

【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】	2020年6月30日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCマイセレクション75
【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75

（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】

2020年 7月 1日から2020年12月28日までとします。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとし、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】

<ファンドの目的>

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。

<信託金限度額>

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。

<基本的性格>

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－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－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－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。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1)プル・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

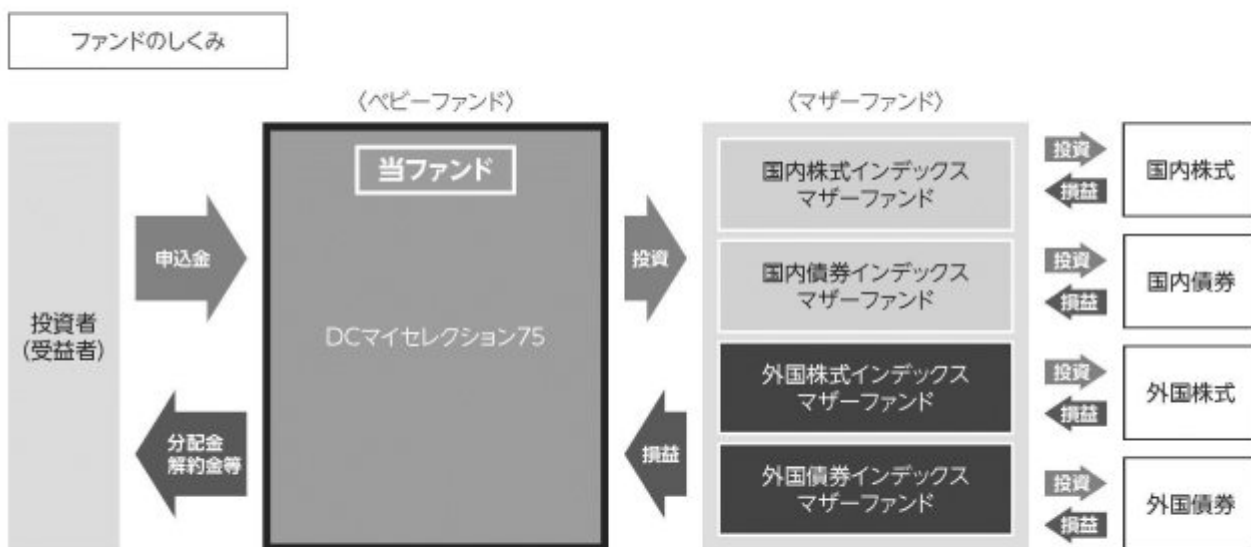
託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

- (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ペーパーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

2. 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) ¹
国内債券	NOMURA-BPI 総合 ²
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス (円ベース) ³
外国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) ⁴

* 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。

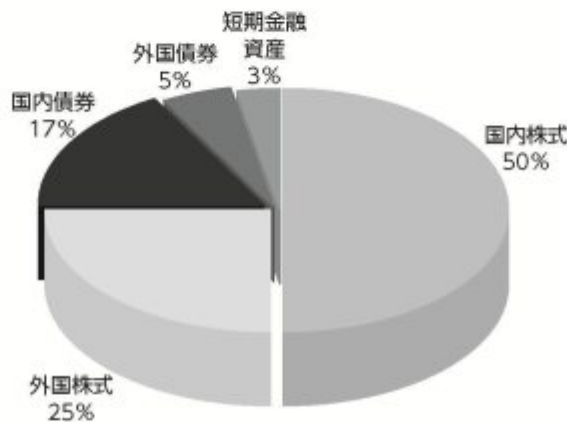
- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- ※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォー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50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%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85%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40%以下とします。

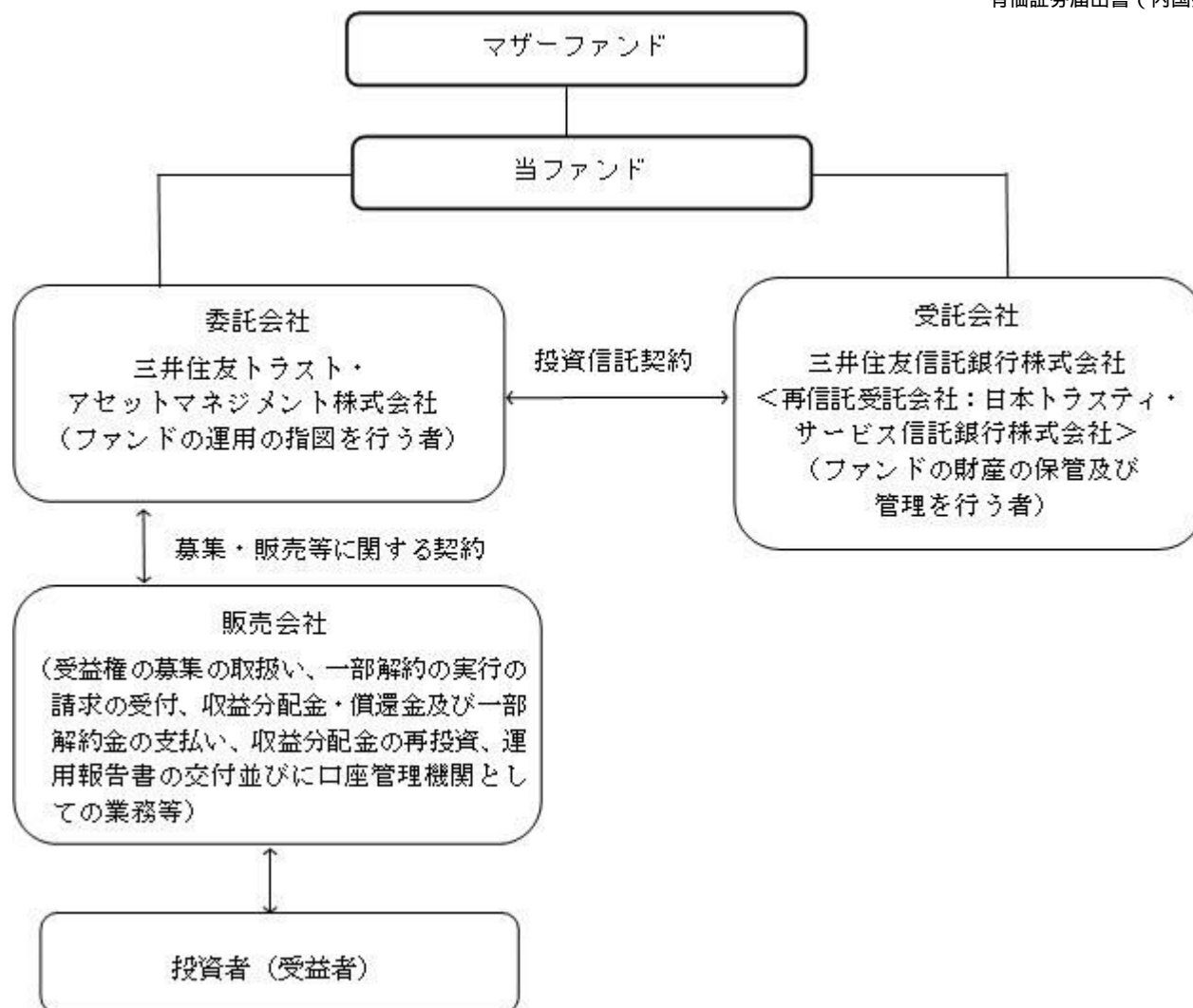
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(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75」から「DCマイセレクション75」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



再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

委託会社の概況（2020年 4月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

(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50%、国内債券17%、外国株式25%、外国債券5%および短期金融資産3%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

ニ．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券

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．コマースナル・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せん。）

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、金利先渡し取引および為替先渡し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。

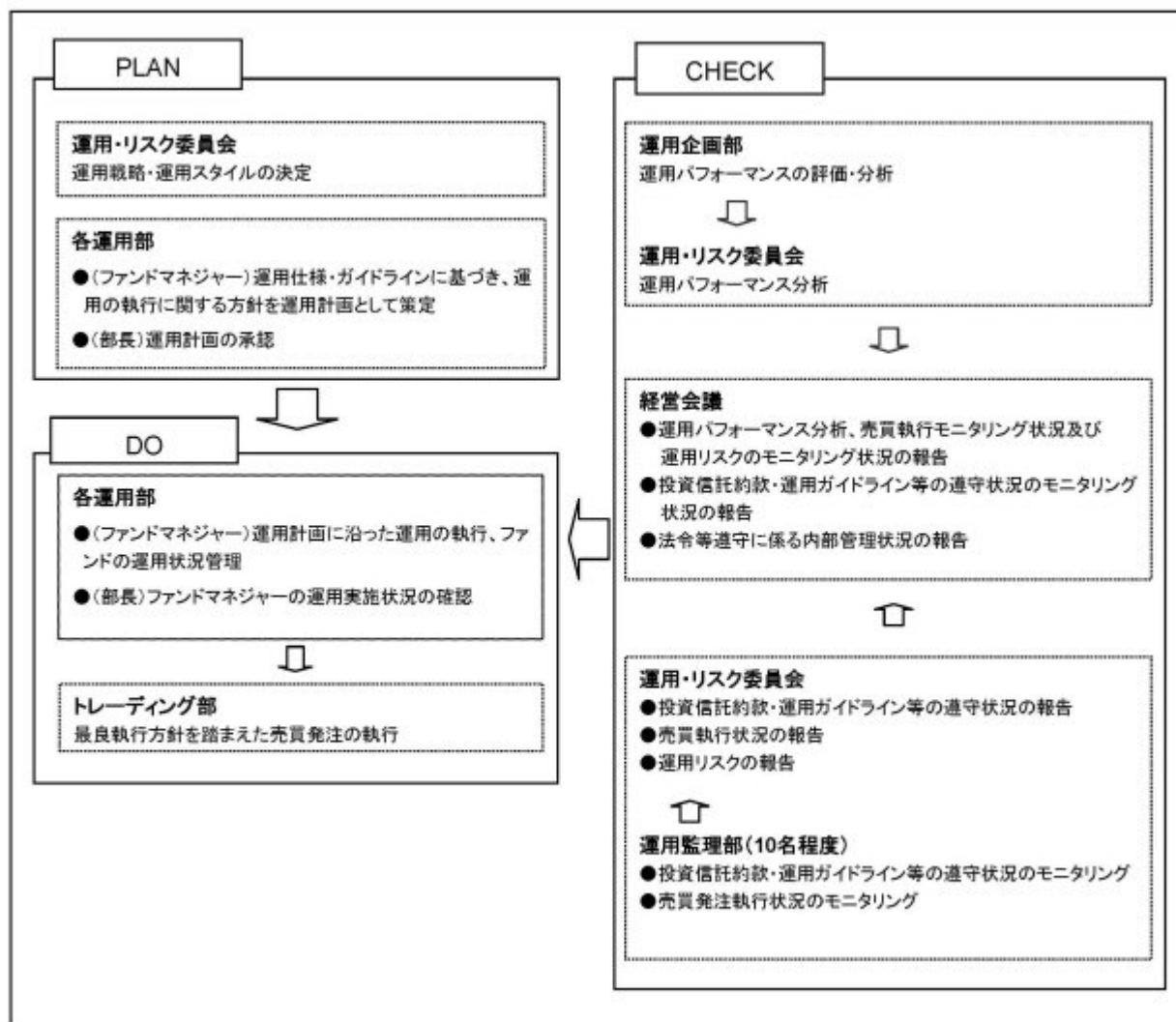
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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85%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40%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。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、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、（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、

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。

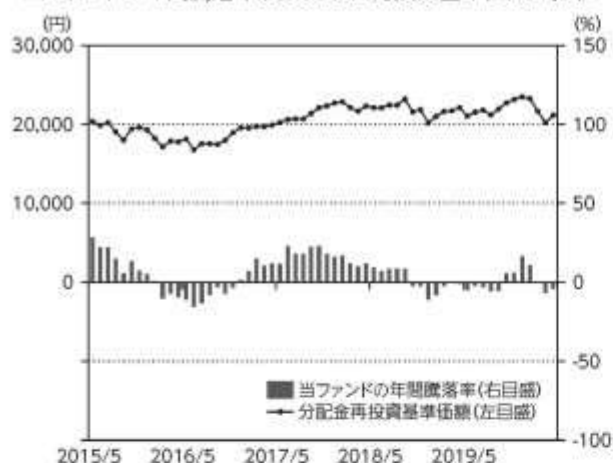
(ロ) リスクの管理体制

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】

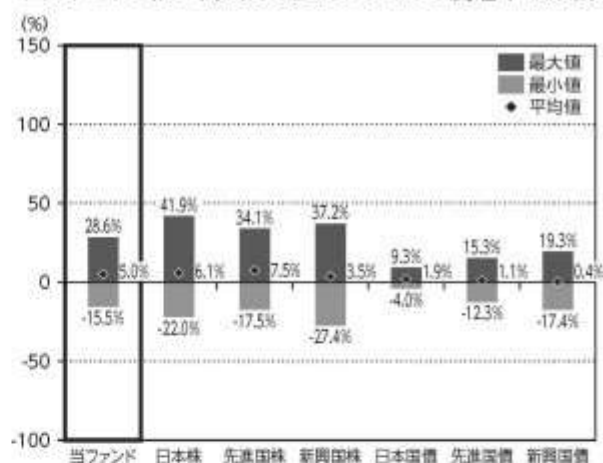
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2015年5月～2020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について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、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。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEIグローバル・ボンド・インデックス・エマージング・ マーケット・ロー・/ハイ・ティーン・ファイブ(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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 0.352%（税抜 0.32%）（ ）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 0.187% (税抜 0.17%)	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 0.132% (税抜 0.12%)	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、2020年4月30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、2020年4月30日現在の状況について記載してあります。

【DCマイセクション75】

（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	47,826,487,011	97.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,449,468,633	2.94
合計(純資産総額)		49,275,955,644	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	国内株式インデックス マザーファンド	17,932,070,340	1.4581	26,147,723,904	1.3822	24,785,707,623	50.30
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	4,978,601,648	2.5212	12,552,272,244	2.4792	12,342,949,205	25.05
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	5,837,881,784	1.4317	8,358,574,233	1.4197	8,288,040,768	16.82

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	842,024,325	2.8357	2,387,762,746	2.8619	2,409,789,415	4.89
----	-----------	--------------------	-------------	--------	---------------	--------	---------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.06
合計	97.06

(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9期計算期間末	(2010年 9月30日)	16,131,827,028	16,131,827,028	10,338	10,338
第10期計算期間末	(2011年 9月30日)	17,023,679,540	17,023,679,540	9,740	9,740
第11期計算期間末	(2012年10月 1日)	19,440,154,386	19,440,154,386	10,260	10,260
第12期計算期間末	(2013年 9月30日)	28,620,541,787	28,620,541,787	14,959	14,959
第13期計算期間末	(2014年 9月30日)	33,482,824,281	33,482,824,281	17,076	17,076
第14期計算期間末	(2015年 9月30日)	35,594,656,829	35,594,656,829	18,009	18,009
第15期計算期間末	(2016年 9月30日)	36,342,020,872	36,342,020,872	17,450	17,450
第16期計算期間末	(2017年10月 2日)	45,362,951,367	45,362,951,367	21,401	21,401
第17期計算期間末	(2018年10月 1日)	52,993,517,919	52,993,517,919	23,203	23,203
第18期計算期間末	(2019年 9月30日)	51,706,907,032	51,706,907,032	21,959	21,959
	2019年 4月末日	51,290,159,911		22,118	
	5月末日	49,068,797,298		21,034	
	6月末日	50,349,727,121		21,542	
	7月末日	51,168,124,140		21,793	
	8月末日	50,022,931,545		21,191	
	9月末日	51,706,907,032		21,959	
	10月末日	53,539,882,314		22,725	

11月末日	54,437,653,044		23,149
12月末日	55,261,869,761		23,488
2020年 1月末日	54,843,048,766		23,257
2月末日	50,909,428,986		21,664
3月末日	47,197,542,441		20,229
4月末日	49,275,955,644		21,156

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	2.9
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	5.8
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	5.3
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	45.8
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	14.2
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	5.5
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	3.1
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	22.6
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	8.4
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	5.4
第19期中間計算期間	2019年10月 1日～2020年 3月31日	7.9

(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9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	2,824,764,190	1,062,037,170	15,604,691,547
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	3,149,786,275	1,276,681,816	17,477,796,006
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	2,819,375,711	1,350,257,742	18,946,913,975
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	3,425,315,153	3,238,964,390	19,133,264,738
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	2,840,594,590	2,365,992,578	19,607,866,750
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3,273,383,820	3,115,996,674	19,765,253,896
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	2,775,993,818	1,714,409,012	20,826,838,702
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	3,008,685,113	2,638,389,799	21,197,134,016
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	3,893,957,849	2,252,056,125	22,839,035,740
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	3,074,624,736	2,366,988,957	23,546,671,519
第19期中間計算期間	2019年10月 1日～2020年 3月31日	1,768,758,626	1,984,281,030	23,331,149,115

(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	286,968,208,760	97.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,194,144,181	2.11
合計(純資産総額)		293,162,352,941	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	6,295,820,000	2.15

(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	1,556,700	6,649.73	10,351,639,992	6,666.00	10,376,962,200	3.54
日本	株式	ソニー	電気機器	874,000	5,507.82	4,813,837,720	6,932.00	6,058,568,000	2.07
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,086,300	5,087.33	5,526,375,960	4,633.00	5,032,827,900	1.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	126,400	31,674.04	4,003,599,340	38,770.00	4,900,528,000	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,160,800	3,802.81	4,414,312,804	3,883.00	4,507,386,400	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,830,100	2,470.18	4,520,688,415	2,443.00	4,470,934,300	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,413,000	503.64	4,740,822,212	434.30	4,088,065,900	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	85,500	38,880.57	3,324,288,806	44,650.00	3,817,575,000	1.30
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,011,400	2,629.28	2,659,258,627	3,148.00	3,183,887,200	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,020,300	2,817.32	2,874,520,668	3,109.00	3,172,112,700	1.08
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	955,000	3,565.79	3,405,330,416	3,182.00	3,038,810,000	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	399,200	5,649.20	2,255,163,640	7,382.00	2,946,894,400	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,098,500	2,731.26	3,000,296,364	2,610.50	2,867,634,250	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	234,600	9,583.26	2,248,233,622	12,015.00	2,818,719,000	0.96
日本	株式	花王	化学	334,100	8,540.19	2,853,278,390	8,316.00	2,778,375,600	0.95
日本	株式	HOYA	精密機器	278,600	8,107.92	2,258,868,908	9,866.00	2,748,667,600	0.94
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	951,700	3,729.01	3,548,900,398	2,844.00	2,706,634,800	0.92
日本	株式	ダイキン工業	機械	177,800	13,757.48	2,446,081,408	14,005.00	2,490,089,000	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	486,500	5,521.22	2,686,077,184	5,086.00	2,474,339,000	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	409,900	4,770.66	1,955,495,534	6,019.00	2,467,188,100	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	132,600	18,269.80	2,422,575,664	17,830.00	2,364,258,000	0.81

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,698,200	153.30	2,866,490,151	125.80	2,352,233,560	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	964,300	2,794.86	2,695,088,933	2,300.00	2,217,890,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	670,400	3,779.08	2,533,501,880	3,241.00	2,172,766,400	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,209,700	1,549.40	1,874,316,280	1,786.50	2,161,129,050	0.74
日本	株式	S M C	機械	43,800	38,357.07	1,680,039,720	49,000.00	2,146,200,000	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	335,800	6,816.56	2,289,003,620	6,286.00	2,110,838,800	0.72
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	961,100	2,041.65	1,962,231,980	2,125.00	2,042,337,500	0.70
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	88,500	15,811.48	1,399,316,639	22,940.00	2,030,190,000	0.69
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	116,000	22,137.79	2,567,984,024	17,005.00	1,972,580,000	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別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	0.10
		鉱業	0.21
		建設業	2.59
		食料品	3.93
		繊維製品	0.51
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.15
		医薬品	6.50
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.74
		鉄鋼	0.55
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.53
		機械	4.95
		電気機器	14.41
輸送用機器	7.24		
精密機器	2.53		
その他製品	2.41		

	電気・ガス業	1.63
	陸運業	4.21
	海運業	0.14
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.60
	卸売業	4.57
	小売業	4.66
	銀行業	5.07
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.15
	その他金融業	1.07
	不動産業	2.12
	サービス業	5.04
	小計	97.89
合計		97.89

(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	433円		6,142,333,900	6,295,820,000	2.15

(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	448,495,377,950	83.51

地方債証券	日本	28,767,516,576	5.36
特殊債券	日本	36,118,487,480	6.73
社債券	日本	20,493,449,230	3.82
	フランス	1,888,796,000	0.35
	オーストラリア	398,464,000	0.07
	アメリカ	204,934,000	0.04
	イギリス	99,623,000	0.02
	小計	23,085,266,230	4.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		595,679,127	0.11
合計(純資産総額)		537,062,327,363	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,510,000,000	101.37	9,640,287,000	101.04	9,609,189,300	0.100	2023/12/20	1.79
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	101.97	7,444,538,800	101.16	7,385,191,000	0.100	2024/6/20	1.38
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	102.47	7,111,793,200	101.74	7,060,964,200	0.100	2026/9/20	1.31
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	101.57	7,008,870,600	100.97	6,966,999,000	0.100	2023/9/20	1.30
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	103.10	6,515,920,000	0.400	2025/9/20	1.21
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	6,050,000,000	101.33	6,131,015,300	101.23	6,124,899,000	0.100	2024/12/20	1.14
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	6,050,000,000	101.27	6,127,353,300	100.78	6,097,311,000	0.100	2022/12/20	1.14
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	6,020,000,000	101.36	6,101,914,500	101.21	6,093,203,200	0.100	2024/9/20	1.13
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	5,880,000,000	102.39	6,020,532,000	101.60	5,974,315,200	0.100	2026/3/20	1.11
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	102.64	5,943,420,000	101.95	5,903,136,600	0.100	2028/3/20	1.10
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,230,000,000	103.97	5,437,631,000	102.95	5,384,441,900	0.400	2025/6/20	1.00
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	4,940,000,000	102.98	5,087,243,100	101.94	5,036,033,600	0.100	2027/9/20	0.94
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	4,940,000,000	103.04	5,090,176,000	101.61	5,019,534,000	0.100	2029/6/20	0.93
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	4,990,000,000	100.81	5,030,419,000	100.54	5,017,345,200	0.100	2022/3/20	0.93
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	100.89	4,812,641,300	100.62	4,799,669,400	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	101.96	4,659,754,800	1.000	2021/12/20	0.87

