-	364,245,520	198,800

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2019年 4月 1日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	139,495,149
金銭信託	94,624,789
コール・ローン	3,065,898,027
国債証券	282,593,473,643
派生商品評価勘定	13,477,619
未収入金	3,774,212,930
未収利息	2,005,130,953
前払費用	306,111,844
差入委託証拠金	170,930,930
流動資産合計	292,163,355,884
資産合計	292,163,355,884
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,786,593
前受金	10,392,070
未払金	5,244,035,018
未払解約金	135,342,784
未払利息	8,261
その他未払費用	10,396
流動負債合計	5,395,575,122
負債合計	5,395,575,122
純資産の部	
元本等	
元本	103,498,467,853
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	183,269,312,909
元本等合計	286,767,780,762
純資産合計	286,767,780,762
負債純資産合計	292,163,355,884

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 4月 1日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 4月 1日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	103,498,467,853口

		2019年 4月 1日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7707円 (27,707円)	

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

		2019年 4月 1日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。		
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。		

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2019年 4月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2018年10月 2日

区分	2019年 4月 1日現在
期首元本額	95,813,127,162円
期中追加設定元本額	19,443,455,776円
期中一部解約元本額	11,758,115,085円
期末元本額	103,498,467,853円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,841,714,032円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	758,538,194円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	509,785,573円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,979,209,212円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,866,917円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,168,168,204円
世界経済インデックスファンド	6,507,763,050円
D C マイセレクション 2 5	1,642,307,187円
D C マイセレクション 5 0	1,247,609,541円
D C マイセレクション 7 5	799,683,564円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,815,532,937円
D C マイセレクション S 2 5	659,071,614円
D C マイセレクション S 5 0	505,239,827円
D C マイセレクション S 7 5	231,676,639円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	49,807,506円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	63,788,189円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	30,415,682円
D C 世界経済インデックスファンド	5,471,588,233円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	619,918,009円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	43,011,820円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,922,296円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,938,498円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	60,679,911円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	134,572,039円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	201,038,158円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	161,453,561円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	498,267,714円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,304,897,400円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	629,077,339円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,240,526,833円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	899,736,328円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	90,385,988円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	654,451,628円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	54,902,909円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	247,279,184円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	313,178,925円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,034,035,611円

区分	2019年 4月 1日現在
グローバル債券ファンド・シリーズ1 (適格機関投資家専用)	958,241,018円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	843,201,395円
外国債券ファンド・シリーズ1	453,583,599円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,086,464,952円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,526,593,780円
分散投資コア戦略ファンドA	945,482,675円
分散投資コア戦略ファンドS	2,802,492,885円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	237,500,000円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,519,504,123円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,033,944,550円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	239,084,658円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,193,390円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,028,489,185円
SMT インデックスバランス・オープン	241,138,294円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	24,516,460,481円
SMT 世界経済インデックス・オープン	51,855,781円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	88,934,793円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	120,300,629円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	981,490円
グローバル経済コア	1,038,828,568円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,797,236円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	47,974円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	87,931,536円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	12,405,520円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	798,346,634円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,829,030,670円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	355,145,613円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	9,084,347,000円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2019年 4月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,382,174,411	-	1,392,566,481	10,392,070

合計	1,382,174,411	-	1,392,566,481	10,392,070
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)1.時価の算定方法

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

- 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2019年 4月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,768,274,048	-	3,765,577,564	2,696,484
	アメリカドル	2,285,520,397	-	2,286,885,669	1,365,272
	カナダドル	82,872,339	-	83,130,000	257,661
	メキシコペソ	33,672,031	-	33,607,538	64,493
	ユーロ	1,032,105,608	-	1,028,911,302	3,194,306
	イギリスポンド	132,434,682	-	131,476,800	957,882
	スウェーデンクローナ	2,385,834	-	2,385,037	797
	ノルウェークローネ	37,544,470	-	37,526,904	17,566
	デンマーククローネ	3,904,669	-	3,903,731	938
	ポーランドズロチ	69,840,933	-	69,790,358	50,575
	オーストラリアドル	31,051,821	-	31,052,529	708
	シンガポールドル	24,861,996	-	24,863,484	1,488
	マレーシアリングット	32,079,268	-	32,044,212	35,056
	売建	587,570,040	-	587,574,600	4,560
	カナダドル	226,255,040	-	226,249,600	5,440
	イギリスポンド	361,315,000	-	361,325,000	10,000
	合計		4,355,844,088	-	4,353,152,164