日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	4,470,000,000	102.03	4,560,741,000	101.78	4,549,878,900	0.100	2028/12/20	0.85
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	4,380,000,000	101.50	4,445,702,600	101.11	4,428,837,000	0.100	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	4,380,000,000	100.98	4,422,924,000	100.70	4,411,010,400	0.100	2022/9/20	0.82
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	4,190,000,000	102.48	4,294,243,000	101.86	4,268,101,600	0.100	2028/9/20	0.79
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	4,140,000,000	101.20	4,189,680,000	100.91	4,177,881,000	0.100	2023/6/20	0.78
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	4,080,000,000	101.13	4,126,104,000	100.84	4,114,312,800	0.100	2023/3/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,780,000,000	102.09	3,859,367,000	101.70	3,844,297,800	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第403回利付国債（2年）	3,690,000,000	100.80	3,719,520,000	100.37	3,703,874,400	0.100	2021/8/1	0.69
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	3,590,000,000	102.46	3,678,361,000	101.93	3,659,394,700	0.100	2028/6/20	0.68
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	3,540,000,000	102.29	3,621,295,200	101.84	3,605,313,000	0.100	2027/3/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	3,020,000,000	120.51	3,639,456,000	118.85	3,589,360,600	1.500	2034/6/20	0.67
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	3,400,000,000	102.92	3,499,313,600	102.26	3,476,874,000	0.600	2023/3/20	0.65
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	3,330,000,000	102.78	3,422,574,000	102.19	3,403,160,100	0.300	2024/12/20	0.63
日本	国債証券	第154回利付国債（20年）	2,950,000,000	116.93	3,449,463,500	115.18	3,398,016,500	1.200	2035/9/20	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.51
地方債証券	5.36
特殊債券	6.73
社債券	4.30
合計	99.89

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	244,239,605,107	64.09
	イギリス	18,319,755,155	4.81
	スイス	13,975,747,939	3.67
	カナダ	12,947,886,124	3.40
	フランス	12,224,634,961	3.21
	ドイツ	10,460,574,416	2.74
	アイルランド	7,083,936,043	1.86
	オーストラリア	6,974,337,162	1.83
	オランダ	6,512,785,690	1.71
	香港	3,264,882,608	0.86
	スウェーデン	3,194,021,436	0.84
	スペイン	3,069,505,487	0.81
	デンマーク	2,723,596,139	0.71
	イタリア	2,131,506,939	0.56
	フィンランド	1,465,600,711	0.38
	シンガポール	1,363,052,267	0.36
	バミューダ	1,199,419,677	0.31
	ベルギー	1,111,049,735	0.29
	ケイマン	824,618,408	0.22
	ジャージー	823,751,717	0.22
	イスラエル	775,529,688	0.20
	ノルウェー	681,527,570	0.18
	ニュージーランド	388,549,900	0.10
	ルクセンブルク	295,185,485	0.08
	キュラソー	257,250,197	0.07
	オーストリア	223,991,237	0.06
	ポルトガル	209,113,711	0.05
	パナマ	82,273,115	0.02
	リベリア	78,537,209	0.02
	マン島	61,146,981	0.02
パプアニューギニア	22,896,036	0.01	
英ヴァージン諸島	20,435,502	0.01	
	小計	357,006,704,352	93.68
投資信託受益証券	オーストラリア	171,085,031	0.04
	香港	88,759,335	0.02
	小計	259,844,366	0.07
投資証券	アメリカ	7,926,842,829	2.08
	オーストラリア	452,611,411	0.12
	フランス	247,517,983	0.06
	イギリス	216,990,763	0.06

	香港	190,997,016	0.05
	シンガポール	165,736,710	0.04
	カナダ	82,835,568	0.02
	小計	9,283,532,280	2.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,550,210,094	3.82
合計(純資産総額)		381,100,291,092	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	10,089,179,907	2.65
	買建	カナダ	591,376,380	0.16
	買建	ドイツ	2,326,141,955	0.61
	買建	イギリス	885,271,131	0.23
	買建	オーストラリア	458,569,440	0.12

(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		329,128,800	0.09
	売建		69,459,000	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。

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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	692,070	13,794.55	9,546,798,013	18,961.94	13,122,992,653	3.44

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	424,286	19,777.96	8,391,513,309	30,749.70	13,046,669,378	3.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	40,314	196,785.81	7,933,223,259	253,571.51	10,222,482,165	2.68
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	229,762	19,510.66	4,482,809,756	20,753.08	4,768,270,385	1.25
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	29,486	121,628.79	3,586,346,725	143,363.96	4,227,229,949	1.11
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,573	122,287.89	3,494,132,074	143,438.77	4,098,476,164	1.08
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	251,260	14,540.98	3,653,567,399	16,056.14	4,034,267,947	1.06
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	283,950	10,872.30	3,087,190,275	11,275.28	3,201,615,813	0.84
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	163,330	17,560.41	2,868,142,517	19,427.89	3,173,158,466	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	300,112	11,474.82	3,443,732,543	10,458.29	3,138,660,789	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	237,820	11,282.84	2,683,286,310	12,512.33	2,975,684,604	0.78
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	90,353	25,770.51	2,328,443,102	30,741.15	2,777,555,623	0.73
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	414,846	4,773.43	1,980,242,075	6,604.56	2,739,877,787	0.72
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	85,613	27,241.25	2,332,205,205	30,317.95	2,595,610,679	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	125,861	21,238.91	2,673,151,039	20,263.62	2,550,399,565	0.67
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	67,131	29,824.49	2,002,148,073	37,429.15	2,512,656,705	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	104,694	20,554.75	2,151,959,870	23,704.83	2,481,753,964	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	394,419	6,233.81	2,458,735,595	6,211.28	2,449,848,582	0.64
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	696,675	3,418.12	2,381,321,133	3,358.92	2,340,078,447	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	821,173	2,930.07	2,406,097,220	2,648.23	2,174,662,036	0.57
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	527,795	4,351.91	2,296,919,801	4,073.88	2,150,175,817	0.56
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	242,811	8,536.02	2,072,639,939	8,631.88	2,095,917,819	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	171,900	13,907.18	2,390,645,587	11,996.15	2,062,139,474	0.54
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	403,535	7,468.13	3,013,653,692	5,072.05	2,046,749,777	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	388,189	5,237.01	2,032,951,182	5,035.71	1,954,808,937	0.51
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	205,324	9,592.81	1,969,636,095	9,313.21	1,912,227,460	0.50
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	132,991	13,625.82	1,812,112,217	14,252.18	1,895,412,096	0.50

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	404,599	5,640.67	2,282,211,379	4,631.74	1,873,999,719	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	41,798	37,567.16	1,570,232,160	44,018.68	1,839,892,966	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	180,346	12,307.70	2,219,644,771	10,112.03	1,823,665,858	0.48

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.79
		素材	4.01
		資本財	5.91
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.03
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.52
		メディア・娯楽	6.19
		小売	5.43
		食品・生活必需品小売り	1.57
		食品・飲料・タバコ	4.68
		家庭用品・パーソナル用品	2.11
		ヘルスケア機器・サービス	5.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.10
		銀行	5.69
		各種金融	4.12
		保険	3.15
		不動産	0.50
		ソフトウェア・サービス	10.83
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.92		
電気通信サービス	2.19		
公益事業	3.51		
半導体・半導体製造装置	3.62		
	小計	93.68	
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.44
合計			96.18

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	642	アメリカドル	84,697,209	9,051,590,726	94,406,100	10,089,179,907	2.65
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	42	カナダドル	6,909,837	531,366,465	7,690,200	591,376,380	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	48	スイスフラン	4,456,196	487,908,900	4,716,480	516,407,395	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	526	ユーロ	14,292,437	1,657,922,692	15,601,160	1,809,734,560	0.47
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	49	オーストラリアドル	6,293,493	439,537,551	6,566,000	458,569,440	0.12
	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	109	イギリスポンド	6,060,563.75	805,933,767	6,657,175	885,271,131	0.23

(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	3,080,000.00	330,453,200	329,128,800	0.09
	アメリカドル	売建	650,000.00	69,459,000	69,459,000	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	133,240,646,976	49.32
	フランス	24,710,570,791	9.15
	イタリア	21,896,119,622	8.10
	イギリス	17,051,897,001	6.31

	ドイツ	15,931,668,072	5.90
	スペイン	13,695,642,206	5.07
	ベルギー	6,019,410,190	2.23
	カナダ	4,986,286,692	1.85
	オーストラリア	4,927,546,998	1.82
	オランダ	4,676,833,477	1.73
	オーストリア	3,578,067,331	1.32
	メキシコ	1,873,762,302	0.69
	アイルランド	1,781,673,639	0.66
	ポーランド	1,490,013,305	0.55
	フィンランド	1,428,574,690	0.53
	デンマーク	1,246,326,273	0.46
	マレーシア	1,228,870,893	0.45
	シンガポール	1,095,226,082	0.41
	スウェーデン	713,250,272	0.26
	ノルウェー	593,716,352	0.22
	小計	262,166,103,164	97.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,993,199,310	2.96
合計(純資産総額)		270,159,302,474	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	2,224,307,001	0.82
	買建	ドイツ	2,130,114,960	0.79

(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		4,453,896,000	1.65

(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 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,157.26	2,009,424,231	12,363.52	2,226,670,515	2.375	2029/5/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	10,477.19	1,534,908,592	11,681.39	1,711,323,929	1.625	2029/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,836.45	1,354,556,384	11,616.26	1,452,033,512	2.375	2024/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	10,790,000	9,851.27	1,062,952,745	13,104.09	1,413,932,269	2.250	2046/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	10,050,000	10,270.20	1,032,155,803	13,691.04	1,375,950,414	2.500	2046/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	10,200,000	10,708.39	1,092,256,499	13,344.55	1,361,144,750	2.250	2049/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	9,300,000	11,055.70	1,028,180,239	14,515.95	1,349,983,509	2.875	2045/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	12,150,000	10,534.62	1,279,957,153	11,063.13	1,344,170,571	1.625	2022/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.75% 09/15/21	12,000,000	10,890.37	1,306,844,834	11,064.80	1,327,776,255	2.750	2021/9/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	10,921.04	1,174,012,370	12,071.30	1,297,664,800	2.375	2027/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	11,252.34	1,124,108,996	12,556.39	1,254,383,374	2.625	2029/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	10,835.61	1,191,917,770	11,042.25	1,214,648,521	2.750	2021/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	10,550.90	1,078,302,775	11,726.47	1,198,446,029	2.000	2026/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/48	7,300,000	12,152.18	887,109,702	16,228.37	1,184,671,486	3.375	2048/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,767.98	1,092,950,727	11,603.74	1,177,780,037	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	8,500,000	10,277.68	873,603,471	13,667.67	1,161,752,042	2.500	2046/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.625% 05/15/21	10,580,000	10,788.23	1,141,395,190	10,961.48	1,159,724,639	2.625	2021/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	11,236.31	1,002,279,013	12,684.13	1,131,424,675	2.875	2028/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.125% 09/30/21	10,300,000	10,696.60	1,101,749,967	10,980.89	1,131,031,927	2.125	2021/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,886.84	1,088,684,690	11,157.06	1,115,706,107	2.000	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,738.29	1,073,829,760	11,000.51	1,100,051,319	1.500	2022/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/15/21	10,000,000	10,864.01	1,086,401,701	10,982.35	1,098,235,363	2.625	2021/6/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	9,400,000	10,685.93	1,004,477,542	11,618.77	1,092,164,644	2.125	2025/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	11,470.35	963,509,996	12,954.64	1,088,190,416	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,477.01	1,047,701,712	10,857.32	1,085,732,406	1.250	2021/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	6,700,000	12,517.68	838,684,767	16,039.68	1,074,658,840	3.625	2044/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	7,000,000	11,502.41	805,169,267	15,268.21	1,068,775,147	3.000	2049/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	10,729.58	960,297,506	11,938.54	1,068,500,041	2.250	2027/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,478.26	1,026,870,414	10,809.52	1,059,333,425	1.125	2021/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,589.31	1,011,279,505	11,027.64	1,053,140,396	1.750	2022/5/31	0.39

(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	97.04
合計	97.04

(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	62	アメリカ ドル	7,763,279.26	829,661,655	7,775,671.72	830,986,037	0.31
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	39	アメリカ ドル	5,403,687.32	577,492,064	5,419,781.25	579,212,022	0.21
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	42	アメリカ ドル	7,573,918	809,424,616	7,617,750	814,108,942	0.30
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	26	ユーロ	2,914,294	338,058,104	2,917,070	338,380,120	0.13
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	31	ユーロ	4,180,744	484,966,304	4,197,090	486,862,440	0.18
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	65	ユーロ	11,152,850	1,293,730,600	11,248,900	1,304,872,400	0.48

(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	21,600,000.00	2,331,499,043	2,307,744,000	0.85
	カナダドル	買建	2,400,000.00	185,511,989	184,512,000	0.07
	ユーロ	買建	14,160,000.00	1,668,331,247	1,642,560,000	0.61
	イギリスポンド	買建	2,400,000.00	322,955,866	319,080,000	0.12

(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：2020年4月30日

基準価額・純資産の推移

※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。

基準価額 21,156円

純資産総額 492.76億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

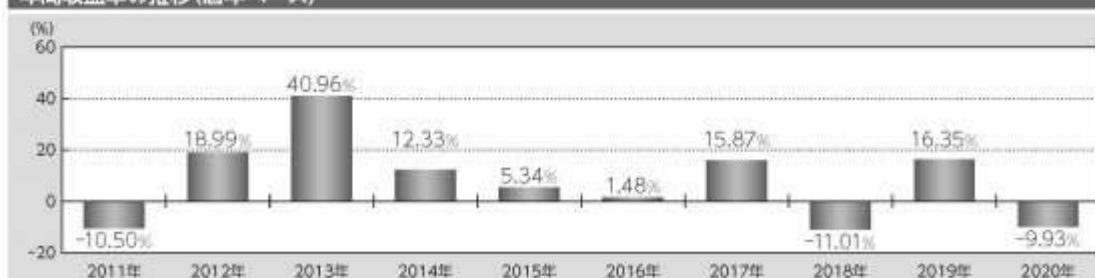
決算期	分配金
2015年9月	0円
2016年9月	0円
2017年10月	0円
2018年10月	0円
2019年9月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

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
国内株式 インデックス マザーファンド	50.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.8%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.9%
外国株式 インデックス マザーファンド	25.0%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.9%
		APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.9%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.7%
国内債券 インデックス マザーファンド	16.8%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.3%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.2%
		第344回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2026/09/20	0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.9%	T 2.375% 05/15/29	アメリカ	国債	-	2.375%	2029/05/15	0.0%
		T 1.625% 08/15/29	アメリカ	国債	-	1.625%	2029/08/15	0.0%
		T 2.375% 08/15/24	アメリカ	国債	-	2.375%	2024/08/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（周年ベース）

※2020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：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、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：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

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。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（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18期計算期間(2018年10月2日から2019年9月30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75】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2018年10月1日現在)	第18期 (2019年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,634,295,444	1,545,372,507
親投資信託受益証券	51,442,744,875	50,216,372,731
未収入金	84,530,000	93,760,000
流動資産合計	53,161,570,319	51,855,505,238
資産合計	53,161,570,319	51,855,505,238
負債の部		
流動負債		
未払解約金	79,834,137	59,846,062
未払受託者報酬	8,108,891	8,158,631
未払委託者報酬	78,385,899	78,866,646
未払利息	4,084	3,754
その他未払費用	1,719,389	1,723,113
流動負債合計	168,052,400	148,598,206
負債合計	168,052,400	148,598,206
純資産の部		
元本等		
元本	22,839,035,740	23,546,671,519
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	30,154,482,179	28,160,235,513
(分配準備積立金)	16,055,417,390	14,500,076,105
元本等合計	52,993,517,919	51,706,907,032
純資産合計	52,993,517,919	51,706,907,032
負債純資産合計	53,161,570,319	51,855,505,238

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自	2017年10月 3日 至 2018年10月 1日	自	2018年10月 2日 至 2019年 9月30日
営業収益				
受取利息		877		782
有価証券売買等損益		4,117,172,506		2,607,572,144
営業収益合計		4,117,173,383		2,607,571,362
営業費用				
支払利息		1,115,534		1,165,864
受託者報酬		15,871,746		16,134,184
委託者報酬		153,426,747		155,963,586
その他費用		1,762,182		1,784,753
営業費用合計		172,176,209		175,048,387
営業利益又は営業損失（ ）		3,944,997,174		2,782,619,749
経常利益又は経常損失（ ）		3,944,997,174		2,782,619,749
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,944,997,174		2,782,619,749
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（ ）		175,800,003		371,913,516
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,165,817,351		30,154,482,179
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,804,513,373		3,513,651,590
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,804,513,373		3,513,651,590
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,585,045,716		3,097,192,023
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,585,045,716		3,097,192,023
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		30,154,482,179		28,160,235,513

(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、前計算期間末日が休業日のため、第18期計算期間は2018年10月2日から2019年9月30日までとなっております。

(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 (2019年9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,839,035,740口	23,546,671,519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) 2.3203円 (23,203円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1959円 (21,959円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2017年10月3日 至 2018年10月1日			第18期 自 2018年10月2日 至 2019年9月30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	3,769,673,965円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	15,930,122,897円	収益調整金額	C	18,476,411,305円
分配準備積立金額	D	12,285,743,425円	分配準備積立金額	D	14,500,076,105円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,985,540,287円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	32,976,487,410円
当ファンドの期末残存口数	F	22,839,035,740口	当ファンドの期末残存口数	F	23,546,671,519口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,004円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,004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18期 自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30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18期 (2019年 9月30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17期	第18期
	自 2017年10月 3日 至 2018年10月 1日	自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	21,197,134,016円	22,839,035,740円
期中追加設定元本額	3,893,957,849円	3,074,624,736円
期中一部解約元本額	2,252,056,125円	2,366,988,957円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第17期 (2018年10月 1日現在)	第18期 (2019年 9月30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	3,980,593,633	2,402,877,354
合計	3,980,593,633	2,402,877,354

（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	17,693,052,946	26,141,485,727	
	外国株式インデックス マザーファンド	5,072,966,710	13,155,724,569	
	国内債券インデックス マザーファンド	5,992,680,556	8,604,890,010	
	外国債券インデックス マザーファンド	822,443,024	2,314,272,425	
合計		29,581,143,236	50,216,372,731	

(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

	2019年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,505,330,625
株式	301,610,113,430
派生商品評価勘定	81,247,840
未収入金	62,946,361
未収配当金	3,030,424,328
差入委託証拠金	138,291,600
流動資産合計	308,428,354,184
資産合計	308,428,354,184
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,614,940
前受金	42,643,700
未払金	35,123,420
未払解約金	1,057,439,234
未払利息	8,516
その他未払費用	1,032
流動負債合計	1,173,830,842

	2019年 9月30日現在
項目	金額（円）
負債合計	1,173,830,842
純資産の部	
元本等	
元本	207,951,200,444
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	99,303,322,898
元本等合計	307,254,523,342
純資産合計	307,254,523,342
負債純資産合計	308,428,354,184

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	207,951,200,444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 1.4775円 (1万口当たり純資産額) (14,775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

	2019年 9月30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

	2019年 9月30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。

2019年 9月30日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 9月30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	85,346,035,565円
期中一部解約元本額	18,362,582,637円
期末元本額	207,951,200,444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）	587,407,842円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,050,013,032円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,191,405円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,722,338,865円
世界経済インデックスファンド	2,092,501,272円
日本株式インデックス・オープン	5,322,441,683円
DCマイセレクション25	6,877,452,752円
DCマイセレクション50	19,478,609,146円
DCマイセレクション75	17,693,052,946円
DC日本株式インデックス・オープン	5,658,500,055円

区分	2019年 9月30日現在
DCマイセレクションS25	2,774,287,230円
DCマイセレクションS50	7,907,851,774円
DCマイセレクションS75	5,102,759,511円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,548,926,827円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	388,850,538円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	699,041,211円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	459,065,790円
DC世界経済インデックスファンド	1,855,684,297円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,157,492,851円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,912,032円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	38,352,733円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	38,766,263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)	290,125,410円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,717,839円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	80,814,436円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	333,969,311円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	65,589,781円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	494,645,634円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,795,713,875円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	734,246,719円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,243,571,741円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	678,729,136円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	48,442,577円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	803,985,939円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	37,531,892円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	459,891,212円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	589,379,412円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,933,957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)	908,039,081円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,889,234,812円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,515,055,936円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,151,588,282円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,496,119,375円
分散投資コア戦略ファンドA	5,593,816,351円
分散投資コア戦略ファンドS	11,596,231,740円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	260,123,930円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	280,936,134円
コア投資戦略ファンド(切替型)	779,159,346円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	221,196,271円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,259,567円
SMT インデックスバランス・オープン	74,944,468円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,989,522,633円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	680,819,456円

区分	2019年 9月30日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	15,430,720円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	60,732,208円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	8,859,573円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,570,672円
グローバル経済コア	315,919,546円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,081,062円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	43,611,169円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,653,698円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	196,531,526円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,326,359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）	52,993,358,774円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	617,653,901円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	3,552,530円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	9,775,597,978	
合計	9,775,597,978	

(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

（2019年 9月30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	5,642,396,300	-	5,685,040,000	42,643,700
合計		5,642,396,300	-	5,685,040,000	42,643,700

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,900	2,778.00	16,390,200	
日本水産	180,200	611.00	110,102,200	
マルハニチロ	26,000	2,724.00	70,824,000	
カネコ種苗	5,500	1,288.00	7,084,000	
サカタのタネ	21,500	3,690.00	79,335,000	
ホクト	15,100	1,984.00	29,958,400	
ホクリヨウ	2,400	666.00	1,598,400	
住石ホールディングス	38,800	132.00	5,121,600	
日鉄鉱業	4,100	4,250.00	17,425,000	
三井松島ホールディングス	7,500	1,201.00	9,007,500	
国際石油開発帝石	723,000	991.10	716,565,300	
石油資源開発	25,900	2,739.00	70,940,100	
K&Oエナジーグループ	8,700	1,439.00	12,519,300	
ヒノキヤグループ	4,500	1,920.00	8,640,000	
ショーボンドホールディングス	25,700	3,790.00	97,403,000	
ミライト・ホールディングス	50,700	1,629.00	82,590,300	
タマホーム	8,700	1,392.00	12,110,400	
サンヨーホームズ	2,600	659.00	1,713,400	
日本アクア	7,200	616.00	4,435,200	
ファーストコーポレーション	5,500	620.00	3,410,000	
ベステラ	3,400	1,229.00	4,178,600	
T A T E R U	36,600	176.00	6,441,600	
スペースバリューホールディングス	22,000	498.00	10,956,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,500	724.00	2,534,000	
第一カッター興業	2,200	1,715.00	3,773,000	
安藤・間	115,600	804.00	92,942,400	
東急建設	52,800	826.00	43,612,800	
コムシスホールディングス	63,900	3,060.00	195,534,000	
ミサワホーム	14,200	1,105.00	15,691,000	
ピーアールホールディングス	19,600	407.00	7,977,200	
高松コンストラクショングループ	11,200	2,479.00	27,764,800	
東建コーポレーション	5,600	6,630.00	37,128,000	
ソネック	1,900	862.00	1,637,800	

ヤマウラ	7,000	869.00	6,083,000	
大成建設	148,000	4,185.00	619,380,000	
大林組	445,900	1,076.00	479,788,400	
清水建設	454,800	978.00	444,794,400	
飛鳥建設	12,700	1,159.00	14,719,300	
長谷工コーポレーション	185,900	1,258.00	233,862,200	
松井建設	16,400	724.00	11,873,600	
銭高組	1,800	4,035.00	7,263,000	
鹿島建設	348,500	1,417.00	493,824,500	
不動テトラ	10,200	1,211.00	12,352,200	
大末建設	5,200	915.00	4,758,000	
鉄建建設	9,000	2,760.00	24,840,000	
西松建設	32,100	2,010.00	64,521,000	
三井住友建設	107,200	567.00	60,782,400	
大豊建設	10,100	2,852.00	28,805,200	
前田建設工業	106,000	942.00	99,852,000	
佐田建設	9,600	418.00	4,012,800	
ナカノフドー建設	11,400	476.00	5,426,400	
奥村組	24,500	2,885.00	70,682,500	
東鉄工業	17,800	3,195.00	56,871,000	
イチケン	2,700	1,654.00	4,465,800	
富士ピー・エス	6,100	511.00	3,117,100	
浅沼組	5,000	3,840.00	19,200,000	
戸田建設	172,800	621.00	107,308,800	
熊谷組	21,200	3,075.00	65,190,000	
北野建設	3,100	2,290.00	7,099,000	
植木組	1,800	2,473.00	4,451,400	
矢作建設工業	20,200	692.00	13,978,400	
ピーエス三菱	15,700	722.00	11,335,400	
日本ハウスホールディングス	28,400	521.00	14,796,400	
大東建託	53,000	13,810.00	731,930,000	
新日本建設	17,700	755.00	13,363,500	
N I P P O	39,400	1,999.00	78,760,600	
東亜道路工業	2,800	3,420.00	9,576,000	
前田道路	44,100	2,350.00	103,635,000	
日本道路	4,000	6,520.00	26,080,000	
東亜建設工業	13,000	1,304.00	16,952,000	
日本国土開発	24,300	530.00	12,879,000	
若築建設	7,500	1,500.00	11,250,000	
東洋建設	54,400	467.00	25,404,800	
五洋建設	176,800	598.00	105,726,400	
世紀東急工業	21,600	729.00	15,746,400	

福田組	4,800	4,165.00	19,992,000	
住友林業	105,400	1,436.00	151,354,400	
日本基礎技術	15,300	324.00	4,957,200	
巴コーポレーション	18,500	400.00	7,400,000	
大和ハウス工業	411,700	3,506.00	1,443,420,200	
ライト工業	28,600	1,418.00	40,554,800	
積水ハウス	455,300	2,125.00	967,512,500	
日特建設	12,700	634.00	8,051,800	
北陸電気工事	7,200	886.00	6,379,200	
ユアテック	23,800	656.00	15,612,800	
四電工	2,300	2,830.00	6,509,000	
中電工	19,200	2,338.00	44,889,600	
関電工	67,700	966.00	65,398,200	
きんでん	98,900	1,603.00	158,536,700	
東京エネシス	15,400	879.00	13,536,600	
トーエネック	4,200	3,455.00	14,511,000	
住友電設	10,300	2,201.00	22,670,300	
日本電設工業	25,400	2,234.00	56,743,600	
協和エクシオ	58,200	2,620.00	152,484,000	
新日本空調	12,000	1,789.00	21,468,000	
九電工	29,300	3,600.00	105,480,000	
三機工業	33,600	1,280.00	43,008,000	
日揮	128,100	1,413.00	181,005,300	
中外炉工業	4,200	1,493.00	6,270,600	
ヤマト	13,300	705.00	9,376,500	
太平電業	10,100	2,386.00	24,098,600	
高砂熱学工業	36,100	1,786.00	64,474,600	
三晃金属工業	1,800	2,416.00	4,348,800	
朝日工業社	3,100	3,050.00	9,455,000	
明星工業	26,900	733.00	19,717,700	
大気社	20,200	3,255.00	65,751,000	
ダイダン	9,900	2,167.00	21,453,300	
日比谷総合設備	13,400	1,872.00	25,084,800	
東芝プラントシステム	32,200	1,802.00	58,024,400	
OSJBホールディングス	65,600	246.00	16,137,600	
東洋エンジニアリング	17,500	619.00	10,832,500	
レイズネクスト	26,700	1,102.00	29,423,400	
日本製粉	42,200	1,689.00	71,275,800	
日清製粉グループ本社	150,500	1,998.00	300,699,000	
日東富士製粉	1,000	6,730.00	6,730,000	
昭和産業	12,200	3,065.00	37,393,000	
鳥越製粉	11,800	899.00	10,608,200	

中部飼料	16,300	1,168.00	19,038,400
フィード・ワン	89,500	162.00	14,499,000
東洋精糖	2,000	1,067.00	2,134,000
日本甜菜製糖	7,600	1,882.00	14,303,200
三井製糖	10,500	2,231.00	23,425,500
塩水港精糖	14,400	206.00	2,966,400
日新製糖	6,300	1,929.00	12,152,700
森永製菓	33,500	5,250.00	175,875,000
中村屋	3,400	4,495.00	15,283,000
江崎グリコ	40,000	4,485.00	179,400,000
名糖産業	6,400	1,240.00	7,936,000
井村屋グループ	5,700	2,060.00	11,742,000
不二家	7,400	2,030.00	15,022,000
山崎製パン	99,800	1,928.00	192,414,400
第一屋製パン	2,300	961.00	2,210,300
モロゾフ	2,300	4,940.00	11,362,000
亀田製菓	8,300	4,755.00	39,466,500
寿スピリッツ	14,100	7,090.00	99,969,000
カルビー	60,700	3,360.00	203,952,000
森永乳業	26,700	4,120.00	110,004,000
六甲バター	8,800	1,722.00	15,153,600
ヤクルト本社	98,700	6,040.00	596,148,000
明治ホールディングス	94,400	7,880.00	743,872,000
雪印メグミルク	32,100	2,601.00	83,492,100
プリマハム	18,700	2,149.00	40,186,300
日本ハム	55,100	4,345.00	239,409,500
林兼産業	4,400	606.00	2,666,400
丸大食品	14,200	2,287.00	32,475,400
S Foods	12,000	2,982.00	35,784,000
伊藤ハム米久ホールディングス	85,800	678.00	58,172,400
サッポロホールディングス	45,400	2,694.00	122,307,600
アサヒグループホールディングス	278,900	5,350.00	1,492,115,000
キリンホールディングス	564,900	2,288.00	1,292,491,200
宝ホールディングス	99,700	1,069.00	106,579,300
オエノンホールディングス	35,100	387.00	13,583,700
養命酒製造	4,100	1,909.00	7,826,900
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	93,500	2,424.00	226,644,000
サントリー食品インターナショナル	89,100	4,620.00	411,642,000
ダイドーグループホールディングス	7,500	4,405.00	33,037,500
伊藤園	40,400	5,090.00	205,636,000
キーコーヒー	13,100	2,190.00	28,689,000
ユニカフェ	3,400	1,000.00	3,400,000

ジャパンフーズ	1,900	1,205.00	2,289,500
日清オイリオグループ	17,100	3,390.00	57,969,000
不二製油グループ本社	32,500	3,130.00	101,725,000
かどや製油	1,500	3,585.00	5,377,500
J・オイルミルズ	6,900	4,100.00	28,290,000
キッコーマン	87,900	5,160.00	453,564,000
味の素	294,100	2,040.00	599,964,000
キューピー	74,200	2,523.00	187,206,600
ハウス食品グループ本社	49,800	4,040.00	201,192,000
カゴメ	50,500	2,729.00	137,814,500
焼津水産化学工業	6,500	1,050.00	6,825,000
アリアケジャパン	12,200	8,420.00	102,724,000
ピエトロ	1,700	1,612.00	2,740,400
エバラ食品工業	3,200	2,086.00	6,675,200
やまみ	600	2,018.00	1,210,800
ニチレイ	69,200	2,464.00	170,508,800
東洋水産	68,500	4,330.00	296,605,000
イトアンド	4,600	1,691.00	7,778,600
大冷	1,500	2,000.00	3,000,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,700	920.00	3,404,000
日清食品ホールディングス	56,600	7,800.00	441,480,000
永谷園ホールディングス	7,100	2,046.00	14,526,600
一正蒲鉾	5,200	1,052.00	5,470,400
フジッコ	14,400	1,949.00	28,065,600
ロック・フィールド	14,300	1,444.00	20,649,200
日本たばこ産業	769,100	2,366.00	1,819,690,600
ケンコーマヨネーズ	7,500	2,422.00	18,165,000
わらべや日洋ホールディングス	8,700	1,970.00	17,139,000
なとり	7,400	1,624.00	12,017,600
イフジ産業	2,300	755.00	1,736,500
ピクルスコーポレーション	3,200	2,714.00	8,684,800
北の達人コーポレーション	52,300	700.00	36,610,000
ユーグレナ	56,800	903.00	51,290,400
ミヨシ油脂	5,100	1,172.00	5,977,200
理研ビタミン	6,300	3,465.00	21,829,500
片倉工業	19,200	1,336.00	25,651,200
ゲンゼ	8,800	4,510.00	39,688,000
東洋紡	55,300	1,417.00	78,360,100
ユニチカ	39,400	318.00	12,529,200
富士紡ホールディングス	6,900	3,010.00	20,769,000
倉敷紡績	12,600	2,254.00	28,400,400
シキボウ	6,800	913.00	6,208,400

日本毛織	43,200	988.00	42,681,600
トーア紡コーポレーション	5,200	528.00	2,745,600
帝国繊維	14,800	1,796.00	26,580,800
帝人	106,200	2,076.00	220,471,200
東レ	1,008,800	802.10	809,158,480
サカイオーベックス	3,400	1,800.00	6,120,000
住江織物	3,800	3,030.00	11,514,000
日本フェルト	8,300	460.00	3,818,000
イチカワ	2,100	1,510.00	3,171,000
日東製網	1,500	1,575.00	2,362,500
アツギ	10,800	834.00	9,007,200
ダイニック	5,300	728.00	3,858,400
セーレン	32,300	1,242.00	40,116,600
ソトー	5,300	971.00	5,146,300
東海染工	1,900	1,125.00	2,137,500
小松マテーレ	21,500	779.00	16,748,500
ワコールホールディングス	36,800	2,777.00	102,193,600
ホギメディカル	16,200	3,090.00	50,058,000
レナウン	37,600	114.00	4,286,400
クラウディアホールディングス	3,400	492.00	1,672,800
T S Iホールディングス	48,100	599.00	28,811,900
マツオカコーポレーション	4,200	2,060.00	8,652,000
ワールド	17,100	2,476.00	42,339,600
三陽商会	6,800	1,453.00	9,880,400
ナイガイ	5,100	445.00	2,269,500
オンワードホールディングス	78,300	561.00	43,926,300
ルックホールディングス	4,600	1,055.00	4,853,000
ゴールドウイン	23,600	9,260.00	218,536,000
デサント	31,800	1,428.00	45,410,400
キング	7,100	599.00	4,252,900
ヤマトインターナショナル	8,200	399.00	3,271,800
特種東海製紙	8,300	3,775.00	31,332,500
王子ホールディングス	585,100	504.00	294,890,400
日本製紙	62,300	1,759.00	109,585,700
三菱製紙	21,200	483.00	10,239,600
北越コーポレーション	86,200	540.00	46,548,000
中越パルプ工業	5,500	1,494.00	8,217,000
巴川製紙所	4,300	982.00	4,222,600
大王製紙	63,300	1,372.00	86,847,600
阿波製紙	3,400	413.00	1,404,200
レンゴー	134,000	778.00	104,252,000
トーモク	8,000	1,541.00	12,328,000

ザ・パックス	9,800	3,650.00	35,770,000
クラレ	204,700	1,327.00	271,636,900
旭化成	924,600	1,064.00	983,774,400
共和レザー	8,100	739.00	5,985,900
昭和電工	92,500	2,825.00	261,312,500
住友化学	1,023,100	485.00	496,203,500
住友精化	6,300	3,190.00	20,097,000
日産化学	79,300	4,495.00	356,453,500
ラサ工業	4,600	1,257.00	5,782,200
クレハ	12,000	6,430.00	77,160,000
多木化学	3,800	4,640.00	17,632,000
テイカ	10,600	1,955.00	20,723,000
石原産業	25,000	974.00	24,350,000
片倉コープアグリ	3,800	1,071.00	4,069,800
日本曹達	20,500	2,610.00	53,505,000
東ソー	200,900	1,428.00	286,885,200
トクヤマ	37,500	2,477.00	92,887,500
セントラル硝子	28,300	2,265.00	64,099,500
東亜合成	81,600	1,216.00	99,225,600
大阪ソーダ	14,300	2,769.00	39,596,700
関東電化工業	30,800	811.00	24,978,800
デンカ	51,100	2,971.00	151,818,100
信越化学工業	229,000	11,560.00	2,647,240,000
日本カーバイド工業	4,400	1,214.00	5,341,600
堺化学工業	8,600	2,523.00	21,697,800
第一稀元素化学工業	14,100	794.00	11,195,400
エア・ウォーター	106,400	1,932.00	205,564,800
大陽日酸	107,100	2,183.00	233,799,300
日本化学工業	4,400	2,342.00	10,304,800
東邦アセチレン	1,900	1,360.00	2,584,000
日本パーカライズニング	71,000	1,171.00	83,141,000
高压ガス工業	20,600	804.00	16,562,400
チタン工業	1,600	2,486.00	3,977,600
四国化成工業	21,900	1,131.00	24,768,900
戸田工業	2,800	2,214.00	6,199,200
ステラ ケミファ	7,600	2,630.00	19,988,000
保土谷化学工業	4,500	3,335.00	15,007,500
日本触媒	21,900	6,140.00	134,466,000
大日精化工業	10,700	3,170.00	33,919,000
カネカ	33,600	3,365.00	113,064,000
三菱瓦斯化学	132,100	1,442.00	190,488,200
三井化学	118,000	2,416.00	285,088,000

J S R	130,400	1,729.00	225,461,600
東京応化工業	22,300	4,010.00	89,423,000
大阪有機化学工業	12,000	1,071.00	12,852,000
三菱ケミカルホールディングス	868,800	770.10	669,062,880
K Hネオケム	22,900	2,353.00	53,883,700
ダイセル	191,500	913.00	174,839,500
住友ベークライト	22,500	4,220.00	94,950,000
積水化学工業	279,500	1,673.00	467,603,500
日本ゼオン	117,200	1,317.00	154,352,400
アイカ工業	39,000	3,180.00	124,020,000
宇部興産	65,600	2,179.00	142,942,400
積水樹脂	21,400	2,125.00	45,475,000
タキロンシーアイ	28,100	626.00	17,590,600
旭有機材	9,000	1,293.00	11,637,000
日立化成	60,100	3,525.00	211,852,500
ニチバン	6,800	1,593.00	10,832,400
リケンテクノス	35,400	457.00	16,177,800
大倉工業	6,100	1,629.00	9,936,900
積水化成成品工業	19,400	749.00	14,530,600
群栄化学工業	3,300	2,400.00	7,920,000
タイガースポリマー	6,800	599.00	4,073,200
ミライアル	3,800	1,356.00	5,152,800
ダイキアクシス	4,600	807.00	3,712,200
ダイキョーニシカワ	27,400	793.00	21,728,200
竹本容器	4,600	962.00	4,425,200
森六ホールディングス	7,000	2,442.00	17,094,000
日本化薬	80,400	1,290.00	103,716,000
カーリットホールディングス	13,900	569.00	7,909,100
日本精化	10,500	1,202.00	12,621,000
扶桑化学工業	13,200	2,399.00	31,666,800
トリケミカル研究所	2,900	6,630.00	19,227,000
A D E K A	64,100	1,340.00	85,894,000
日油	48,900	3,555.00	173,839,500
新日本理化	23,000	192.00	4,416,000
ハリマ化成グループ	10,700	1,217.00	13,021,900
花王	317,700	7,984.00	2,536,516,800
第一工業製薬	4,800	2,854.00	13,699,200
石原ケミカル	3,300	1,651.00	5,448,300
日華化学	4,400	834.00	3,669,600
ニイタカ	2,000	1,584.00	3,168,000
三洋化成工業	8,700	4,650.00	40,455,000
有機合成薬品工業	10,000	236.00	2,360,000

大日本塗料	14,700	1,058.00	15,552,600
日本ペイントホールディングス	107,300	5,610.00	601,953,000
関西ペイント	146,000	2,511.00	366,606,000
神東塗料	10,200	166.00	1,693,200
中国塗料	42,700	883.00	37,704,100
日本特殊塗料	9,700	1,123.00	10,893,100
藤倉化成	17,500	520.00	9,100,000
太陽ホールディングス	10,700	3,635.00	38,894,500
D I C	54,900	2,998.00	164,590,200
サカタインクス	28,400	1,119.00	31,779,600
東洋インキＳＣホールディングス	27,500	2,450.00	67,375,000
T & K T O K A	10,100	932.00	9,413,200
富士フィルムホールディングス	275,600	4,740.00	1,306,344,000
資生堂	263,700	8,629.00	2,275,467,300
ライオン	172,500	2,131.00	367,597,500
高砂香料工業	9,100	2,615.00	23,796,500
マンダム	29,800	2,677.00	79,774,600
ミルボン	17,700	5,320.00	94,164,000
ファンケル	59,100	2,873.00	169,794,300
コーセー	22,500	18,250.00	410,625,000
コタ	7,000	1,256.00	8,792,000
シーボン	1,600	2,392.00	3,827,200
ポーラ・オルビスホールディングス	56,600	2,419.00	136,915,400
ノエビアホールディングス	12,700	5,640.00	71,628,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	944.00	2,832,000
エステー	9,500	1,582.00	15,029,000
アグロ カネショウ	4,100	1,580.00	6,478,000
コニシ	23,500	1,473.00	34,615,500
長谷川香料	17,600	1,995.00	35,112,000
星光P M C	7,600	782.00	5,943,200
小林製薬	37,200	8,220.00	305,784,000
荒川化学工業	11,900	1,467.00	17,457,300
メック	9,100	1,553.00	14,132,300
日本高純度化学	3,600	2,506.00	9,021,600
タカラバイオ	34,700	2,201.00	76,374,700
J C U	17,200	2,176.00	37,427,200
新田ゼラチン	8,300	667.00	5,536,100
O A T アグリオ	2,300	1,503.00	3,456,900
デクセリアルズ	34,200	800.00	27,360,000
アース製薬	10,000	5,540.00	55,400,000
北興化学工業	13,600	491.00	6,677,600
大成ラミック	4,400	2,845.00	12,518,000

クミアイ化学工業	54,900	931.00	51,111,900
日本農薬	23,600	490.00	11,564,000
アキレス	9,700	1,688.00	16,373,600
有沢製作所	20,900	1,016.00	21,234,400
日東電工	91,600	5,204.00	476,686,400
レック	14,200	978.00	13,887,600
三光合成	15,200	353.00	5,365,600
きもと	22,600	173.00	3,909,800
藤森工業	11,900	3,195.00	38,020,500
前澤化成工業	9,100	1,125.00	10,237,500
未来工業	7,100	2,002.00	14,214,200
ウェーブロックホールディングス	3,700	782.00	2,893,400
J S P	7,800	1,779.00	13,876,200
エフピコ	14,600	6,740.00	98,404,000
天馬	8,800	1,967.00	17,309,600
信越ポリマー	23,800	750.00	17,850,000
東リ	33,000	251.00	8,283,000
ニフコ	53,200	2,581.00	137,309,200
バルカー	10,800	2,173.00	23,468,400
ユニ・チャーム	255,800	3,420.00	874,836,000
ショーエイコーポレーション	1,100	738.00	811,800
協和キリン	133,500	2,098.00	280,083,000
武田薬品工業	1,158,500	3,690.00	4,274,865,000
アステラス製薬	1,167,300	1,538.50	1,795,891,050
大日本住友製薬	98,400	1,775.00	174,660,000
塩野義製薬	169,700	5,999.00	1,018,030,300
田辺三菱製薬	138,800	1,185.00	164,478,000
わかもと製薬	15,800	249.00	3,934,200
あすか製薬	16,400	1,084.00	17,777,600
日本新薬	34,700	9,090.00	315,423,000
ビオフェルミン製薬	2,300	2,172.00	4,995,600
中外製薬	138,400	8,400.00	1,162,560,000
科研製薬	22,700	5,010.00	113,727,000
エーザイ	158,800	5,491.00	871,970,800
ロート製薬	68,100	2,948.00	200,758,800
小野薬品工業	313,400	1,957.00	613,323,800
久光製薬	39,200	4,725.00	185,220,000
持田製薬	20,100	4,130.00	83,013,000
参天製薬	247,100	1,878.00	464,053,800
扶桑薬品工業	4,700	1,959.00	9,207,300
日本ケミファ	1,800	2,887.00	5,196,600
ツムラ	41,100	2,890.00	118,779,000