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【DCマイセレクション25】

## 【純資産額計算書】

(2019年 4月26日現在)

資産総額	47,554,589,600円
負債総額	37,211,454円
純資産総額( - )	47,517,378,146円
発行済口数	28,699,422,273口
1口当たり純資産額( / )	1.6557円
(1万口当たり純資産額)	(16,557円)

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2019年 4月26日現在)

資産総額	281,760,290,818円
負債総額	1,010,039,292円
純資産総額( - )	280,750,251,526円
発行済口数	188,690,591,310口
1口当たり純資産額( / )	1.4879円
(1万口当たり純資産額)	(14,879円)

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2019年 4月26日現在)

資産総額	457,241,673,330円
負債総額	2,858,204,004円
純資産総額( - )	454,383,469,326円
発行済口数	321,523,640,868口
1口当たり純資産額( / )	1.4132円
(1万口当たり純資産額)	(14,132円)



## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2019年 4月26日現在)

資産総額	367,478,890,807円
負債総額	1,665,989,346円
純資産総額（ - ）	365,812,901,461円
発行済口数	137,973,630,947口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6513円
（1万口当たり純資産額）	（26,513円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2019年 4月26日現在)

資産総額	312,530,538,495円
負債総額	403,306,050円
純資産総額（ - ）	312,127,232,445円
発行済口数	113,027,150,709口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7615円
（1万口当たり純資産額）	（27,615円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

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

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2019年 4月26日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2019年 6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年4月26日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	521	12,071,421
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	89	386,551
単位型公社債投資信託	0	0
合計	610	12,457,972

## 3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭

和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第33期事業年度の中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,260,630	23,973,152
前払費用	143,622	157,614
未収委託者報酬	5,252,944	5,373,307
繰延税金資産	61,677	94,211
その他	5,474	9,842
流動資産合計	25,724,348	29,608,128
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 47,993	1 36,782
器具備品	1 73,765	1 79,655
その他	1 2,830	1 1,912
有形固定資産合計	124,589	118,350
無形固定資産		
ソフトウェア	221,499	210,679
その他	6,656	4,377
無形固定資産合計	228,156	215,056
投資その他の資産		
投資有価証券	71,153	42,802
長期前払費用	9,828	7,810
長期貸付金	19,838	17,088
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	137,359	154,422
その他	145	70
貸倒引当金	19,838	17,088
投資その他の資産合計	243,485	230,105
固定資産合計	596,231	563,512
資産合計	26,320,580	30,171,641

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日現在）	当事業年度 （平成30年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	13,630	24,591
未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863
その他未払金	784,201	789,595
未払費用	67,780	74,279
未払法人税等	863,230	838,596
未払消費税等	91,120	72,890
賞与引当金	98,072	106,177
その他	3,100	1,241
流動負債合計	4,020,860	4,068,279
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	13,148	13,374
退職給付引当金	437,197	496,696
その他	2,065	1,074
固定負債合計	452,411	511,145
負債合計	4,473,271	4,579,425
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	71,500	74,500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	19,026,944	22,767,534
利益剰余金合計	21,198,444	24,942,034
株主資本合計	21,848,444	25,592,034
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	1,134	182
評価・換算差額等合計	1,134	182
純資産合計	21,847,309	25,592,216
負債・純資産合計	26,320,580	30,171,641

## （２）【損益計算書】

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178
営業収益合計	30,245,448	29,206,178
営業費用		
支払手数料	12,880,325	12,544,178
広告宣伝費	95,688	175,296
公告費	3,094	-
調査費	6,239,223	6,008,380
調査費	360,520	396,842
委託調査費	5,876,937	5,609,496
図書費	1,766	2,041
営業雑経費	1,460,885	1,474,361
通信費	24,920	33,158
印刷費	370,785	368,414
協会費	30,665	36,616
諸会費	105	105
情報機器関連費	943,725	942,093
その他営業雑経費	90,684	93,973
営業費用合計	20,679,217	20,202,216
一般管理費		
給料	1,874,710	2,006,157
役員報酬	89,520	84,130
給料・手当	1,526,244	1,649,268
賞与	258,946	272,758
退職給付費用	76,106	84,944
福利費	221,018	239,702
交際費	5,612	5,831
旅費交通費	61,961	73,807
租税公課	106,691	102,158
不動産賃借料	113,697	124,629
減価償却費	134,710	119,300
業務委託費	1 486,690	1 484,841
諸経費	223,685	246,326
一般管理費合計	3,304,885	3,487,699
営業利益	6,261,346	5,516,262