日医工	34,900	1,202.00	41,949,800
キッセイ薬品工業	23,500	2,601.00	61,123,500
生化学工業	25,700	1,131.00	29,066,700
栄研化学	23,300	1,633.00	38,048,900
日水製薬	5,600	1,167.00	6,535,200
鳥居薬品	8,300	2,885.00	23,945,500
JCRファーマ	9,400	8,280.00	77,832,000
東和薬品	19,100	2,504.00	47,826,400
富士製薬工業	9,000	1,317.00	11,853,000
沢井製薬	27,200	5,580.00	151,776,000
ゼリア新薬工業	26,300	1,898.00	49,917,400
第一三共	379,700	6,804.00	2,583,478,800
キョーリン製薬ホールディングス	29,300	1,789.00	52,417,700
大幸薬品	5,900	2,466.00	14,549,400
ダイト	7,700	3,020.00	23,254,000
大塚ホールディングス	252,800	4,040.00	1,021,312,000
大正製薬ホールディングス	28,100	7,850.00	220,585,000
ペプチドリーム	67,100	5,130.00	344,223,000
日本コークス工業	112,100	82.00	9,192,200
ニチレキ	17,000	1,104.00	18,768,000
ユシロ化学工業	6,900	1,337.00	9,225,300
ビーピー・カストロール	4,700	1,428.00	6,711,600
富士石油	32,200	248.00	7,985,600
MORESCO	4,800	1,330.00	6,384,000
出光興産	153,200	3,055.00	468,026,000
JXTGホールディングス	2,195,300	492.40	1,080,965,720
コスモエネルギーホールディングス	38,400	2,225.00	85,440,000
横浜ゴム	76,800	2,161.00	165,964,800
TOYO TIRE	76,200	1,366.00	104,089,200
ブリヂストン	407,900	4,184.00	1,706,653,600
住友ゴム工業	119,200	1,282.00	152,814,400
藤倉コンポジット	11,600	431.00	4,999,600
オカモト	8,900	3,970.00	35,333,000
フコク	5,800	698.00	4,048,400
ニッタ	15,000	2,877.00	43,155,000
住友理工	25,700	863.00	22,179,100
三ツ星ベルト	17,500	1,772.00	31,010,000
バンドー化学	25,300	824.00	20,847,200
日東紡績	19,800	3,325.00	65,835,000
AGC	131,200	3,350.00	439,520,000
日本板硝子	63,500	646.00	41,021,000
石塚硝子	2,200	2,010.00	4,422,000

日本山村硝子	5,500	1,269.00	6,979,500
日本電気硝子	53,300	2,404.00	128,133,200
オハラ	5,300	1,492.00	7,907,600
住友大阪セメント	26,800	4,625.00	123,950,000
太平洋セメント	83,800	2,891.00	242,265,800
日本ヒューム	13,400	769.00	10,304,600
日本コンクリート工業	28,700	268.00	7,691,600
三谷セキサン	6,200	3,245.00	20,119,000
アジアパイルホールディングス	18,900	515.00	9,733,500
東海カーボン	139,100	1,087.00	151,201,700
日本カーボン	6,800	3,815.00	25,942,000
東洋炭素	7,800	2,323.00	18,119,400
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	3,975.00	31,800,000
TOTO	102,100	4,045.00	412,994,500
日本碍子	162,000	1,539.00	249,318,000
日本特殊陶業	111,900	2,058.00	230,290,200
MARUWA	4,600	6,930.00	31,878,000
品川リフラクトリーズ	3,500	2,637.00	9,229,500
黒崎播磨	2,600	5,650.00	14,690,000
ヨータイ	11,700	580.00	6,786,000
イソライト工業	6,900	437.00	3,015,300
東京窯業	17,000	291.00	4,947,000
ニッカトー	6,100	659.00	4,019,900
フジインコーポレーテッド	11,800	2,536.00	29,924,800
クニミネ工業	6,000	938.00	5,628,000
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,026.00	2,667,600
ニチアス	36,300	1,912.00	69,405,600
ニチハ	18,500	2,950.00	54,575,000
日本製鉄	609,800	1,505.50	918,053,900
神戸製鋼所	240,300	576.00	138,412,800
中山製鋼所	18,300	438.00	8,015,400
合同製鐵	6,400	2,118.00	13,555,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	354,400	1,300.00	460,720,000
東京製鐵	70,300	828.00	58,208,400
共英製鋼	14,800	2,023.00	29,940,400
大和工業	27,900	2,680.00	74,772,000
東京鐵鋼	5,400	1,342.00	7,246,800
大阪製鐵	8,700	1,325.00	11,527,500
淀川製鋼所	17,700	2,014.00	35,647,800
丸一鋼管	46,500	2,853.00	132,664,500
モリ工業	4,000	2,012.00	8,048,000
大同特殊鋼	21,500	4,235.00	91,052,500

日本高周波鋼業	5,000	414.00	2,070,000
日本冶金工業	10,880	2,165.00	23,555,200
山陽特殊製鋼	16,600	1,439.00	23,887,400
愛知製鋼	7,400	3,070.00	22,718,000
日立金属	141,400	1,166.00	164,872,400
日本金属	3,000	810.00	2,430,000
大太平洋金属	8,900	2,241.00	19,944,900
新日本電工	84,800	167.00	14,161,600
栗本鐵工所	6,700	1,505.00	10,083,500
虹技	2,000	1,292.00	2,584,000
三菱製鋼	9,800	1,108.00	10,858,400
日亜鋼業	19,400	300.00	5,820,000
日本精線	1,900	2,392.00	4,544,800
エンビプロ・ホールディングス	5,000	670.00	3,350,000
シンニッタン	20,500	439.00	8,999,500
新家工業	3,000	1,467.00	4,401,000
大紀アルミニウム工業所	21,800	707.00	15,412,600
日本軽金属ホールディングス	358,300	194.00	69,510,200
三井金属鉱業	35,500	2,553.00	90,631,500
東邦亜鉛	7,300	1,999.00	14,592,700
三菱マテリアル	86,700	2,915.00	252,730,500
住友金属鉱山	179,800	3,347.00	601,790,600
DOWAホールディングス	30,700	3,690.00	113,283,000
古河機械金属	21,800	1,453.00	31,675,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,200	1,759.00	26,736,800
東邦チタニウム	23,700	826.00	19,576,200
UACJ	20,000	1,814.00	36,280,000
CKサンエツ	2,500	2,837.00	7,092,500
古河電気工業	37,900	2,599.00	98,502,100
住友電気工業	490,800	1,371.00	672,886,800
フジクラ	158,800	414.00	65,743,200
昭和電線ホールディングス	15,200	868.00	13,193,600
東京特殊電線	1,800	1,956.00	3,520,800
タツタ電線	26,300	462.00	12,150,600
カナレ電気	2,200	1,918.00	4,219,600
平河ヒューテック	5,600	1,066.00	5,969,600
リョービ	16,200	1,807.00	29,273,400
アーレスティ	16,400	555.00	9,102,000
アサヒホールディングス	24,700	2,226.00	54,982,200
稲葉製作所	7,400	1,433.00	10,604,200
宮地エンジニアリンググループ	4,000	1,624.00	6,496,000
トーカロ	33,900	894.00	30,306,600

アルファCo	4,600	1,206.00	5,547,600
SUMCO	157,100	1,450.00	227,795,000
川田テクノロジーズ	2,900	6,960.00	20,184,000
RS Technologies	3,700	3,510.00	12,987,000
信和	6,900	1,018.00	7,024,200
東洋製罐グループホールディングス	83,600	1,676.00	140,113,600
ホッカンホールディングス	6,700	1,521.00	10,190,700
コロナ	7,300	1,059.00	7,730,700
横河ブリッジホールディングス	24,400	1,621.00	39,552,400
駒井ハルテック	2,500	1,644.00	4,110,000
高田機工	1,200	2,508.00	3,009,600
三和ホールディングス	135,600	1,208.00	163,804,800
文化シャッター	38,700	924.00	35,758,800
三協立山	18,200	1,250.00	22,750,000
アルインコ	10,400	927.00	9,640,800
東洋シャッター	3,200	702.00	2,246,400
LIXILグループ	193,600	1,900.00	367,840,000
日本フィルコン	10,100	502.00	5,070,200
ノーリツ	27,200	1,253.00	34,081,600
長府製作所	13,400	2,391.00	32,039,400
リンナイ	23,400	7,260.00	169,884,000
ダイニチ工業	7,100	631.00	4,480,100
日東精工	18,200	568.00	10,337,600
三洋工業	1,800	1,853.00	3,335,400
岡部	26,600	857.00	22,796,200
ジーテクト	14,500	1,677.00	24,316,500
東プレ	24,500	1,704.00	41,748,000
高周波熱錬	25,300	849.00	21,479,700
東京製綱	8,000	1,010.00	8,080,000
サンコール	7,400	460.00	3,404,000
モリテック スチール	10,300	344.00	3,543,200
パイオラックス	21,000	1,850.00	38,850,000
エイチワン	12,900	634.00	8,178,600
日本発條	130,800	824.00	107,779,200
中央発條	1,600	2,787.00	4,459,200
アドバネクス	1,700	1,641.00	2,789,700
立川ブラインド工業	5,800	1,374.00	7,969,200
三益半導体工業	11,700	1,734.00	20,287,800
日本ドライケミカル	3,700	1,130.00	4,181,000
日本製鋼所	39,900	2,076.00	82,832,400
三浦工業	56,800	3,010.00	170,968,000
タクマ	48,000	1,225.00	58,800,000

ツガミ	29,600	915.00	27,084,000
オークマ	16,700	5,850.00	97,695,000
東芝機械	14,900	2,236.00	33,316,400
アマダホールディングス	197,300	1,164.00	229,657,200
アイダエンジニアリング	35,600	873.00	31,078,800
滝澤鉄工所	4,200	1,286.00	5,401,200
F U J I	52,500	1,605.00	84,262,500
牧野フライス製作所	15,400	4,700.00	72,380,000
オーエスジー	60,700	2,234.00	135,603,800
ダイジェット工業	1,600	1,638.00	2,620,800
旭ダイヤモンド工業	34,600	616.00	21,313,600
D M G 森精機	83,100	1,531.00	127,226,100
ソディック	31,000	772.00	23,932,000
ディスコ	17,800	20,460.00	364,188,000
日東工器	7,200	2,113.00	15,213,600
日進工具	3,900	1,950.00	7,605,000
パンチ工業	9,400	492.00	4,624,800
富士ダイス	6,000	618.00	3,708,000
豊和工業	7,400	753.00	5,572,200
O K K	5,500	711.00	3,910,500
東洋機械金属	9,600	570.00	5,472,000
津田駒工業	2,600	1,319.00	3,429,400
エンシュウ	3,500	1,092.00	3,822,000
島精機製作所	18,100	2,477.00	44,833,700
オプトラン	14,700	3,060.00	44,982,000
N C ホールディングス	4,500	479.00	2,155,500
イワキポンプ	5,700	972.00	5,540,400
フリー	10,600	919.00	9,741,400
ヤマシンフィルタ	23,000	834.00	19,182,000
日阪製作所	16,300	864.00	14,083,200
やまびこ	25,500	1,137.00	28,993,500
平田機工	6,200	7,040.00	43,648,000
ペガサスミシン製造	12,500	493.00	6,162,500
マルマエ	5,500	986.00	5,423,000
タツモ	6,200	1,087.00	6,739,400
ナプテスコ	77,400	3,345.00	258,903,000
三井海洋開発	14,000	2,629.00	36,806,000
レオン自動機	12,900	1,559.00	20,111,100
S M C	38,900	46,100.00	1,793,290,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	10,200	408.00	4,161,600
ホソカワミクロン	4,600	3,745.00	17,227,000
ユニオンツール	4,900	3,145.00	15,410,500

オイレス工業	18,400	1,574.00	28,961,600
日精エー・エス・ピー機械	4,500	3,390.00	15,255,000
サトーホールディングス	15,900	2,918.00	46,396,200
技研製作所	11,500	3,420.00	39,330,000
日本エアーテック	4,300	600.00	2,580,000
カワタ	3,700	938.00	3,470,600
日精樹脂工業	11,100	1,001.00	11,111,100
オカダアイヨン	4,600	1,201.00	5,524,600
ワイエイシイホールディングス	5,200	675.00	3,510,000
小松製作所	600,900	2,475.00	1,487,227,500
住友重機械工業	76,000	3,200.00	243,200,000
日立建機	53,200	2,605.00	138,586,000
日工	18,500	666.00	12,321,000
巴工業	5,700	2,362.00	13,463,400
井関農機	13,300	1,467.00	19,511,100
TOWA	11,500	854.00	9,821,000
丸山製作所	3,000	1,202.00	3,606,000
北川鉄工所	6,000	1,895.00	11,370,000
ローツェ	5,900	2,570.00	15,163,000
タカキタ	4,800	546.00	2,620,800
クボタ	711,000	1,634.50	1,162,129,500
荏原実業	3,400	2,000.00	6,800,000
三菱化工機	4,600	1,858.00	8,546,800
月島機械	26,400	1,386.00	36,590,400
帝国電機製作所	9,300	1,177.00	10,946,100
新東工業	31,600	971.00	30,683,600
澁谷工業	11,600	2,888.00	33,500,800
アイチ コーポレーション	23,100	690.00	15,939,000
小森コーポレーション	33,700	1,139.00	38,384,300
鶴見製作所	10,400	2,010.00	20,904,000
住友精密工業	2,200	3,075.00	6,765,000
日本ギア工業	4,200	426.00	1,789,200
酒井重工業	2,500	2,830.00	7,075,000
荏原製作所	58,900	2,877.00	169,455,300
石井鐵工所	2,100	2,217.00	4,655,700
西島製作所	13,700	976.00	13,371,200
北越工業	13,800	1,243.00	17,153,400
ダイキン工業	181,200	14,180.00	2,569,416,000
オルガノ	4,800	4,790.00	22,992,000
トーヨーカネツ	5,100	1,927.00	9,827,700
栗田工業	71,900	2,893.00	208,006,700
椿本チエイン	17,400	3,455.00	60,117,000

大同工業	6,400	801.00	5,126,400
木村化工機	11,300	379.00	4,282,700
アネスト岩田	20,800	948.00	19,718,400
ダイフク	73,100	5,570.00	407,167,000
サムコ	3,800	878.00	3,336,400
加藤製作所	6,800	1,891.00	12,858,800
油研工業	2,300	1,618.00	3,721,400
タダノ	64,100	1,029.00	65,958,900
フジテック	48,300	1,392.00	67,233,600
C K D	37,000	1,284.00	47,508,000
キトー	10,100	1,549.00	15,644,900
平和	37,100	2,225.00	82,547,500
理想科学工業	11,800	1,647.00	19,434,600
S A N K Y O	33,300	3,715.00	123,709,500
日本金銭機械	14,800	916.00	13,556,800
マースグループホールディングス	8,500	1,905.00	16,192,500
福島工業	8,200	3,135.00	25,707,000
オーイズミ	5,800	478.00	2,772,400
ダイコク電機	6,200	1,552.00	9,622,400
竹内製作所	22,300	1,677.00	37,397,100
アマノ	37,900	3,290.00	124,691,000
J U K I	18,500	903.00	16,705,500
蛇の目ミシン工業	12,400	402.00	4,984,800
マックス	20,300	1,811.00	36,763,300
グローリー	36,800	3,030.00	111,504,000
新晃工業	12,400	1,743.00	21,613,200
大和冷機工業	19,300	1,106.00	21,345,800
セガサミーホールディングス	131,700	1,512.00	199,130,400
日本ピストンリング	4,900	1,264.00	6,193,600
リケン	6,200	3,740.00	23,188,000
T P R	17,900	1,721.00	30,805,900
ツバキ・ナカシマ	27,100	1,617.00	43,820,700
ホシザキ	38,800	8,490.00	329,412,000
大豊工業	10,800	770.00	8,316,000
日本精工	272,700	910.00	248,157,000
N T N	285,600	310.00	88,536,000
ジェイテクト	127,400	1,239.00	157,848,600
不二越	12,300	4,840.00	59,532,000
日本トムソン	39,600	450.00	17,820,000
T H K	77,300	2,833.00	218,990,900
ユーシン精機	10,400	942.00	9,796,800
前澤給装工業	5,200	1,997.00	10,384,400

イーグル工業	16,500	986.00	16,269,000
前澤工業	9,200	351.00	3,229,200
日本ピラー工業	13,500	1,206.00	16,281,000
キット	53,900	719.00	38,754,100
マキタ	161,600	3,400.00	549,440,000
日立造船	105,500	351.00	37,030,500
三菱重工業	222,400	4,232.00	941,196,800
I H I	102,000	2,348.00	239,496,000
スター精密	20,800	1,531.00	31,844,800
日清紡ホールディングス	88,600	842.00	74,601,200
イビデン	81,500	2,175.00	177,262,500
コニカミノルタ	290,600	752.00	218,531,200
ブラザー工業	173,100	1,956.00	338,583,600
ミネベアミツミ	246,600	1,711.00	421,932,600
日立製作所	597,400	4,023.00	2,403,340,200
三菱電機	1,327,100	1,432.50	1,901,070,750
富士電機	86,200	3,305.00	284,891,000
東洋電機製造	5,300	1,477.00	7,828,100
安川電機	153,900	3,965.00	610,213,500
シンフォニアテクノロジー	18,500	1,197.00	22,144,500
明電舎	26,300	1,853.00	48,733,900
オリジン	3,700	1,366.00	5,054,200
山洋電気	6,500	4,720.00	30,680,000
デンヨー	12,300	1,759.00	21,635,700
東芝テック	16,700	3,190.00	53,273,000
芝浦メカトロニクス	2,500	2,881.00	7,202,500
マブチモーター	36,800	4,025.00	148,120,000
日本電産	159,700	14,520.00	2,318,844,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,900	695.00	5,490,500
トレックス・セミコンダクター	6,300	1,228.00	7,736,400
東光高岳	7,200	1,131.00	8,143,200
ダイヘン	14,600	3,265.00	47,669,000
ヤーマン	19,900	705.00	14,029,500
JVCケンウッド	103,000	319.00	32,857,000
ミマキエンジニアリング	12,900	530.00	6,837,000
第一精工	5,000	2,626.00	13,130,000
日新電機	31,200	1,311.00	40,903,200
大崎電気工業	26,600	659.00	17,529,400
オムロン	141,100	5,910.00	833,901,000
日東工業	21,300	2,046.00	43,579,800
I D E C	17,900	1,961.00	35,101,900
正興電機製作所	3,800	786.00	2,986,800

不二電機工業	1,900	1,226.00	2,329,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,000	1,867.00	89,616,000
サクサホールディングス	3,400	1,846.00	6,276,400
メルコホールディングス	5,700	2,696.00	15,367,200
テクノメディカ	3,200	2,326.00	7,443,200
日本電気	171,700	4,560.00	782,952,000
富士通	127,900	8,655.00	1,106,974,500
沖電気工業	57,600	1,471.00	84,729,600
岩崎通信機	6,200	818.00	5,071,600
電気興業	7,000	3,050.00	21,350,000
サンケン電気	15,600	2,129.00	33,212,400
ナカヨ	2,700	1,621.00	4,376,700
アイホン	7,600	1,593.00	12,106,800
ルネサスエレクトロニクス	632,200	702.00	443,804,400
セイコーエプソン	164,700	1,520.00	250,344,000
ワコム	97,500	351.00	34,222,500
アルバック	26,500	4,340.00	115,010,000
アクセル	6,400	604.00	3,865,600
E I Z O	12,200	3,770.00	45,994,000
日本信号	33,900	1,206.00	40,883,400
京三製作所	28,800	368.00	10,598,400
能美防災	17,800	2,063.00	36,721,400
ホーチキ	8,700	1,477.00	12,849,900
星和電機	8,100	514.00	4,163,400
エレコム	12,700	4,240.00	53,848,000
パナソニック	1,516,100	875.60	1,327,497,160
シャープ	131,700	1,195.00	157,381,500
アンリツ	85,500	2,119.00	181,174,500
富士通ゼネラル	40,600	1,799.00	73,039,400
ソニー	890,600	6,347.00	5,652,638,200
T D K	69,500	9,670.00	672,065,000
帝国通信工業	6,300	1,135.00	7,150,500
タムラ製作所	51,400	577.00	29,657,800
アルプスアルパイン	138,400	2,017.00	279,152,800
池上通信機	4,200	1,066.00	4,477,200
鈴木	7,900	641.00	5,063,900
日本トリム	2,600	4,590.00	11,934,000
ローランド ディー . ジー .	7,600	1,997.00	15,177,200
フォスター電機	15,100	1,830.00	27,633,000
S M K	3,800	2,689.00	10,218,200
ヨコオ	9,600	2,952.00	28,339,200
ホシデン	39,500	1,106.00	43,687,000

ヒロセ電機	19,000	13,240.00	251,560,000
日本航空電子工業	30,500	1,531.00	46,695,500
TOA	14,300	1,222.00	17,474,600
マクセルホールディングス	28,900	1,543.00	44,592,700
古野電気	17,600	941.00	16,561,600
ユニデンホールディングス	4,000	1,863.00	7,452,000
スミダコーポレーション	10,700	1,000.00	10,700,000
アイコム	7,400	2,219.00	16,420,600
リオン	6,300	2,399.00	15,113,700
本多通信工業	12,300	495.00	6,088,500
横河電機	132,900	1,977.00	262,743,300
新電元工業	4,700	3,480.00	16,356,000
アズビル	83,800	2,889.00	242,098,200
東亜ディーケーケー	7,200	825.00	5,940,000
日本光電工業	58,700	3,175.00	186,372,500
チノー	4,700	1,367.00	6,424,900
共和電業	14,200	422.00	5,992,400
日本電子材料	5,500	500.00	2,750,000
堀場製作所	26,300	6,240.00	164,112,000
アドバンテスト	90,500	4,775.00	432,137,500
小野測器	6,500	530.00	3,445,000
エスベック	12,000	1,879.00	22,548,000
キーエンス	65,100	66,900.00	4,355,190,000
日置電機	7,100	3,645.00	25,879,500
シスメックス	103,500	7,232.00	748,512,000
日本マイクロニクス	23,700	864.00	20,476,800
メガチップス	10,700	1,652.00	17,676,400
OBARA GROUP	7,000	3,650.00	25,550,000
澤藤電機	1,900	1,786.00	3,393,400
原田工業	6,000	833.00	4,998,000
コーセル	16,700	1,025.00	17,117,500
イリソ電子工業	12,300	5,180.00	63,714,000
オブテックスグループ	22,100	1,606.00	35,492,600
千代田インテグレ	6,400	2,138.00	13,683,200
アイ・オー・データ機器	5,500	877.00	4,823,500
レーザーテック	27,300	6,760.00	184,548,000
スタンレー電気	93,800	2,856.00	267,892,800
岩崎電気	5,600	1,335.00	7,476,000
ウシオ電機	77,400	1,526.00	118,112,400
岡谷電機産業	10,800	366.00	3,952,800
ヘリオス テクノ ホールディング	13,100	554.00	7,257,400
エノモト	4,200	1,027.00	4,313,400

日本セラミック	13,600	2,724.00	37,046,400
遠藤照明	7,500	663.00	4,972,500
古河電池	10,300	606.00	6,241,800
双信電機	7,600	432.00	3,283,200
山一電機	10,000	1,220.00	12,200,000
図研	8,900	1,860.00	16,554,000
日本電子	26,400	2,563.00	67,663,200
カシオ計算機	117,500	1,675.00	196,812,500
ファナック	126,100	20,340.00	2,564,874,000
日本シイエムケイ	34,600	577.00	19,964,200
エンプラス	6,200	3,500.00	21,700,000
大真空	5,300	1,008.00	5,342,400
ローム	63,500	8,250.00	523,875,000
浜松ホトニクス	95,300	4,010.00	382,153,000
三井ハイテック	14,900	1,695.00	25,255,500
新光電気工業	45,100	920.00	41,492,000
京セラ	202,300	6,705.00	1,356,421,500
太陽誘電	59,200	2,629.00	155,636,800
村田製作所	417,800	5,185.00	2,166,293,000
双葉電子工業	21,400	1,323.00	28,312,200
北陸電気工業	5,500	1,031.00	5,670,500
ニチコン	42,300	984.00	41,623,200
日本ケミコン	9,400	1,588.00	14,927,200
K O A	20,400	1,328.00	27,091,200
市光工業	20,500	806.00	16,523,000
小糸製作所	79,600	5,280.00	420,288,000
ミツバ	25,200	630.00	15,876,000
S C R E E Nホールディングス	23,000	6,370.00	146,510,000
キャノン電子	14,200	1,833.00	26,028,600
キャノン	714,400	2,882.50	2,059,258,000
リコー	399,100	973.00	388,324,300
象印マホービン	39,200	1,427.00	55,938,400
M U T O Hホールディングス	2,100	1,664.00	3,494,400
東京エレクトロン	88,500	20,565.00	1,820,002,500
トヨタ紡織	46,700	1,511.00	70,563,700
芦森工業	3,000	1,391.00	4,173,000
ユニプレス	26,000	1,693.00	44,018,000
豊田自動織機	107,500	6,200.00	666,500,000
モリタホールディングス	23,400	1,693.00	39,616,200
三櫻工業	17,500	613.00	10,727,500
デンソー	292,300	4,749.00	1,388,132,700
東海理化電機製作所	35,200	1,826.00	64,275,200

三井E & Sホールディングス	47,900	948.00	45,409,200
川崎重工業	103,300	2,392.00	247,093,600
名村造船所	39,900	300.00	11,970,000
日本車輛製造	4,800	2,578.00	12,374,400
三菱ロジスネクスト	21,900	1,022.00	22,381,800
近畿車輛	2,000	1,369.00	2,738,000
日産自動車	1,565,000	674.10	1,054,966,500
いすゞ自動車	419,500	1,190.50	499,414,750
トヨタ自動車	1,478,800	7,216.00	10,671,020,800
日野自動車	165,700	890.00	147,473,000
三菱自動車工業	491,200	469.00	230,372,800
エフテック	9,900	685.00	6,781,500
レシップホールディングス	4,700	787.00	3,698,900
G M B	3,100	783.00	2,427,300
ファルテック	2,900	745.00	2,160,500
武蔵精密工業	32,500	1,371.00	44,557,500
日産車体	25,900	875.00	22,662,500
新明和工業	55,600	1,262.00	70,167,200
極東開発工業	26,400	1,297.00	34,240,800
日信工業	24,500	1,513.00	37,068,500
トピー工業	11,100	1,922.00	21,334,200
ティラド	5,000	1,761.00	8,805,000
タチエス	22,100	1,308.00	28,906,800
N O K	71,600	1,602.00	114,703,200
フタバ産業	37,500	751.00	28,162,500
K Y B	13,800	3,165.00	43,677,000
大同メタル工業	22,200	638.00	14,163,600
プレス工業	66,700	450.00	30,015,000
ミクニ	18,200	317.00	5,769,400
太平洋工業	28,100	1,579.00	44,369,900
ケーヒン	30,700	1,585.00	48,659,500
河西工業	16,800	772.00	12,969,600
アイシン精機	109,400	3,395.00	371,413,000
マツダ	416,500	959.50	399,631,750
今仙電機製作所	12,800	878.00	11,238,400
本田技研工業	1,119,500	2,798.50	3,132,920,750
スズキ	242,800	4,587.00	1,113,723,600
S U B A R U	412,000	3,040.00	1,252,480,000
安永	6,700	1,283.00	8,596,100
ヤマハ発動機	173,000	1,958.00	338,734,000
ショーワ	31,600	1,557.00	49,201,200
T B K	16,800	411.00	6,904,800

エクセディ	18,200	2,109.00	38,383,800
豊田合成	43,000	2,163.00	93,009,000
愛三工業	21,300	917.00	19,532,100
盟和産業	2,400	1,103.00	2,647,200
日本プラスト	11,000	689.00	7,579,000
ヨロズ	12,700	1,301.00	16,522,700
エフ・シー・シー	24,100	2,080.00	50,128,000
シマノ	49,700	16,280.00	809,116,000
テイ・エス テック	30,900	3,280.00	101,352,000
ジャムコ	6,900	1,523.00	10,508,700
テルモ	375,500	3,480.00	1,306,740,000
クリエートメディック	4,400	972.00	4,276,800
日機装	39,800	1,152.00	45,849,600
島津製作所	170,800	2,728.00	465,942,400
JMS	12,300	646.00	7,945,800
長野計器	10,500	680.00	7,140,000
ブイ・テクノロジー	6,200	5,250.00	32,550,000
東京計器	8,500	887.00	7,539,500
愛知時計電機	1,800	4,000.00	7,200,000
インターアクション	7,100	2,050.00	14,555,000
オーバル	13,100	242.00	3,170,200
東京精密	24,000	3,175.00	76,200,000
マニー	52,900	2,841.00	150,288,900
ニコン	231,300	1,348.00	311,792,400
トプコン	71,300	1,433.00	102,172,900
オリンパス	790,800	1,456.00	1,151,404,800
理研計器	11,700	2,076.00	24,289,200
タムロン	10,700	2,318.00	24,802,600
H O Y A	267,200	8,819.00	2,356,436,800
シード	5,700	898.00	5,118,600
ノーリツ鋼機	10,500	1,698.00	17,829,000
エー・アンド・デイ	12,100	720.00	8,712,000
朝日インテック	112,600	2,837.00	319,446,200
シチズン時計	145,300	528.00	76,718,400
リズム時計工業	4,500	1,027.00	4,621,500
大研医器	10,600	514.00	5,448,400
メニコン	18,200	3,790.00	68,978,000
シンシア	1,500	624.00	936,000
松風	6,500	1,478.00	9,607,000
セイコーホールディングス	20,500	2,386.00	48,913,000
ニプロ	91,900	1,213.00	111,474,700
中本パックス	3,700	1,438.00	5,320,600

スノーピーク	6,000	1,296.00	7,776,000
パラマウントベッドホールディングス	15,300	3,925.00	60,052,500
トランザクション	8,500	1,028.00	8,738,000
S H O - B I	3,900	379.00	1,478,100
ニホンフラッシュ	5,700	2,574.00	14,671,800
前田工織	14,600	1,526.00	22,279,600
永大産業	17,300	328.00	5,674,400
アートネイチャー	14,200	689.00	9,783,800
バンダイナムコホールディングス	137,200	6,730.00	923,356,000
アイフィスジャパン	3,400	797.00	2,709,800
共立印刷	22,100	157.00	3,469,700
S H O E I	6,400	4,530.00	28,992,000
フランスベッドホールディングス	18,800	1,010.00	18,988,000
パイロットコーポレーション	23,100	4,000.00	92,400,000
萩原工業	7,400	1,467.00	10,855,800
トッパン・フォームズ	28,400	1,022.00	29,024,800
フジシールインターナショナル	29,700	2,729.00	81,051,300
タカラトミー	55,500	1,235.00	68,542,500
廣済堂	12,300	715.00	8,794,500
エステールホールディングス	3,500	638.00	2,233,000
アーク	50,600	94.00	4,756,400
タカノ	5,200	775.00	4,030,000
プロネクサス	11,400	1,112.00	12,676,800
ホクシン	8,200	167.00	1,369,400
ウッドワン	4,500	1,051.00	4,729,500
大建工業	10,000	1,875.00	18,750,000
凸版印刷	197,200	1,912.00	377,046,400
大日本印刷	187,000	2,791.00	521,917,000
共同印刷	4,100	2,706.00	11,094,600
N I S S H A	27,200	1,071.00	29,131,200
光村印刷	1,200	1,767.00	2,120,400
宝印刷	6,400	1,670.00	10,688,000
アシックス	109,500	1,845.00	202,027,500
ツツミ	4,100	2,082.00	8,536,200
小松ウオール工業	4,000	1,931.00	7,724,000
ヤマハ	78,900	4,850.00	382,665,000
河合楽器製作所	4,100	2,901.00	11,894,100
クリナップ	12,300	539.00	6,629,700
ピジョン	80,200	4,455.00	357,291,000
兼松サステック	900	1,778.00	1,600,200
キングジム	11,000	840.00	9,240,000
リンテック	31,500	2,137.00	67,315,500

イトーキ	28,200	447.00	12,605,400
任天堂	75,900	40,020.00	3,037,518,000
三菱鉛筆	21,900	1,713.00	37,514,700
タカスタンダード	27,400	1,781.00	48,799,400
コクヨ	63,700	1,508.00	96,059,600
ナカバヤシ	13,000	520.00	6,760,000
グロープライド	6,400	2,789.00	17,849,600
オカムラ	46,300	1,053.00	48,753,900
美津濃	13,100	2,800.00	36,680,000
東京電力ホールディングス	1,059,300	529.00	560,369,700
中部電力	406,000	1,565.00	635,390,000
関西電力	541,500	1,208.50	654,402,750
中国電力	183,500	1,389.00	254,881,500
北陸電力	130,000	726.00	94,380,000
東北電力	310,800	1,054.00	327,583,200
四国電力	119,500	1,019.00	121,770,500
九州電力	273,500	1,020.00	278,970,000
北海道電力	124,200	569.00	70,669,800
沖縄電力	24,600	1,700.00	41,820,000
電源開発	105,600	2,465.00	260,304,000
エフオン	6,200	706.00	4,377,200
イーレックス	23,100	1,274.00	29,429,400
レノバ	21,800	914.00	19,925,200
東京瓦斯	255,200	2,724.50	695,292,400
大阪瓦斯	257,500	2,067.00	532,252,500
東邦瓦斯	65,700	4,130.00	271,341,000
北海道瓦斯	7,100	1,508.00	10,706,800
広島ガス	27,300	337.00	9,200,100
西部瓦斯	14,900	2,370.00	35,313,000
静岡ガス	37,700	916.00	34,533,200
メタウォーター	6,400	3,675.00	23,520,000
SBSホールディングス	11,500	1,566.00	18,009,000
東武鉄道	140,000	3,500.00	490,000,000
相鉄ホールディングス	45,500	2,823.00	128,446,500
東急	360,400	2,028.00	730,891,200
京浜急行電鉄	181,800	2,095.00	380,871,000
小田急電鉄	212,500	2,588.00	549,950,000
京王電鉄	74,100	6,730.00	498,693,000
京成電鉄	99,400	4,445.00	441,833,000
富士急行	18,100	4,480.00	81,088,000
新京成電鉄	3,400	2,095.00	7,123,000
東日本旅客鉄道	233,600	10,310.00	2,408,416,000

西日本旅客鉄道	118,300	9,131.00	1,080,197,300	
東海旅客鉄道	118,800	22,220.00	2,639,736,000	
西武ホールディングス	164,400	1,883.00	309,565,200	
鴻池運輸	21,100	1,595.00	33,654,500	
西日本鉄道	36,800	2,372.00	87,289,600	
ハマキョウレックス	10,200	3,470.00	35,394,000	
サカイ引越センター	7,000	6,200.00	43,400,000	
近鉄グループホールディングス	125,700	5,630.00	707,691,000	
阪急阪神ホールディングス	167,600	4,165.00	698,054,000	
南海電気鉄道	56,100	2,735.00	153,433,500	
京阪ホールディングス	56,000	4,805.00	269,080,000	
神戸電鉄	3,200	3,970.00	12,704,000	
名古屋鉄道	103,300	3,230.00	333,659,000	
山陽電気鉄道	9,700	2,199.00	21,330,300	
日本通運	48,500	5,510.00	267,235,000	
ヤマトホールディングス	220,300	1,626.00	358,207,800	
山九	34,900	5,610.00	195,789,000	
丸運	7,200	258.00	1,857,600	
丸全昭和運輸	10,200	3,010.00	30,702,000	
センコーグループホールディングス	69,300	841.00	58,281,300	
トナミホールディングス	3,000	4,605.00	13,815,000	
ニッコンホールディングス	47,800	2,460.00	117,588,000	
日本石油輸送	1,500	2,842.00	4,263,000	
福山通運	16,100	3,790.00	61,019,000	
セイノーホールディングス	94,100	1,352.00	127,223,200	
エスライン	3,800	919.00	3,492,200	
神奈川中央交通	3,100	3,850.00	11,935,000	
日立物流	27,600	3,160.00	87,216,000	
丸和運輸機関	13,200	2,681.00	35,389,200	
C & F ロジホールディングス	12,700	1,235.00	15,684,500	
九州旅客鉄道	105,500	3,445.00	363,447,500	
S Gホールディングス	118,700	2,645.00	313,961,500	
日本郵船	105,500	1,805.00	190,427,500	
商船三井	74,800	2,730.00	204,204,000	
川崎汽船	38,700	1,257.00	48,645,900	
N S ユナイテッド海運	7,300	2,244.00	16,381,200	
飯野海運	61,900	344.00	21,293,600	
共栄タンカー	1,700	1,348.00	2,291,600	
乾汽船	11,300	1,199.00	13,548,700	
日本航空	230,100	3,212.00	739,081,200	
A N A ホールディングス	229,700	3,634.00	834,729,800	
パスコ	2,400	908.00	2,179,200	

トランコム	3,500	6,250.00	21,875,000
日新	10,900	1,557.00	16,971,300
三菱倉庫	43,500	2,747.00	119,494,500
三井倉庫ホールディングス	15,400	1,673.00	25,764,200
住友倉庫	46,300	1,421.00	65,792,300
澁澤倉庫	6,900	1,895.00	13,075,500
東陽倉庫	22,700	321.00	7,286,700
日本トランスシティ	27,700	472.00	13,074,400
ケイヒン	2,400	1,252.00	3,004,800
中央倉庫	7,700	1,068.00	8,223,600
川西倉庫	2,600	1,083.00	2,815,800
安田倉庫	10,300	930.00	9,579,000
ファイズ	2,200	781.00	1,718,200
東洋埠頭	3,800	1,353.00	5,141,400
宇徳	10,700	491.00	5,253,700
上組	77,500	2,448.00	189,720,000
サンリツ	3,000	645.00	1,935,000
キムラユニティー	3,400	1,049.00	3,566,600
キューソー流通システム	3,100	1,888.00	5,852,800
近鉄エクスプレス	23,700	1,518.00	35,976,600
東海運	7,100	285.00	2,023,500
エーアイティー	8,100	953.00	7,719,300
内外トランスライン	4,400	1,314.00	5,781,600
日本コンセプト	4,000	1,302.00	5,208,000
NEC ネットエスアイ	14,400	2,931.00	42,206,400
クロスキャット	3,700	1,033.00	3,822,100
システナ	46,600	1,606.00	74,839,600
デジタルアーツ	7,000	7,140.00	49,980,000
日鉄ソリューションズ	19,600	3,525.00	69,090,000
キューブシステム	7,300	763.00	5,569,900
エイジア	2,800	1,219.00	3,413,200
コア	5,700	1,392.00	7,934,400
ソリトンシステムズ	6,000	974.00	5,844,000
ソフトクリエイティブホールディングス	5,800	1,622.00	9,407,600
T I S	43,400	6,230.00	270,382,000
ネオス	5,200	847.00	4,404,400
電算システム	5,100	2,886.00	14,718,600
グリー	90,400	492.00	44,476,800
コーエーテクモホールディングス	26,700	2,347.00	62,664,900
三菱総合研究所	5,700	3,585.00	20,434,500
電算	1,600	2,049.00	3,278,400
A G S	7,800	691.00	5,389,800

ファインデックス	11,300	912.00	10,305,600
ブレインパッド	2,600	6,110.00	15,886,000
K L a b	25,000	1,257.00	31,425,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,500	1,053.00	18,427,500
イーブুকイニシアティブジャパン	2,200	1,801.00	3,962,200
ネクソン	369,500	1,311.00	484,414,500
アイスタイル	33,800	746.00	25,214,800
エムアップ	4,600	2,007.00	9,232,200
エイチーム	9,200	1,126.00	10,359,200
エニグモ	9,500	972.00	9,234,000
テクノスジャパン	11,500	514.00	5,911,000
コロプラ	42,900	1,783.00	76,490,700
ブロードリーフ	65,000	582.00	37,830,000
クロス・マーケティンググループ	6,500	348.00	2,262,000
デジタルハーツホールディングス	6,200	925.00	5,735,000
システム情報	6,900	980.00	6,762,000
メディアドゥホールディングス	4,700	3,800.00	17,860,000
じげん	18,900	572.00	10,810,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	741.00	1,556,100
サイバーリンクス	2,200	1,136.00	2,499,200
フィックスターズ	14,000	1,439.00	20,146,000
C A R T A H O L D I N G S	6,500	1,034.00	6,721,000
オブティム	5,800	2,768.00	16,054,400
セレス	4,500	1,274.00	5,733,000
ティーガイア	9,400	2,179.00	20,482,600
セック	2,200	2,995.00	6,589,000
日本アジアグループ	13,700	330.00	4,521,000
豆蔵ホールディングス	9,000	1,721.00	15,489,000
テクマトリックス	9,300	2,325.00	21,622,500
プロシップ	4,000	1,230.00	4,920,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,500	2,450.00	77,175,000
G M O ペイメントゲートウェイ	21,500	7,230.00	155,445,000
ザッパラス	7,500	396.00	2,970,000
システムリサーチ	3,600	1,930.00	6,948,000
インターネットイニシアティブ	21,300	2,455.00	52,291,500
さくらインターネット	15,900	604.00	9,603,600
ヴィンクス	3,900	1,222.00	4,765,800
G M O クラウド	2,500	2,669.00	6,672,500
S R A ホールディングス	7,000	2,392.00	16,744,000
M i n o r i ソリューションズ	2,700	1,873.00	5,057,100
システムインテグレータ	4,100	652.00	2,673,200
朝日ネット	11,000	675.00	7,425,000

e B A S E	8,000	1,022.00	8,176,000
アバント	4,800	2,072.00	9,945,600
アドソル日進	4,700	2,198.00	10,330,600
フリービット	8,000	916.00	7,328,000
コムチュア	14,800	2,034.00	30,103,200
サイバーコム	2,500	1,768.00	4,420,000
アステリア	9,000	668.00	6,012,000
アイル	2,400	2,718.00	6,523,200
マークラインズ	6,700	1,806.00	12,100,200
メディカル・データ・ビジョン	10,100	1,104.00	11,150,400
ショーケース	3,400	783.00	2,662,200
モバイルファクトリー	3,100	1,665.00	5,161,500
テラスカイ	2,200	1,845.00	4,059,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,861.00	10,979,900
P C Iホールディングス	2,800	2,052.00	5,745,600
パイプドHD	2,200	1,428.00	3,141,600
アイビーシー	2,600	1,022.00	2,657,200
ネオジャパン	2,700	1,026.00	2,770,200
P R T I M E S	1,200	2,865.00	3,438,000
ランドコンピュータ	2,200	1,070.00	2,354,000
ダブルスタンダード	1,200	4,840.00	5,808,000
オープンドア	6,600	2,175.00	14,355,000
マイネット	4,700	531.00	2,495,700
アカツキ	4,600	6,680.00	30,728,000
ベネフィットジャパン	1,100	1,721.00	1,893,100
U b i c o mホールディングス	2,600	1,450.00	3,770,000
L I N E	29,800	3,865.00	115,177,000
カナミックネットワーク	8,400	571.00	4,796,400
ノムラシステムコーポレーション	3,300	534.00	1,762,200
チェンジ	2,700	1,985.00	5,359,500
シンクロ・フード	6,100	486.00	2,964,600
オークネット	8,200	1,353.00	11,094,600
セグエグループ	1,300	1,393.00	1,810,900
エイトレッド	1,500	1,580.00	2,370,000
A O I T Y O H o l d i n g s	13,600	625.00	8,500,000
マクロミル	23,400	886.00	20,732,400
ビーグリー	2,800	928.00	2,598,400
オロ	3,500	2,843.00	9,950,500
テモナ	2,100	526.00	1,104,600
ニーズウェル	1,900	704.00	1,337,600
サインポスト	2,100	2,139.00	4,491,900
ソルクシーズ	5,800	931.00	5,399,800

フェイス	5,500	778.00	4,279,000
プロトコーポレーション	11,900	1,172.00	13,946,800
ハイマックス	1,700	1,847.00	3,139,900
野村総合研究所	248,600	2,151.00	534,738,600
サイバネットシステム	9,700	670.00	6,499,000
C Eホールディングス	8,000	443.00	3,544,000
日本システム技術	2,300	1,221.00	2,808,300
インテージホールディングス	16,500	934.00	15,411,000
東邦システムサイエンス	4,100	1,004.00	4,116,400
ソースネクスト	51,100	474.00	24,221,400
インフォコム	14,300	2,522.00	36,064,600
ラクスル	7,000	3,570.00	24,990,000
F I G	15,000	309.00	4,635,000
システムサポート	1,300	1,618.00	2,103,400
アルテリア・ネットワークス	14,600	1,454.00	21,228,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,680.00	5,208,000
フォーカスシステムズ	9,100	831.00	7,562,100
クレスコ	4,000	3,430.00	13,720,000
フジ・メディア・ホールディングス	135,300	1,391.00	188,202,300
オービック	45,200	12,320.00	556,864,000
ジャストシステム	18,600	4,090.00	76,074,000
T D C ソフト	11,700	794.00	9,289,800
ヤフー	849,900	304.00	258,369,600
トレンドマイクロ	57,900	5,140.00	297,606,000
I Dホールディングス	5,200	1,240.00	6,448,000
日本オラクル	26,400	9,370.00	247,368,000
アルファシステムズ	4,200	2,714.00	11,398,800
フューチャー	15,900	1,881.00	29,907,900
C A C Holdings	8,700	1,298.00	11,292,600
ソフトバンク・テクノロジー	5,700	1,962.00	11,183,400
トーセ	3,800	861.00	3,271,800
オービックビジネスコンサルタント	13,400	4,375.00	58,625,000
伊藤忠テクノソリューションズ	59,400	2,862.00	170,002,800
アイティフォー	16,100	820.00	13,202,000
東計電算	2,000	3,190.00	6,380,000
エクスネット	2,700	935.00	2,524,500
大塚商会	70,500	4,305.00	303,502,500
サイボウズ	15,500	1,014.00	15,717,000
ソフトブレーン	8,100	651.00	5,273,100
電通国際情報サービス	8,100	3,375.00	27,337,500
デジタルガレージ	25,400	3,435.00	87,249,000
E Mシステムズ	10,700	2,028.00	21,699,600