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取利息	4,669	2,136

収益分配金		129		116
投資有価証券売却益		307		499
貸倒引当金戻入		3,000		2,750
その他		1,591		4,351
営業外収益合計		9,697		9,854
営業外費用				
長期前払費用償却	1	4,644	1	-
投資有価証券売却損		604		2,224
固定資産除却損		-		7,891
その他		0		1,182
営業外費用合計		5,249		11,298
経常利益		6,265,794		5,514,818
特別損失				
統合関連費用		-		51,569
特別損失合計		-		51,569
税引前当期純利益		6,265,794		5,463,248
法人税、住民税及び事業税		1,889,846		1,739,837
法人税等調整額		45,558		50,178
法人税等合計		1,935,405		1,689,659
当期純利益		4,330,389		3,773,589

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389



株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	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	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

#### 時価のあるもの

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

#### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

ただし、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。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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検討し、回収不能見込額を計上しております。

#### (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）
- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

### (1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異が見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

### (2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

## 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
建物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	"	325,834	"
その他	1,759	"	2,677	"
計	362,567	"	392,342	"

## （損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)		当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	"	-	"

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

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

決議	株式の 種類	配当金の 総額(千円)	配当金 の原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株 式	30,000	利益剰余金	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

当事業年度（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

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

平成30年6月29日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成30年3月31日	平成30年6月29日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

### 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	20,260,630	20,260,630	-
（2）未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
（4）未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
（5）未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
（2）未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
（4）未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
（5）未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1） 金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（単位：千円）

区分	平成29年3月31日	平成30年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29年3月31日）

（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	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499
----------------	---	--------	--------	-------

当事業年度（平成30年3月31日）

（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	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

（有価証券関係）

## 1. その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの			
その他	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

当事業年度（平成30年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの			
その他	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 退職給付債務	437,197	496,696
(2) 退職給付引当金	437,197	496,696

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

## 3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 退職給付費用	76,106	84,944

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

## 4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

## 1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	28,688	千円	42,041	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,074	"	5,232	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,265	"	32,511	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	133,869	"	152,088	"
その他	6,972	"	23,674	"
繰延税金資産 合計	205,870	"	255,547	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
その他	-	"	80	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,913	"
繰延税金資産の純額	199,037	"	248,633	"

## 2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

## （持分法損益等）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

## （セグメント情報）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

## （関連情報）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## （2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,568,158千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

## （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）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引



(ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
該当事項はありません。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等  
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成29年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成30年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	7,282,436円46銭	8,530,738円79銭
1株当たり当期純利益金額	1,443,463円05銭	1,257,863円25銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

### 中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		23,034,588
預け金		1,999,987
未収委託者報酬		6,297,689
その他流動資産		160,541
流動資産合計		31,492,806

##### 固定資産

##### 有形固定資産

建物	1	35,878
器具備品	1	94,797
その他有形固定資産	1	1,967
有形固定資産合計		132,642

##### 無形固定資産

476,662

##### 投資その他の資産

投資有価証券		37,334
会員権		25,000
繰延税金資産		244,590
その他		4,358
投資その他の資産合計		311,284

##### 固定資産合計

920,589

##### 資産合計

32,413,396

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金		3,522,021
未払費用		119,978
未払法人税等		768,587
賞与引当金		119,869
その他流動負債	2	107,652
流動負債合計		4,638,109

##### 固定負債

退職給付引当金	530,260
資産除去債務	13,489
その他固定負債	578
固定負債合計	544,327
負債合計	5,182,436

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	75,000
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	24,405,169
利益剰余金合計	26,580,169
株主資本合計	27,230,169
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	789
評価・換算差額等合計	789
純資産合計	27,230,959
負債・純資産合計	32,413,396

## 中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		14,970,762
営業収益合計		14,970,762
営業費用		10,448,993
一般管理費	1	2,088,498
営業利益		2,433,271
営業外収益	2	23,558
営業外費用		8,748
経常利益		2,448,081
特別損失		49,894
税引前中間純利益		2,398,187
法人税、住民税及び事業税		726,276
法人税等調整額		3,774

法人税等合計  
中間純利益

730,051

1,668,135

## 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
中間純利益			1,668,135	1,668,135	1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	500	-	1,637,635	1,638,135	1,638,135
当中間期末残高	75,000	2,100,000	24,405,169	26,580,169	27,230,169

	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	182	182	25,592,216
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	607	607	607
当中間期変動額合計	607	607	1,638,742
当中間期末残高	789	789	27,230,959

## 重要な会計方針

第33期中間会計期間  
（自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## 有価証券

## その他有価証券

## 時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

## 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

## (有形固定資産の減価償却方法の変更)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016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）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。

なお、この変更による当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に及ぼす

影響は軽微であります。

## 表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

第33期中間会計期間  
（自 2018年4月1日  
至 2018年9月30日）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間末  
（2018年9月30日）

1	有形固定資産の減価償却累計額	
	建物	66,454千円
	器具備品	342,351千円
	その他有形固定資産	3,136千円
	計	411,942千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第33期中間会計期間  
（自 2018年4月1日  
至 2018年9月30日）

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	19,715千円
	無形固定資産	44,989千円
2	営業外収益の主要項目	
	受取利息	819千円
	貸倒引当金戻入	17,088千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
-------	---------	-----------	-----------	----------

普通株式（株）	3,000	-	-	3,000
---------	-------	---	---	-------

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

2018年9月30日における貸借対照表計上額、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）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	23,034,588	23,034,588	-
(2)預け金	1,999,987	1,999,987	-
(3)未収委託者報酬	6,297,689	6,297,689	-
(4)投資有価証券 其他有価証券	37,331	37,331	-
(5)未払金	(3,522,021)	(3,522,021)	-
(6)未払法人税等	(768,587)	(768,587)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## （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

## (1)現金及び預金、(2)預け金、並びに(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。

## (4)投資有価証券

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

## (5)未払金、並びに(6)未払法人税等

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）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（4）投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他	21,579	19,493	2,085
小計	21,579	19,493	2,085
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	15,752	16,700	947
小計	15,752	16,700	947
合計	37,331	36,193	1,137

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

（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）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。



（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
1株当たり純資産額	9,076,986円44銭
1株当たり中間純利益	556,045円23銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
中間純利益	1,668,135千円
普通株式に係る中間純利益	1,668,135千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

（共通支配下の取引等）

1．取引の概要

(1) 対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

(2) 企業結合日

2018年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

(5) その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

2．実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定であります。

（その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加）

当社は、2018年9月28日開催の臨時株主総会において、その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加について決議しており、2018年10月1日付で実行しております。

1. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の目的  
資本規模の充実を図るため、会社法第450条第1項の規定に基づき、その他資本剰余金の額の減少を行い、その全額を資本金に組み入れることにしました。
2. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の要領
  - (1) 減少すべきその他資本剰余金の額  
その他資本剰余金18,939,438千円のうち1,700,000千円を減少します。
  - (2) その他資本剰余金の額の減少方法  
減少すべきその他資本剰余金の額の全額を資本金に組み入れます。  
資本金の額は2,000,000千円になります。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

##### (1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社は2018年10月1日付けで監査等委員会の設置等に関し、定款の変更を行いました。

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2019年 6月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2018年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社愛媛銀行	21,359	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
第一生命保険株式会社	60,000	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

#### (2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

### 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

ことがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年 6月 1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32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。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成30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。

### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2018年11月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

印

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DCマイセレクション25の2017年10月3日から2018年10月1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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

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、DCマイセレクション25の2018年10月1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。

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2018年12月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤 澤	孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹 内	知 明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の中間監査報告書

2019年5月31日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

印

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DCマイセレクション25の2018年10月2日から2019年4月1日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCマイセレクション25の2019年4月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年10月2日から2019年4月1日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。