ウェザーニューズ	4,500	3,320.00	14,940,000
C I J	10,000	831.00	8,310,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	3,045.00	4,263,000
日本エンタープライズ	14,700	233.00	3,425,100
WOWOW	6,300	2,619.00	16,499,700
スカラ	9,400	977.00	9,183,800
インテリジェント ウェイブ	5,200	807.00	4,196,400
I M A G I C A G R O U P	11,600	507.00	5,881,200
ネットワンシステムズ	46,200	2,913.00	134,580,600
システムソフト	33,300	109.00	3,629,700
アルゴグラフィックス	11,200	2,601.00	29,131,200
マーベラス	20,200	833.00	16,826,600
エイベックス	22,500	1,266.00	28,485,000
日本ユニシス	40,700	3,480.00	141,636,000
兼松エレクトロニクス	7,200	3,080.00	22,176,000
東京放送ホールディングス	86,500	1,748.00	151,202,000
日本テレビホールディングス	119,800	1,384.00	165,803,200
朝日放送グループホールディングス	13,300	709.00	9,429,700
テレビ朝日ホールディングス	35,900	1,695.00	60,850,500
スカパーJ S A Tホールディングス	86,300	437.00	37,713,100
テレビ東京ホールディングス	10,800	2,207.00	23,835,600
日本BS放送	4,700	1,064.00	5,000,800
ビジョン	12,300	1,562.00	19,212,600
スマートバリュー	4,200	742.00	3,116,400
ワイヤレスゲート	6,500	766.00	4,979,000
コネクシオ	9,400	1,359.00	12,774,600
クロップス	2,800	610.00	1,708,000
日本電信電話	890,700	5,156.00	4,592,449,200
K D D I	1,067,600	2,825.00	3,015,970,000
ソフトバンク	1,380,800	1,464.00	2,021,491,200
光通信	15,400	23,380.00	360,052,000
N T T ドコモ	824,600	2,753.00	2,270,123,800
エムティーアイ	13,000	704.00	9,152,000
G M O インターネット	51,500	1,856.00	95,584,000
ファイバーゲート	2,600	1,412.00	3,671,200
アйдママーケティングコミュニケーション	3,300	585.00	1,930,500
K A D O K A W A	38,200	1,511.00	57,720,200
学研ホールディングス	4,400	5,350.00	23,540,000
ゼンリン	26,100	1,829.00	47,736,900
昭文社	6,700	377.00	2,525,900
インプレスホールディングス	10,800	142.00	1,533,600
アイネット	7,600	1,331.00	10,115,600

松竹	8,600	14,000.00	120,400,000
東宝	85,700	4,735.00	405,789,500
東映	5,500	15,320.00	84,260,000
エヌ・ティ・ティ・データ	346,900	1,394.00	483,578,600
ピー・シー・エー	1,700	3,865.00	6,570,500
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	2,690.00	6,187,000
D T S	29,200	2,248.00	65,641,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,600	5,250.00	318,150,000
シーイーシー	14,100	2,018.00	28,453,800
カプコン	55,900	2,863.00	160,041,700
アイ・エス・ビー	2,700	1,470.00	3,969,000
ジャステック	8,500	1,096.00	9,316,000
S C S K	34,400	5,070.00	174,408,000
日本システムウエア	4,400	2,389.00	10,511,600
アイネス	16,700	1,167.00	19,488,900
T K C	11,100	4,680.00	51,948,000
富士ソフト	16,700	4,565.00	76,235,500
N S D	21,500	3,105.00	66,757,500
コナミホールディングス	53,300	5,220.00	278,226,000
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,458.00	10,815,200
J B C Cホールディングス	10,400	1,535.00	15,964,000
ミロク情報サービス	13,000	2,948.00	38,324,000
ソフトバンクグループ	1,033,300	4,240.00	4,381,192,000
ハウスイ	1,100	823.00	905,300
高千穂交易	5,100	1,113.00	5,676,300
伊藤忠食品	3,200	4,395.00	14,064,000
エレマテック	12,200	993.00	12,114,600
J A L U X	3,700	2,360.00	8,732,000
あらた	9,700	3,965.00	38,460,500
トーメンデバイス	2,000	2,361.00	4,722,000
東京エレクトロン デバイス	4,800	2,027.00	9,729,600
フィールズ	11,400	504.00	5,745,600
双日	721,900	335.00	241,836,500
アルフレッサ ホールディングス	145,300	2,413.00	350,608,900
横浜冷凍	36,700	1,035.00	37,984,500
ラサ商事	7,000	840.00	5,880,000
ラクーンホールディングス	6,300	668.00	4,208,400
アルコニックス	13,900	1,257.00	17,472,300
神戸物産	22,600	5,240.00	118,424,000
あい ホールディングス	18,700	1,845.00	34,501,500
ディーブイエックス	5,200	862.00	4,482,400
ダイワボウホールディングス	11,900	4,480.00	53,312,000

マクニカ・富士エレホールディングス	36,300	1,388.00	50,384,400
ラクト・ジャパン	4,900	3,875.00	18,987,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,600	1,047.00	25,756,200
八洲電機	10,100	864.00	8,726,400
メディアスホールディングス	7,500	715.00	5,362,500
レスターホールディングス	14,300	1,751.00	25,039,300
ジュテックホールディングス	3,000	999.00	2,997,000
大光	5,600	680.00	3,808,000
OCHIホールディングス	3,800	1,276.00	4,848,800
TOKAIホールディングス	69,100	1,011.00	69,860,100
黒谷	3,000	435.00	1,305,000
Cominix	2,300	848.00	1,950,400
三洋貿易	6,600	2,128.00	14,044,800
ビューティガレージ	2,100	1,847.00	3,878,700
ウイン・パートナーズ	8,500	1,132.00	9,622,000
ミタチ産業	4,000	699.00	2,796,000
シップヘルスケアホールディングス	27,200	4,595.00	124,984,000
明治電機工業	4,100	1,347.00	5,522,700
デリカフーズホールディングス	4,600	714.00	3,284,400
スターティアホールディングス	2,600	542.00	1,409,200
コメダホールディングス	30,400	2,013.00	61,195,200
富士興産	5,100	700.00	3,570,000
協栄産業	1,600	1,363.00	2,180,800
小野建	11,700	1,314.00	15,373,800
南陽	2,700	1,602.00	4,325,400
佐島電機	9,700	806.00	7,818,200
エコートレーディング	3,000	519.00	1,557,000
伯東	9,000	1,172.00	10,548,000
コンドーテック	10,100	917.00	9,261,700
中山福	7,600	531.00	4,035,600
ナガイレーベン	18,900	2,288.00	43,243,200
三菱食品	14,400	2,705.00	38,952,000
松田産業	9,600	1,425.00	13,680,000
第一興商	19,500	4,990.00	97,305,000
メディバルホールディングス	141,100	2,406.00	339,486,600
SPK	2,800	2,560.00	7,168,000
萩原電気ホールディングス	4,800	2,680.00	12,864,000
アズワン	9,400	8,950.00	84,130,000
スズデン	4,600	1,314.00	6,044,400
尾家産業	4,200	1,277.00	5,363,400
シモジマ	8,000	1,115.00	8,920,000
ドウシシャ	12,300	1,704.00	20,959,200

小津産業	2,900	1,835.00	5,321,500
高速	7,800	1,329.00	10,366,200
たけびし	4,600	1,337.00	6,150,200
リックス	3,000	1,519.00	4,557,000
丸文	11,600	545.00	6,322,000
ハピネット	10,900	1,267.00	13,810,300
橋本総業ホールディングス	2,700	1,631.00	4,403,700
日本ライフライン	38,700	1,732.00	67,028,400
タカショー	6,400	461.00	2,950,400
エクセル	4,900	1,218.00	5,968,200
マルカ	4,600	2,085.00	9,591,000
I D O M	44,100	475.00	20,947,500
日本エム・ディ・エム	7,700	1,690.00	13,013,000
進和	7,700	2,160.00	16,632,000
エスケイジャパン	3,200	426.00	1,363,200
ダイトロン	5,500	1,312.00	7,216,000
シークス	16,600	1,467.00	24,352,200
田中商事	4,400	637.00	2,802,800
オーハシテクニカ	7,400	1,358.00	10,049,200
白銅	4,200	1,395.00	5,859,000
伊藤忠商事	914,200	2,231.00	2,039,580,200
丸紅	1,288,900	717.70	925,043,530
高島	2,100	1,604.00	3,368,400
長瀬産業	73,500	1,506.00	110,691,000
蝶理	8,400	1,705.00	14,322,000
豊田通商	145,900	3,485.00	508,461,500
三共生興	22,300	513.00	11,439,900
兼松	52,200	1,214.00	63,370,800
ツカモトコーポレーション	2,300	1,048.00	2,410,400
三井物産	1,076,800	1,768.00	1,903,782,400
日本紙パルプ商事	7,400	3,765.00	27,861,000
日立ハイテクノロジーズ	39,700	6,240.00	247,728,000
カメイ	17,100	1,090.00	18,639,000
東都水産	1,800	2,565.00	4,617,000
O U G ホールディングス	2,100	2,752.00	5,779,200
スターゼン	4,800	4,295.00	20,616,000
山善	51,100	940.00	48,034,000
椿本興業	3,000	3,755.00	11,265,000
住友商事	773,000	1,688.00	1,304,824,000
内田洋行	5,600	3,910.00	21,896,000
三菱商事	917,200	2,651.00	2,431,497,200
第一実業	5,900	3,105.00	18,319,500

キヤノンマーケティングジャパン	37,400	2,294.00	85,795,600
西華産業	7,400	1,325.00	9,805,000
佐藤商事	11,700	820.00	9,594,000
菱洋エレクトロ	13,300	1,849.00	24,591,700
東京産業	13,100	494.00	6,471,400
ユアサ商事	13,400	3,080.00	41,272,000
神鋼商事	2,900	2,366.00	6,861,400
小林産業	7,900	283.00	2,235,700
阪和興業	22,700	2,954.00	67,055,800
正栄食品工業	8,500	3,270.00	27,795,000
カナデン	11,800	1,279.00	15,092,200
菱電商事	10,400	1,506.00	15,662,400
フルサト工業	7,200	1,440.00	10,368,000
岩谷産業	29,000	3,650.00	105,850,000
すてきナイスグループ	5,600	676.00	3,785,600
昭光通商	4,200	634.00	2,662,800
ニチモウ	2,000	1,848.00	3,696,000
極東貿易	4,000	1,740.00	6,960,000
イワキ	17,200	479.00	8,238,800
三愛石油	35,100	1,061.00	37,241,100
稲畑産業	31,400	1,328.00	41,699,200
G S Iクレオス	3,500	1,057.00	3,699,500
明和産業	12,100	506.00	6,122,600
クワザワ	4,700	534.00	2,509,800
ワキタ	27,900	1,062.00	29,629,800
東邦ホールディングス	38,700	2,501.00	96,788,700
サンゲツ	38,500	2,032.00	78,232,000
ミツウロコグループホールディングス	17,400	1,049.00	18,252,600
シナネンホールディングス	5,400	1,833.00	9,898,200
伊藤忠エネクス	28,900	821.00	23,726,900
サンリオ	40,400	2,081.00	84,072,400
サンワテクノス	8,000	863.00	6,904,000
リョーサン	14,400	2,744.00	39,513,600
新光商事	24,600	929.00	22,853,400
トーホー	5,900	1,858.00	10,962,200
三信電気	9,000	1,506.00	13,554,000
東陽テクニカ	15,100	1,073.00	16,202,300
モスフードサービス	17,200	2,474.00	42,552,800
加賀電子	13,000	1,933.00	25,129,000
ソーダニッカ	13,500	544.00	7,344,000
立花エレテック	9,700	1,640.00	15,908,000
フォーバル	5,700	977.00	5,568,900

PAL TAC	23,600	5,280.00	124,608,000
三谷産業	15,400	299.00	4,604,600
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,455.00	8,292,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,319.00	1,450,900
国際紙パルプ商事	30,600	308.00	9,424,800
ヤマタネ	6,600	1,355.00	8,943,000
丸紅建材リース	1,300	1,681.00	2,185,300
日鉄物産	9,300	4,225.00	39,292,500
泉州電業	4,000	2,817.00	11,268,000
トラスコ中山	27,200	2,522.00	68,598,400
オートバックスセブン	52,000	1,768.00	91,936,000
モリト	9,600	788.00	7,564,800
加藤産業	20,400	3,350.00	68,340,000
北恵	2,500	1,034.00	2,585,000
イノテック	7,800	869.00	6,778,200
イエローハット	24,700	1,592.00	39,322,400
J Kホールディングス	11,900	490.00	5,831,000
日伝	10,900	2,017.00	21,985,300
北沢産業	9,900	262.00	2,593,800
杉本商事	7,100	1,907.00	13,539,700
因幡電機産業	18,600	4,720.00	87,792,000
東テク	4,300	2,154.00	9,262,200
ミスミグループ本社	163,700	2,543.00	416,289,100
アルテック	10,500	202.00	2,121,000
タキヒヨー	4,000	1,820.00	7,280,000
蔵王産業	2,200	1,389.00	3,055,800
スズケン	59,600	5,800.00	345,680,000
ジェコス	9,000	856.00	7,704,000
グローセル	12,100	422.00	5,106,200
ローソン	33,100	5,530.00	183,043,000
サンエー	9,900	4,765.00	47,173,500
カワチ薬品	10,200	2,084.00	21,256,800
エービーシー・マート	20,400	6,870.00	140,148,000
ハードオフコーポレーション	5,400	735.00	3,969,000
アスクル	13,700	2,919.00	39,990,300
ゲオホールディングス	20,000	1,283.00	25,660,000
アダストリア	18,200	2,429.00	44,207,800
ジーフット	8,100	617.00	4,997,700
くら寿司	6,900	4,475.00	30,877,500
キャンドウ	6,300	1,623.00	10,224,900
パルグループホールディングス	6,700	3,340.00	22,378,000
エディオン	55,500	1,043.00	57,886,500

サーラコーポレーション	26,800	602.00	16,133,600
ワッツ	6,000	617.00	3,702,000
ハローズ	5,000	2,337.00	11,685,000
フジオフードシステム	5,600	2,920.00	16,352,000
あみやき亭	2,900	3,460.00	10,034,000
ひらまつ	26,500	339.00	8,983,500
大黒天物産	3,200	3,410.00	10,912,000
ハニーズホールディングス	11,600	1,459.00	16,924,400
ファーマライズホールディングス	3,300	590.00	1,947,000
アルペン	10,100	1,702.00	17,190,200
ハブ	4,300	1,293.00	5,559,900
クオールホールディングス	19,300	1,435.00	27,695,500
ジinzホールディングス	6,900	6,410.00	44,229,000
ビックカメラ	77,600	1,137.00	88,231,200
D C Mホールディングス	70,700	1,060.00	74,942,000
ペッパーフードサービス	10,500	1,567.00	16,453,500
MonotaRO	93,000	2,826.00	262,818,000
東京一番フーズ	3,600	608.00	2,188,800
DDホールディングス	5,800	1,512.00	8,769,600
きちりホールディングス	3,700	769.00	2,845,300
アークランドサービスホールディングス	9,600	1,940.00	18,624,000
J.フロント リテイリング	167,300	1,264.00	211,467,200
ドトール・日レスホールディングス	23,000	2,142.00	49,266,000
マツモトキヨシホールディングス	54,100	3,955.00	213,965,500
ブロンコビリー	6,900	2,320.00	16,008,000
Z O Z O	141,300	2,492.00	352,119,600
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,352.00	5,272,800
物語コーポレーション	3,200	10,080.00	32,256,000
ココカラファイン	14,700	5,820.00	85,554,000
三越伊勢丹ホールディングス	244,800	862.00	211,017,600
H a m e e	4,100	1,090.00	4,469,000
ウエルシアホールディングス	34,600	5,440.00	188,224,000
クリエイトSDホールディングス	19,300	2,520.00	48,636,000
丸善C H Iホールディングス	15,300	373.00	5,706,900
ティーライフ	1,900	835.00	1,586,500
エー・ピーカンパニー	2,700	549.00	1,482,300
チムニー	4,000	2,388.00	9,552,000
シュッピン	9,000	1,073.00	9,657,000
ネクステージ	18,700	1,156.00	21,617,200
ジョイフル本田	38,400	1,387.00	53,260,800
鳥貴族	4,400	2,425.00	10,670,000
キリン堂ホールディングス	5,200	2,109.00	10,966,800

ホットランド	7,900	1,147.00	9,061,300
すかいらーくホールディングス	146,500	1,966.00	288,019,000
SFPホールディングス	5,600	2,160.00	12,096,000
綿半ホールディングス	4,900	1,975.00	9,677,500
ヨシックス	2,200	3,160.00	6,952,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,100	962.00	36,652,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	686.00	4,253,200
B E E N O S	4,700	1,247.00	5,860,900
あさひ	10,900	1,189.00	12,960,100
日本調剤	4,700	3,715.00	17,460,500
コスモス薬品	5,800	21,150.00	122,670,000
トーエル	6,500	743.00	4,829,500
オンリー	2,400	817.00	1,960,800
セブン&アイ・ホールディングス	547,900	4,132.00	2,263,922,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,200	1,760.00	61,952,000
ツルハホールディングス	28,400	11,770.00	334,268,000
サンマルクホールディングス	10,400	2,379.00	24,741,600
フェリシモ	3,000	991.00	2,973,000
トリドールホールディングス	16,200	2,432.00	39,398,400
T O K Y O B A S E	12,000	787.00	9,444,000
ウイルプラスホールディングス	2,200	748.00	1,645,600
ジャパンミート	6,700	2,252.00	15,088,400
サツドラホールディングス	2,000	1,762.00	3,524,000
デファクトスタンダード	1,600	333.00	532,800
アレンザホールディングス	7,200	762.00	5,486,400
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,252.00	4,729,200
パロックジャパンリミテッド	10,700	1,018.00	10,892,600
クスリのアオキホールディングス	13,000	7,360.00	95,680,000
力の源ホールディングス	5,100	798.00	4,069,800
スシローグローバルホールディングス	14,400	7,270.00	104,688,000
L I X I L ビバ	11,100	1,624.00	18,026,400
メディカルシステムネットワーク	14,200	512.00	7,270,400
はるやまホールディングス	6,300	817.00	5,147,100
ノジマ	23,300	1,812.00	42,219,600
カップ・クリエイト	18,300	1,416.00	25,912,800
ライトオン	9,800	650.00	6,370,000
良品計画	185,200	2,018.00	373,733,600
三城ホールディングス	16,700	292.00	4,876,400
アドヴァン	20,100	1,151.00	23,135,100
アルビス	5,000	2,339.00	11,695,000
コナカ	15,700	414.00	6,499,800

ハウス オブ ローゼ	1,700	1,630.00	2,771,000
G - 7ホールディングス	3,900	3,045.00	11,875,500
イオン北海道	13,400	751.00	10,063,400
コジマ	22,800	488.00	11,126,400
ヒマラヤ	4,800	824.00	3,955,200
コーナン商事	17,200	2,386.00	41,039,200
エコス	4,900	1,684.00	8,251,600
ワタミ	17,300	1,355.00	23,441,500
マルシェ	3,600	772.00	2,779,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	313,200	1,805.00	565,326,000
西松屋チェーン	28,800	920.00	26,496,000
ゼンショーホールディングス	63,600	2,330.00	148,188,000
幸楽苑ホールディングス	8,400	2,344.00	19,689,600
ハークスレイ	2,900	1,064.00	3,085,600
サイゼリヤ	21,600	2,777.00	59,983,200
V Tホールディングス	59,400	444.00	26,373,600
魚力	3,700	1,516.00	5,609,200
フジ・コーポレーション	3,500	2,167.00	7,584,500
ユナイテッドアローズ	15,000	3,160.00	47,400,000
ハイデイ日高	18,900	2,087.00	39,444,300
京都きもの友禅	8,700	351.00	3,053,700
コロワイド	43,500	1,997.00	86,869,500
ピーシーデポコーポレーション	17,600	491.00	8,641,600
壱番屋	9,200	5,080.00	46,736,000
P L A N T	3,500	715.00	2,502,500
スギホールディングス	28,700	5,850.00	167,895,000
薬王堂ホールディングス	5,700	2,706.00	15,424,200
スクロール	20,500	322.00	6,601,000
ヨンドシーホールディングス	14,600	2,626.00	38,339,600
ファミリーマート	146,200	2,633.00	384,944,600
木曽路	16,100	2,722.00	43,824,200
S R Sホールディングス	15,500	1,020.00	15,810,000
タカキュー	11,000	176.00	1,936,000
ケーヨー	24,500	492.00	12,054,000
上新電機	15,500	2,139.00	33,154,500
日本瓦斯	20,700	3,045.00	63,031,500
ロイヤルホールディングス	22,900	2,731.00	62,539,900
いなげや	14,700	1,568.00	23,049,600
島忠	27,700	2,639.00	73,100,300
チヨダ	13,800	1,691.00	23,335,800
ライフコーポレーション	10,000	2,154.00	21,540,000
リンガーハット	16,200	2,578.00	41,763,600

MrMaxHD	18,300	455.00	8,326,500
テンアライド	12,000	432.00	5,184,000
AOKIホールディングス	26,300	1,039.00	27,325,700
オークワ	18,800	1,213.00	22,804,400
コメリ	20,200	2,182.00	44,076,400
青山商事	22,900	1,882.00	43,097,800
しまむら	15,200	8,560.00	130,112,000
はせがわ	7,300	400.00	2,920,000
高島屋	102,700	1,259.00	129,299,300
松屋	26,500	833.00	22,074,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,200	1,181.00	79,363,200
近鉄百貨店	5,000	3,140.00	15,700,000
パルコ	12,700	1,271.00	16,141,700
丸井グループ	110,600	2,282.00	252,389,200
アクシアル リテイリング	10,900	3,930.00	42,837,000
イオン	503,000	1,980.50	996,191,500
イズミ	26,600	4,230.00	112,518,000
平和堂	26,600	2,028.00	53,944,800
フジ	15,900	1,876.00	29,828,400
ヤオコー	14,900	4,830.00	71,967,000
ゼビオホールディングス	15,900	1,177.00	18,714,300
ケーズホールディングス	135,900	1,176.00	159,818,400
Olympicグループ	7,900	619.00	4,890,100
日産東京販売ホールディングス	19,700	282.00	5,555,400
Genky DrugStores	6,400	2,202.00	14,092,800
総合メディカルホールディングス	11,500	1,770.00	20,355,000
ブックオフグループホールディングス	6,800	1,173.00	7,976,400
アインホールディングス	17,500	6,290.00	110,075,000
元気寿司	3,700	2,711.00	10,030,700
ヤマダ電機	398,500	523.00	208,415,500
アークランドサカモト	22,300	1,253.00	27,941,900
ニトリホールディングス	56,600	15,810.00	894,846,000
グルメ杵屋	9,400	1,156.00	10,866,400
愛眼	10,400	243.00	2,527,200
ケーユーホールディングス	7,000	849.00	5,943,000
吉野家ホールディングス	45,700	2,445.00	111,736,500
松屋フーズホールディングス	6,300	3,890.00	24,507,000
サガミホールディングス	17,600	1,337.00	23,531,200
関西スーパーマーケット	10,000	1,073.00	10,730,000
王将フードサービス	9,600	6,990.00	67,104,000
プレナス	14,700	1,810.00	26,607,000
ミニストップ	9,800	1,391.00	13,631,800

アークス	24,600	2,259.00	55,571,400
パローホールディングス	28,300	1,820.00	51,506,000
ベルク	6,500	5,280.00	34,320,000
大庄	7,100	1,570.00	11,147,000
ファーストリテイリング	17,500	64,210.00	1,123,675,000
サンドラッグ	49,200	3,400.00	167,280,000
サクスパー ホールディングス	11,200	890.00	9,968,000
ヤマザワ	2,800	1,670.00	4,676,000
やまや	2,300	2,191.00	5,039,300
ペルーナ	32,300	686.00	22,157,800
島根銀行	4,100	680.00	2,788,000
じもとホールディングス	88,400	99.00	8,751,600
めぶきフィナンシャルグループ	683,500	266.00	181,811,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,300	1,400.00	25,620,000
九州フィナンシャルグループ	216,900	440.00	95,436,000
ゆうちょ銀行	371,700	1,047.00	389,169,900
富山第一銀行	34,100	307.00	10,468,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	823,300	414.00	340,846,200
西日本フィナンシャルホールディングス	83,600	757.00	63,285,200
関西みらいフィナンシャルグループ	62,800	679.00	42,641,200
三十三フィナンシャルグループ	11,900	1,605.00	19,099,500
第四北越フィナンシャルグループ	23,100	2,718.00	62,785,800
新生銀行	96,100	1,574.00	151,261,400
あおぞら銀行	73,100	2,702.00	197,516,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,009,800	548.40	4,940,974,320
りそなホールディングス	1,436,300	463.00	665,006,900
三井住友トラスト・ホールディングス	257,300	3,896.00	1,002,440,800
三井住友フィナンシャルグループ	922,400	3,695.00	3,408,268,000
千葉銀行	451,800	556.00	251,200,800
群馬銀行	264,400	350.00	92,540,000
武蔵野銀行	20,000	1,875.00	37,500,000
千葉興業銀行	39,000	289.00	11,271,000
筑波銀行	54,400	183.00	9,955,200
七十七銀行	41,600	1,603.00	66,684,800
青森銀行	10,500	2,630.00	27,615,000
秋田銀行	8,800	2,047.00	18,013,600
山形銀行	15,300	1,459.00	22,322,700
岩手銀行	9,500	2,602.00	24,719,000
東邦銀行	117,000	254.00	29,718,000
東北銀行	6,700	1,056.00	7,075,200
みちのく銀行	8,400	1,559.00	13,095,600
ふくおかフィナンシャルグループ	115,700	2,041.00	236,143,700

静岡銀行	325,200	805.00	261,786,000
十六銀行	18,000	2,367.00	42,606,000
八十二銀行	317,900	440.00	139,876,000
山梨中央銀行	16,600	1,028.00	17,064,800
大垣共立銀行	28,000	2,391.00	66,948,000
福井銀行	11,800	1,425.00	16,815,000
北國銀行	13,900	2,801.00	38,933,900
清水銀行	5,900	1,842.00	10,867,800
富山銀行	2,900	2,592.00	7,516,800
滋賀銀行	26,600	2,455.00	65,303,000
南都銀行	20,800	2,526.00	52,540,800
百五銀行	120,400	345.00	41,538,000
京都銀行	47,100	4,225.00	198,997,500
紀陽銀行	46,900	1,679.00	78,745,100
ほくほくフィナンシャルグループ	88,000	1,045.00	91,960,000
広島銀行	194,900	534.00	104,076,600
山陰合同銀行	79,000	656.00	51,824,000
中国銀行	113,600	1,015.00	115,304,000
鳥取銀行	5,100	1,438.00	7,333,800
伊予銀行	175,000	565.00	98,875,000
百十四銀行	14,300	2,220.00	31,746,000
四国銀行	19,500	980.00	19,110,000
阿波銀行	20,400	2,437.00	49,714,800
大分銀行	8,300	2,898.00	24,053,400
宮崎銀行	9,100	2,422.00	22,040,200
佐賀銀行	8,500	1,471.00	12,503,500
沖縄銀行	12,300	3,385.00	41,635,500
琉球銀行	31,000	1,112.00	34,472,000
セブン銀行	445,300	296.00	131,808,800
みずほフィナンシャルグループ	17,784,900	165.60	2,945,179,440
高知銀行	4,700	790.00	3,713,000
山口フィナンシャルグループ	164,600	742.00	122,133,200
長野銀行	4,800	1,622.00	7,785,600
名古屋銀行	10,900	3,175.00	34,607,500
北洋銀行	201,200	229.00	46,074,800
愛知銀行	5,000	3,390.00	16,950,000
中京銀行	5,800	2,105.00	12,209,000
大光銀行	5,000	1,581.00	7,905,000
愛媛銀行	19,100	1,087.00	20,761,700
トマト銀行	5,900	1,066.00	6,289,400
京葉銀行	57,200	639.00	36,550,800
栃木銀行	72,400	195.00	14,118,000

北日本銀行	4,600	1,790.00	8,234,000
東和銀行	23,000	791.00	18,193,000
福島銀行	11,400	213.00	2,428,200
大東銀行	6,300	584.00	3,679,200
トモニホールディングス	103,800	350.00	36,330,000
フィデアホールディングス	127,100	116.00	14,743,600
池田泉州ホールディングス	143,600	187.00	26,853,200
F P G	41,300	1,080.00	44,604,000
マーキュリアインベストメント	6,000	718.00	4,308,000
S B Iホールディングス	156,000	2,311.00	360,516,000
ジャフコ	21,500	4,080.00	87,720,000
大和証券グループ本社	1,050,600	481.40	505,758,840
野村ホールディングス	2,303,400	457.90	1,054,726,860
岡三証券グループ	112,000	383.00	42,896,000
丸三証券	39,200	498.00	19,521,600
東洋証券	47,800	184.00	8,795,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,600	298.00	46,666,800
光世証券	3,400	591.00	2,009,400
水戸証券	38,700	238.00	9,210,600
いちよし証券	26,500	679.00	17,993,500
松井証券	64,300	908.00	58,384,400
だいこう証券ビジネス	5,600	552.00	3,091,200
マネックスグループ	121,200	311.00	37,693,200
極東証券	17,800	861.00	15,325,800
岩井コスモホールディングス	13,600	1,115.00	15,164,000
藍澤證券	23,800	674.00	16,041,200
マネーパートナーズグループ	16,000	259.00	4,144,000
スパークス・グループ	52,500	249.00	13,072,500
かんぽ生命保険	46,400	1,630.00	75,632,000
S O M P Oホールディングス	230,700	4,517.00	1,042,071,900
アニコム ホールディングス	10,800	4,095.00	44,226,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	342,200	3,500.00	1,197,700,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	107,600	2,342.00	251,999,200
第一生命ホールディングス	740,500	1,629.00	1,206,274,500
東京海上ホールディングス	468,000	5,779.00	2,704,572,000
T & Dホールディングス	404,800	1,145.00	463,496,000
アドバンスクリエイト	3,100	1,813.00	5,620,300
全国保証	36,900	4,205.00	155,164,500
ジェイリース	3,600	317.00	1,141,200
イントラスト	3,700	657.00	2,430,900
日本モーゲージサービス	2,400	1,208.00	2,899,200
C a s a	5,900	1,241.00	7,321,900

アルヒ	11,900	2,407.00	28,643,300
プレミアグループ	7,500	1,919.00	14,392,500
クレディセゾン	91,700	1,449.00	132,873,300
芙蓉総合リース	15,000	6,480.00	97,200,000
興銀リース	24,600	2,922.00	71,881,200
東京センチュリー	26,400	4,995.00	131,868,000
日本証券金融	57,700	503.00	29,023,100
アイフル	199,700	252.00	50,324,400
リコーリース	10,300	3,490.00	35,947,000
イオンフィナンシャルサービス	83,600	1,626.00	135,933,600
アコム	263,100	424.00	111,554,400
ジャックス	14,500	2,280.00	33,060,000
オリエントコーポレーション	354,000	145.00	51,330,000
日立キャピタル	30,900	2,195.00	67,825,500
アプラスフィナンシャル	62,800	73.00	4,584,400
オリックス	873,200	1,611.00	1,406,725,200
三菱UFJリース	295,300	624.00	184,267,200
九州リースサービス	6,400	596.00	3,814,400
日本取引所グループ	353,600	1,699.00	600,766,400
イー・ギャランティ	12,300	1,489.00	18,314,700
アサックス	5,400	618.00	3,337,200
NECキャピタルソリューション	5,300	2,171.00	11,506,300
いちご	168,900	435.00	73,471,500
日本駐車場開発	149,500	170.00	25,415,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,300	1,875.00	13,687,500
ヒューリック	280,400	1,105.00	309,842,000
三栄建築設計	6,000	1,479.00	8,874,000
野村不動産ホールディングス	87,700	2,334.00	204,691,800
三重交通グループホールディングス	28,400	549.00	15,591,600
サムティ	19,100	1,884.00	35,984,400
ディア・ライフ	18,800	488.00	9,174,400
コーセーアールイー	5,400	718.00	3,877,200
エー・ディー・ワークス	403,100	31.00	12,496,100
日本商業開発	8,900	1,458.00	12,976,200
プレサンスコーポレーション	21,400	1,742.00	37,278,800
ユニゾホールディングス	18,800	4,815.00	90,522,000
ハウスコム	2,100	1,546.00	3,246,600
日本管理センター	9,400	1,478.00	13,893,200
サンセイランディック	5,100	819.00	4,176,900
エストラスト	1,800	823.00	1,481,400
フージャースホールディングス	28,500	636.00	18,126,000
オープンハウス	38,400	2,574.00	98,841,600

東急不動産ホールディングス	353,600	689.00	243,630,400
飯田グループホールディングス	109,800	1,758.00	193,028,400
イーランド	3,300	698.00	2,303,400
ムゲンエステート	10,800	642.00	6,933,600
ハウストゥ	7,200	1,752.00	12,614,400
シーアールイー	4,200	1,008.00	4,233,600
ケイアイスター不動産	4,000	1,918.00	7,672,000
グッドコムアセット	3,600	1,877.00	6,757,200
ジェイ・エス・ビー	1,600	4,690.00	7,504,000
テンポイノベーション	2,100	1,660.00	3,486,000
パーク24	70,700	2,508.00	177,315,600
パラカ	3,800	2,058.00	7,820,400
三井不動産	694,800	2,679.00	1,861,369,200
三菱地所	917,400	2,084.00	1,911,861,600
平和不動産	24,500	2,420.00	59,290,000
東京建物	143,700	1,518.00	218,136,600
ダイビル	39,500	1,106.00	43,687,000
京阪神ビルディング	23,700	1,312.00	31,094,400
住友不動産	294,500	4,113.00	1,211,278,500
テーオーシー	31,200	825.00	25,740,000
東京楽天地	2,100	5,700.00	11,970,000
スターツコーポレーション	18,200	2,638.00	48,011,600
フジ住宅	18,200	692.00	12,594,400
空港施設	17,200	530.00	9,116,000
明和地所	9,100	538.00	4,895,800
ゴールドクレスト	10,800	2,120.00	22,896,000
日本エスリード	5,700	1,610.00	9,177,000
日神不動産	21,700	460.00	9,982,000
日本エスコン	25,000	823.00	20,575,000
タカラレーベン	62,300	418.00	26,041,400
サンヨーハウジング名古屋	8,600	869.00	7,473,400
イオンモール	66,200	1,705.00	112,871,000
毎日コムネット	4,100	771.00	3,161,100
ファースト住建	6,400	1,345.00	8,608,000
カチタス	14,800	4,440.00	65,712,000
トーセイ	18,800	1,276.00	23,988,800
穴吹興産	1,800	2,805.00	5,049,000
サンフロンティア不動産	18,900	1,289.00	24,362,100
エフ・ジェー・ネクスト	12,400	1,041.00	12,908,400
インテリックス	5,200	706.00	3,671,200
ランドビジネス	5,500	756.00	4,158,000
日本社宅サービス	4,300	1,049.00	4,510,700

グランディハウス	13,800	449.00	6,196,200
日本空港ビルディング	42,000	4,680.00	196,560,000
日本工営	8,600	3,150.00	27,090,000
L I F U L L	44,500	703.00	31,283,500
ジェイエイシーリクルートメント	8,600	2,068.00	17,784,800
日本M&Aセンター	95,800	3,040.00	291,232,000
メンバーズ	4,400	1,817.00	7,994,800
中広	1,600	564.00	902,400
アイティメディア	2,800	680.00	1,904,000
タケエイ	13,300	1,061.00	14,111,300
E・Jホールディングス	1,700	1,325.00	2,252,500
トラスト・テック	14,100	1,294.00	18,245,400
コシダカホールディングス	30,600	1,716.00	52,509,600
アルトナー	3,300	736.00	2,428,800
パソナグループ	15,600	1,553.00	24,226,800
C D S	3,300	1,331.00	4,392,300
リンクアンドモチベーション	28,200	552.00	15,566,400
G C A	15,200	775.00	11,780,000
エス・エム・エス	46,700	2,628.00	122,727,600
サニーサイドアップ	3,000	906.00	2,718,000
パーソルホールディングス	126,900	2,042.00	259,129,800
リニカル	7,300	989.00	7,219,700
クックパッド	44,800	302.00	13,529,600
エスクリ	3,700	830.00	3,071,000
アイ・ケイ・ケイ	6,400	702.00	4,492,800
学情	4,600	1,430.00	6,578,000
スタジオアリス	6,500	2,006.00	13,039,000
シミックホールディングス	7,100	1,716.00	12,183,600
エプコ	2,100	1,361.00	2,858,100
N J S	2,900	1,710.00	4,959,000
総合警備保障	50,500	5,660.00	285,830,000
カカクコム	95,000	2,658.00	252,510,000
アイロムグループ	4,800	1,622.00	7,785,600
セントケア・ホールディング	9,500	504.00	4,788,000
サイネックス	2,400	635.00	1,524,000
ルネサンス	7,100	1,603.00	11,381,300
ディップ	20,500	2,624.00	53,792,000
オプトホールディング	7,000	1,640.00	11,480,000
ツクイ	30,200	427.00	12,895,400
キャリアデザインセンター	3,300	1,421.00	4,689,300
ベネフィット・ワン	35,200	2,042.00	71,878,400
エムスリー	267,000	2,602.00	694,734,000

ツカダ・グローバルホールディング	8,400	597.00	5,014,800
プラス	1,700	658.00	1,118,600
アウトソーシング	72,700	1,028.00	74,735,600
ウェルネット	12,200	711.00	8,674,200
ワールドホールディングス	4,300	1,568.00	6,742,400
ディー・エヌ・エー	68,400	1,907.00	130,438,800
博報堂D Yホールディングス	176,400	1,561.00	275,360,400
ぐるなび	18,300	736.00	13,468,800
タカミヤ	13,700	643.00	8,809,100
ジャパンベストレスキューシステム	8,600	1,052.00	9,047,200
ファンコミュニケーションズ	35,200	538.00	18,937,600
ライク	5,100	1,599.00	8,154,900
ビジネス・ブレークスルー	5,800	361.00	2,093,800
エスプール	24,500	669.00	16,390,500
WDBホールディングス	5,800	2,889.00	16,756,200
ティア	7,700	614.00	4,727,800
C D G	1,300	1,372.00	1,783,600
バリューコマース	7,200	1,707.00	12,290,400
インフォマート	69,600	1,684.00	117,206,400
J Pホールディングス	36,800	265.00	9,752,000
エコナックホールディングス	24,300	125.00	3,037,500
E P Sホールディングス	19,200	1,281.00	24,595,200
レグス	3,200	1,547.00	4,950,400
プレステージ・インターナショナル	47,600	858.00	40,840,800
アミューズ	7,700	2,707.00	20,843,900
ドリームインキュベータ	4,000	1,477.00	5,908,000
クイック	8,000	1,355.00	10,840,000
T A C	7,700	198.00	1,524,600
ケネディクス	121,000	545.00	65,945,000
電通	130,800	3,805.00	497,694,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	1,173.00	5,865,000
ぴあ	3,700	4,675.00	17,297,500
イオンファンタジー	4,100	2,964.00	12,152,400
シーティーエス	14,500	715.00	10,367,500
ネクシィーズグループ	4,500	1,913.00	8,608,500
みらかホールディングス	35,500	2,462.00	87,401,000
アルプス技研	11,300	1,534.00	17,334,200
ダイオーズ	3,000	1,475.00	4,425,000
日本空調サービス	14,600	688.00	10,044,800
オリエンタルランド	149,900	16,440.00	2,464,356,000
ダスキン	32,600	2,784.00	90,758,400
明光ネットワークジャパン	15,100	879.00	13,272,900

ファルコホールディングス	7,100	1,631.00	11,580,100
ラウンドワン	39,400	1,615.00	63,631,000
リゾートトラスト	53,800	1,748.00	94,042,400
ビー・エム・エル	16,400	2,906.00	47,658,400
ワタベウェディング	2,300	577.00	1,327,100
りらいあコミュニケーションズ	23,000	1,346.00	30,958,000
リソー教育	64,700	439.00	28,403,300
早稲田アカデミー	3,800	808.00	3,070,400
ユー・エス・エス	155,000	2,097.00	325,035,000
東京個別指導学院	4,700	930.00	4,371,000
サイバーエージェント	73,000	4,150.00	302,950,000
楽天	591,200	1,065.00	629,628,000
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,197.00	9,097,200
テー・オー・ダブリュー	11,300	737.00	8,328,100
山田コンサルティンググループ	6,200	1,688.00	10,465,600
セントラルスポーツ	4,800	3,155.00	15,144,000
フルキャストホールディングス	12,800	2,189.00	28,019,200
エン・ジャパン	18,500	4,135.00	76,497,500
リソルホールディングス	1,400	4,000.00	5,600,000
テクノプロ・ホールディングス	25,500	6,400.00	163,200,000
アトラ	3,300	352.00	1,161,600
インターワークス	2,700	512.00	1,382,400
アイ・アールジャパンホールディングス	5,200	3,840.00	19,968,000
K e e P e r 技研	4,800	1,574.00	7,555,200
ファーストロジック	3,200	606.00	1,939,200
三機サービス	2,800	949.00	2,657,200
G u n o s y	8,900	1,397.00	12,433,300
デザインワン・ジャパン	3,000	308.00	924,000
イー・ガーディアン	6,500	1,645.00	10,692,500
リブセンス	8,800	259.00	2,279,200
ジャパンマテリアル	34,800	1,330.00	46,284,000
ベクトル	16,000	900.00	14,400,000
ウチヤマホールディングス	6,600	484.00	3,194,400
チャーム・ケア・コーポレーション	4,100	2,151.00	8,819,100
ライクキッズネクスト	3,200	899.00	2,876,800
キャリアリンク	4,900	606.00	2,969,400
I B J	8,700	1,151.00	10,013,700
アサンテ	5,200	1,971.00	10,249,200
N・フィールド	9,000	621.00	5,589,000
バリューHR	2,500	3,185.00	7,962,500
M&Aキャピタルパートナーズ	4,500	6,480.00	29,160,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	1,482.00	8,002,800

ERIホールディングス	3,800	807.00	3,066,600
アシスト	2,000	2,623.00	5,246,000
シグマクシス	6,200	1,452.00	9,002,400
ウィルグループ	8,400	939.00	7,887,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,200	232.00	4,222,400
リクルートホールディングス	908,400	3,286.00	2,985,002,400
エラン	7,600	1,767.00	13,429,200
土木管理総合試験所	5,900	433.00	2,554,700
ネットマーケティング	4,800	853.00	4,094,400
日本郵政	1,039,500	995.00	1,034,302,500
ベルシステム24ホールディングス	21,300	1,651.00	35,166,300
鎌倉新書	9,500	1,480.00	14,060,000
ソネット・メディア・ネットワークス	1,800	692.00	1,245,600
一蔵	1,600	610.00	976,000
LITALICO	3,000	2,040.00	6,120,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	837.00	1,757,700
エボラブルアジア	5,700	1,925.00	10,972,500
アトラエ	3,300	3,200.00	10,560,000
ストライク	4,800	2,909.00	13,963,200
ソラスト	31,200	1,215.00	37,908,000
セラク	4,200	706.00	2,965,200
インソース	6,200	2,711.00	16,808,200
ベikalレント・コンサルティング	9,000	4,755.00	42,795,000
Orchestra Holdings	2,700	1,163.00	3,140,100
アイモバイル	4,300	550.00	2,365,000
キャリアインデックス	4,700	423.00	1,988,100
MS - Japan	5,300	1,314.00	6,964,200
船場	2,200	955.00	2,101,000
グレイステクノロジー	4,600	2,943.00	13,537,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,000	2,806.00	28,060,000
フルテック	1,900	1,260.00	2,394,000
グリーンズ	4,900	1,342.00	6,575,800
ツナググループ・ホールディングス	1,800	571.00	1,027,800
GameWith	3,000	927.00	2,781,000
ソウルドアウト	2,100	1,311.00	2,753,100
MS&Consulting	2,000	977.00	1,954,000
日総工産	8,600	1,110.00	9,546,000
キュービーネットホールディングス	7,800	2,250.00	17,550,000
RPAホールディングス	5,500	1,697.00	9,333,500
スプリックス	4,400	1,412.00	6,212,800
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	793.00	4,123,600
リログループ	69,400	2,648.00	183,771,200

東祥	8,000	2,380.00	19,040,000	
エイチ・アイ・エス	19,800	2,683.00	53,123,400	
ラックランド	2,600	2,340.00	6,084,000	
共立メンテナンス	19,400	4,625.00	89,725,000	
イチネンホールディングス	13,300	1,088.00	14,470,400	
建設技術研究所	8,900	1,639.00	14,587,100	
スペース	8,400	1,260.00	10,584,000	
長大	4,800	940.00	4,512,000	
燦ホールディングス	5,600	1,088.00	6,092,800	
スバル興業	900	6,890.00	6,201,000	
東京テアトル	5,100	1,366.00	6,966,600	
タナベ経営	2,600	1,269.00	3,299,400	
ナガワ	3,600	6,010.00	21,636,000	
よみうりランド	2,800	4,470.00	12,516,000	
東京都競馬	8,300	3,290.00	27,307,000	
カナモト	20,800	2,683.00	55,806,400	
東京ドーム	47,600	1,040.00	49,504,000	
西尾レントオール	12,900	2,774.00	35,784,600	
トランス・コスモス	14,100	2,605.00	36,730,500	
乃村工藝社	59,400	1,360.00	80,784,000	
藤田観光	5,600	2,799.00	15,674,400	
KNT-CTホールディングス	6,800	1,582.00	10,757,600	
日本管財	13,700	1,867.00	25,577,900	
トーカイ	12,300	2,359.00	29,015,700	
白洋舎	1,500	2,880.00	4,320,000	
セコム	134,600	9,858.00	1,326,886,800	
セントラル警備保障	6,100	5,500.00	33,550,000	
丹青社	24,100	1,209.00	29,136,900	
メイテック	15,700	5,290.00	83,053,000	
応用地質	13,800	1,072.00	14,793,600	
船井総研ホールディングス	26,300	2,458.00	64,645,400	
進学会ホールディングス	6,100	523.00	3,190,300	
オオバ	10,200	633.00	6,456,600	
いであ	2,500	1,220.00	3,050,000	
学究社	4,300	1,230.00	5,289,000	
ベネッセホールディングス	46,500	2,806.00	130,479,000	
イオンディライト	15,700	3,390.00	53,223,000	
ナック	8,200	965.00	7,913,000	
ニチイ学館	18,100	1,770.00	32,037,000	
ダイセキ	21,300	2,759.00	58,766,700	
ステップ	4,800	1,418.00	6,806,400	
合計	155,575,280		301,610,113,430	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	44,585,520,900
国債証券	455,999,926,450
地方債証券	28,757,304,488
特殊債券	37,353,125,858
社債券	21,838,100,220
未収入金	1,913,211,000
未収利息	529,666,335
前払費用	20,546,025
流動資産合計	590,997,401,276
資産合計	590,997,401,276
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	150,324
未払金	45,837,364,314
未払解約金	191,222,759
未払利息	108,324
その他未払費用	1,584
流動負債合計	46,028,847,305
負債合計	46,028,847,305
純資産の部	
元本等	
元本	379,521,438,312
剰余金	
剰余金又は欠損金()	165,447,115,659
元本等合計	544,968,553,971
純資産合計	544,968,553,971
負債純資産合計	590,997,401,276

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	379,521,438,312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 103,654,000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 1.4359円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,359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

	2019年 9月30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>

2019年 9月30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

2019年 9月30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	2019年 9月30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	100,615,166,407円
期中一部解約元本額	21,086,918,606円
期末元本額	379,521,438,312円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,890,019,744円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,451,409円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,624,499,324円
世界経済インデックスファンド	1,880,518,685円
D C マイセレクション 2 5	20,402,818,229円
D C マイセレクション 5 0	22,149,547,364円
D C マイセレクション 7 5	5,992,680,556円
D C 日本債券インデックス・オープン	460,033,297円
D C 日本債券インデックス・オープン S	86,814,308,890円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,646,162,775円
D C マイセレクション S 2 5	8,328,594,267円
D C マイセレクション S 5 0	9,002,904,998円
D C マイセレクション S 7 5	1,722,450,192円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,095,250,053円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,308,747,279円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	438,175,541円
D C 世界経済インデックスファンド	1,664,986,174円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	73,557,794円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,809,222円

区分	2019年 9月30日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	41,247,056円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	13,389,556円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	163,632,455円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	281,409,538円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	59,566,864円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	130,956,441円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,212,430,347円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	936,857,021円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,535,735,823円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	770,300,225円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	100,813,605円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,219,423,368円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	28,085,837円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,415,075,565円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,783,021,078円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	163,524,129円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,129,204,034円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,078,910,946円
分散投資コア戦略ファンドA	11,747,932,999円
分散投資コア戦略ファンドS	7,414,474,159円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	67,711,569円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	814,406,340円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	50,936,972円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,887,942円
SMT インデックスバランス・オープン	64,104,650円
SMT 世界経済インデックス・オープン	11,546,689円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	12,040,358円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	24,308,542円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,476,298円
グローバル経済コア	225,637,794円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,478,909円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	722,214円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	18,784円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,633円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,089円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	78,459,528,331円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,351,757,050	
地方債証券	12,590,011	
特殊債券	2,987,803	
社債券	61,298,010	
合計	3,397,477,246	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2019年 9月30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	155,170,000	-	155,020,000	150,000
合計		155,170,000	-	155,020,000	150,000

(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。

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394回利付国債(2年)	200,000,000	200,880,000	
	第395回利付国債(2年)	560,000,000	562,654,400	
	第396回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,718,703,900	
	第397回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,608,688,000	
	第398回利付国債(2年)	3,460,000,000	3,480,137,200	
	第399回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,119,127,000	
	第400回利付国債(2年)	630,000,000	634,101,300	

第401回利付国債(2年)	3,460,000,000	3,484,012,400	
第402回利付国債(2年)	1,870,000,000	1,883,632,300	
第403回利付国債(2年)	3,770,000,000	3,799,179,800	
第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,974,652,000	
第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,808,823,400	
第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,621,527,600	
第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,368,122,800	
第130回利付国債(5年)	3,160,000,000	3,190,367,600	
第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,600,607,600	
第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,858,560,000	
第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,804,701,000	
第134回利付国債(5年)	5,970,000,000	6,059,430,600	
第135回利付国債(5年)	5,680,000,000	5,772,697,600	
第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	6,005,610,000	
第137回利付国債(5年)	6,830,000,000	6,956,491,600	
第138回利付国債(5年)	9,710,000,000	9,899,150,800	
第139回利付国債(5年)	5,770,000,000	5,890,419,900	
第140回利付国債(5年)	6,040,000,000	6,173,302,800	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	622,748,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,713,565,900	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	841,703,500	
第4回利付国債(40年)	1,000,000,000	1,544,060,000	
第5回利付国債(40年)	890,000,000	1,331,698,100	
第6回利付国債(40年)	1,620,000,000	2,390,115,600	
第7回利付国債(40年)	830,000,000	1,178,234,800	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	1,063,336,000	
第9回利付国債(40年)	1,170,000,000	1,166,279,400	
第10回利付国債(40年)	1,920,000,000	2,240,083,200	
第11回利付国債(40年)	1,730,000,000	1,960,678,200	
第12回利付国債(40年)	500,000,000	512,670,000	
第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,880,142,100	
第313回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,381,995,000	
第314回利付国債(10年)	470,000,000	479,757,200	
第315回利付国債(10年)	3,140,000,000	3,221,859,800	
第316回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,198,489,500	
第317回利付国債(10年)	890,000,000	915,044,600	
第318回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,011,273,600	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,764,463,500	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,705,317,700	
第321回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,551,979,300	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	773,025,000	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,003,125,500	

第324回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,826,063,400	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,020,769,200	
第326回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,717,021,000	
第327回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,670,552,100	
第328回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,863,321,300	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,348,775,000	
第330回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,768,585,000	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,433,061,000	
第332回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,382,210,000	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,430,958,900	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,918,535,300	
第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,777,506,200	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	533,327,400	
第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,498,638,000	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,553,806,500	
第339回利付国債(10年)	5,890,000,000	6,151,280,400	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,612,995,200	
第341回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,575,123,300	
第342回利付国債(10年)	5,760,000,000	5,937,350,400	
第343回利付国債(10年)	3,200,000,000	3,302,464,000	
第344回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,739,025,600	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,047,498,200	
第346回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,478,574,400	
第347回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,351,947,000	
第348回利付国債(10年)	4,110,000,000	4,259,850,600	
第349回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,442,043,200	
第350回利付国債(10年)	6,550,000,000	6,789,337,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,830,000,000	3,968,914,100	
第352回利付国債(10年)	4,890,000,000	5,063,252,700	
第353回利付国債(10年)	4,400,000,000	4,551,756,000	
第354回利付国債(10年)	3,940,000,000	4,071,714,200	
第355回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,254,305,200	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	143,278,300	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	203,486,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	151,849,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	147,664,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	63,610,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	248,052,600	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	234,372,600	
第8回利付国債(30年)	100,000,000	124,556,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	286,308,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	184,694,400	

第11回利付国債(30年)	90,000,000	111,446,100
第12回利付国債(30年)	190,000,000	246,428,100
第13回利付国債(30年)	290,000,000	373,000,900
第14回利付国債(30年)	300,000,000	404,151,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	464,416,200
第16回利付国債(30年)	370,000,000	506,951,800
第17回利付国債(30年)	570,000,000	774,658,500
第18回利付国債(30年)	345,000,000	465,201,450
第19回利付国債(30年)	380,000,000	513,737,200
第20回利付国債(30年)	480,000,000	666,316,800
第21回利付国債(30年)	500,000,000	679,900,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	558,676,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	602,163,400
第24回利付国債(30年)	380,000,000	533,516,200
第25回利付国債(30年)	350,000,000	480,749,500
第26回利付国債(30年)	530,000,000	738,618,600
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,432,836,500
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,340,886,800
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,982,834,000
第30回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,906,238,600
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,529,803,000
第32回利付国債(30年)	1,790,000,000	2,539,025,500
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,279,566,700
第34回利付国債(30年)	1,545,000,000	2,183,224,050
第35回利付国債(30年)	2,190,000,000	3,016,418,400
第36回利付国債(30年)	1,980,000,000	2,740,339,800
第37回利付国債(30年)	1,780,000,000	2,433,847,400
第38回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,688,812,500
第39回利付国債(30年)	940,000,000	1,294,511,600
第40回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,750,091,400
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,242,201,000
第42回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,524,613,200
第43回利付国債(30年)	910,000,000	1,218,581,000
第44回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,448,042,400
第45回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,476,300,000
第46回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,996,086,400
第47回利付国債(30年)	1,540,000,000	2,037,435,400
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	2,178,933,300
第49回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,861,675,200
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,202,647,900
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,833,192,000
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,612,811,200
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,201,524,800

第54回利付国債(30年)	1,810,000,000	2,034,476,200	
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,170,072,800	
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,417,071,600	
第57回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,528,952,800	
第58回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,629,452,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	186,498,500	
第60回利付国債(30年)	2,530,000,000	2,915,167,200	
第61回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,426,282,000	
第62回利付国債(30年)	650,000,000	676,942,500	
第63回利付国債(30年)	900,000,000	910,881,000	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	134,472,000	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	144,985,400	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	227,185,200	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	103,995,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	115,284,400	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	84,336,000	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	211,288,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	148,117,200	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	159,627,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	254,745,600	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	320,208,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	213,382,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	369,999,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	251,452,800	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	334,048,000	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	216,278,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	348,985,600	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	241,144,200	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	360,303,900	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,236,600	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	211,931,700	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	433,247,100	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	452,764,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	224,464,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	708,063,300	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	404,866,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	225,988,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	147,706,000	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	303,766,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	327,882,700	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	192,259,800	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	306,930,600	

第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,374,200
第81回利付国債(20年)	390,000,000	445,742,700
第82回利付国債(20年)	600,000,000	689,418,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	335,170,400
第84回利付国債(20年)	470,000,000	540,218,000
第85回利付国債(20年)	290,000,000	336,890,100
第86回利付国債(20年)	210,000,000	246,733,200
第87回利付国債(20年)	550,000,000	642,565,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	496,398,000
第89回利付国債(20年)	350,000,000	411,257,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	744,237,900
第91回利付国債(20年)	450,000,000	534,811,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,038,910,400
第93回利付国債(20年)	410,000,000	483,488,400
第94回利付国債(20年)	610,000,000	724,009,000
第95回利付国債(20年)	610,000,000	737,050,800
第96回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,812,508,800
第97回利付国債(20年)	400,000,000	482,636,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	527,296,000
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,384,324,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	584,232,000
第101回利付国債(20年)	715,000,000	882,302,850
第102回利付国債(20年)	410,000,000	508,186,800
第103回利付国債(20年)	400,000,000	492,216,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	436,561,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,436,414,000
第106回利付国債(20年)	380,000,000	466,066,200
第107回利付国債(20年)	260,000,000	317,506,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	793,531,200
第109回利付国債(20年)	520,000,000	627,172,000
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,164,187,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,201,897,900
第112回利付国債(20年)	790,000,000	971,028,500
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,788,343,000
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,883,048,800
第115回利付国債(20年)	700,000,000	873,439,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,326,971,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,340,506,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	815,014,200
第119回利付国債(20年)	530,000,000	642,927,100
第120回利付国債(20年)	790,000,000	941,103,300
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,840,905,000
第122回利付国債(20年)	440,000,000	535,097,200

第123回利付国債(20年)	1,110,000,000	1,391,817,900	
第124回利付国債(20年)	610,000,000	757,925,000	
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,041,162,200	
第126回利付国債(20年)	730,000,000	909,915,800	
第127回利付国債(20年)	990,000,000	1,222,481,700	
第128回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,560,636,000	
第129回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,656,085,500	
第130回利付国債(20年)	1,115,000,000	1,371,650,700	
第131回利付国債(20年)	870,000,000	1,059,712,200	
第132回利付国債(20年)	840,000,000	1,025,766,000	
第133回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,467,876,900	
第134回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,298,545,500	
第135回利付国債(20年)	590,000,000	722,230,800	
第136回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,780,949,100	
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,374,374,400	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	744,905,200	
第139回利付国債(20年)	550,000,000	667,859,500	
第140回利付国債(20年)	1,840,000,000	2,263,292,000	
第141回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,971,216,700	
第142回利付国債(20年)	520,000,000	648,013,600	
第143回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,380,893,900	
第144回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,776,480,300	
第145回利付国債(20年)	2,455,000,000	3,040,001,950	
第146回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,605,995,000	
第147回利付国債(20年)	2,450,000,000	3,011,662,500	
第148回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,409,620,400	
第149回利付国債(20年)	2,540,000,000	3,096,183,800	
第150回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,737,529,200	
第151回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,689,353,750	
第152回利付国債(20年)	2,910,000,000	3,431,472,000	
第153回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,858,129,300	
第154回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,338,894,800	
第155回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,484,129,600	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	2,063,605,600	
第157回利付国債(20年)	2,910,000,000	2,965,144,500	
第158回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,359,462,300	
第159回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,243,300,400	
第160回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,563,372,800	
第161回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,894,077,500	
第162回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,217,239,000	
第163回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,606,945,200	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,891,926,400	

	第165回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,741,335,600
	第166回利付国債（20年）	900,000,000	988,560,000
	第167回利付国債（20年）	2,110,000,000	2,237,486,200
	第168回利付国債（20年）	1,210,000,000	1,258,871,900
	第169回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,091,325,100
	国債証券合計	410,660,000,000	455,999,926,450
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,071,000
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,809,000
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	140,225,000
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	137,953,000
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	133,595,000
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	132,530,000
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,792,000
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,193,000
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	241,182,000
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	239,644,000
	第695回東京都公募公債	100,000,000	101,751,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	102,033,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	101,994,000
	第702回東京都公募公債	200,000,000	204,576,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	102,446,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,172,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	103,219,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,727,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	102,168,000
	第764回東京都公募公債	150,000,000	151,944,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,296,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	101,108,000
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,198,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,676,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,149,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,163,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	300,000,000	303,852,000
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	143,930,000
	第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	120,012,000
	第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	118,282,000
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,550,000
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,049,000
	第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,218,000
	第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,069,000
	第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	240,646,000
	第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,553,000

第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,161,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,495,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,055,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,248,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,630,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,482,060	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,004,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,906,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,561,600	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,536,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	121,299,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	120,111,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,156,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,039,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	107,697,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,185,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,546,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,985,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	209,502,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,842,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,163,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,380,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	106,442,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	126,845,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	110,333,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,314,484	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,106,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,342,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,146,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,300,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,381,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,586,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,166,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,998,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,160,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,216,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,022,000	

平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,239,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,402,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,214,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,792,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	322,137,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	109,142,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,518,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,527,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,735,187	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,120,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	118,307,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	113,409,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	240,046,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	204,618,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,668,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	196,456,630	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,672,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,791,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,914,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,759,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,279,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,500,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,148,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,447,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,425,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,122,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	121,955,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	204,096,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,402,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	137,498,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,542,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,760,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	109,142,000	
	100,000,000	107,792,000	

平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)			
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	121,019,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	119,600,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	121,380,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,258,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,212,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,948,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,278,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,142,400	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,362,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,632,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,791,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	363,639,760	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,938,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,051,000	
第107回共同発行市場公募地方債	800,000,000	819,240,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,481,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,669,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,331,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,337,000	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,408,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,289,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,406,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,180,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,748,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,721,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,528,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,805,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,909,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,728,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,531,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,226,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,942,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,242,256	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,890,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,387,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,261,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,603,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,134,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,685,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,035,000	

第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,982,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,471,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,220,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,906,861	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,399,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,585,000	
平成23年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	102,062,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	204,850,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,158,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	102,231,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,231,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,454,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	241,932,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	308,103,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	107,990,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	136,011,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	142,470,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	118,609,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	131,924,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	102,362,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,411,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,354,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,417,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,824,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	300,000,000	303,168,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	140,155,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	240,480,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	121,841,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,284,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,565,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,331,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	101,018,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,170,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,363,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	204,386,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	110,637,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,543,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,166,000	

	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	118,809,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,827,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,278,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,875,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	200,586,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,355,750	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	120,791,000	
	平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	102,062,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,348,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	102,203,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	102,008,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,389,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,305,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,984,900	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,774,400	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	204,528,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,328,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,130,000	
	地方債証券合計	27,134,220,000	28,757,304,488	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,183,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,451,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,339,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,721,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,052,000	
	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	102,732,000	
	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	205,760,000	
	第14回道路債券	100,000,000	106,102,000	
	第17回道路債券	100,000,000	104,910,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	463,904,000	
	第21回道路債券	100,000,000	135,604,000	
	第28回道路債券	200,000,000	276,560,000	
	第33回道路債券	200,000,000	280,822,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,523,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	162,547,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,381,000	

第42回道路債券	100,000,000	111,686,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,156,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,265,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,830,000	
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	154,218,000	
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	241,622,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,330,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,448,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,568,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,488,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,890,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,086,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,908,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,651,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,588,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,118,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,087,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,272,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,477,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	141,361,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	307,579,860	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	232,866,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,994,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,557,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,441,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,491,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,853,000	

第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,911,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,763,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,910,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	641,904,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,164,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,104,000	
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	206,920,000	
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	152,983,160	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,062,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,083,000	
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	239,324,000	
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	105,318,060	
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	103,247,000	
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	103,092,000	
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	102,860,000	
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	102,547,000	
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	305,403,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,739,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	233,356,000	
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	204,242,000	
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	101,025,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,228,000	
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	107,153,010	
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	318,287,840	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,949,550	
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	101,194,000	
	300,000,000	303,507,000	

第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	101,340,000	
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	529,193,600	
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	202,778,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	323,019,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,950,440	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,619,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	396,033,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	311,013,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	113,900,600	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	110,298,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	414,255,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,794,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	138,525,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,007,600	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	136,251,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	241,678,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,496,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	116,690,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	242,066,000	
第21回地方公共団体金融機構債券（5年）	400,000,000	399,996,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,957,380	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,086,660	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,217,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	120,545,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,129,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,342,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,650,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,483,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,892,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,071,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,342,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,392,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,146,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,272,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,569,000	
F73回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,142,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,664,000	

第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,440,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,225,000	
第87回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,551,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,174,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,721,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,948,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	253,919,130	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,357,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,331,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,934,900	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,098,160	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,837,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,610,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,075,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,198,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,138,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,551,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	111,438,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,022,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	123,522,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,283,500	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,359,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,745,100	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,231,360	
第127回都市再生債券	400,000,000	400,692,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	184,488,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,240,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	105,467,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,790,400	
第59回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	511,610,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,122,000	14,722,326	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,518,000	15,219,219	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,883,000	15,743,088	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	248,196,000	249,355,075	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	174,066,000	174,757,042	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,720,000	15,498,835	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,796,000	16,683,893	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,819,000	13,179,854	

第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	26,546,000	27,686,416	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,454,000	16,244,008	
第 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,432,000	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	13,977,000	14,631,263	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,332,000	17,345,237	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	13,918,000	14,595,389	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,120,000	17,060,279	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,101,000	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,619,000	14,910,210	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,964,000	15,257,892	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,444,000	23,198,976	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,861,000	23,707,817	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,383,000	26,652,569	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,036,000	29,257,818	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,157,000	31,671,499	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,231,000	32,755,590	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,082,000	69,450,149	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,336,000	14,910,586	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,964,000	34,158,328	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,367,000	14,970,126	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,169,000	14,898,136	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,986,000	37,536,479	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,159,000	13,758,260	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,556,000	37,101,049	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,472,000	34,811,932	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,160,000	16,095,675	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,030,000	69,373,353	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,372,000	37,774,466	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,748,000	15,492,331	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,449,000	49,570,372	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,234,000	47,176,888	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,204,000	47,192,632	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,296,000	100,414,867	
第 6 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,601,000	
第 6 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,635,000	
第 6 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,049,000	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,214,000	106,879,959	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,433,000	54,199,581	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,311,000	54,540,001	

第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,356,000	55,724,061	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,978,000	48,647,482	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,929,000	48,180,439	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,832,000	55,037,809	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	183,891,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	140,076,000	147,159,643	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,112,000	199,788,700	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,272,000	55,830,654	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,659,000	57,334,011	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,638,000	58,211,813	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,280,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,059,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,296,000	122,644,697	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,986,000	62,493,414	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,914,000	129,522,077	
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	409,328,000	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,841,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,510,000	73,355,078	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,254,000	77,054,118	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,486,000	76,622,382	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	225,405,000	236,625,660	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,762,000	157,624,686	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,038,000	77,236,441	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,693,000	82,296,352	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,022,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,744,000	89,229,505	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,941,000	89,242,526	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,889,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,117,000	89,810,608	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,573,000	90,682,808	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,130,000	91,240,598	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,613,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,055,000	92,781,402	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,614,000	93,469,183	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,628,000	93,357,020	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,005,000	93,805,537	

第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,521,000	94,525,004	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,082,000	189,846,438	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,737,000	94,746,610	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,156,000	191,731,964	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,614,000	95,639,806	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,324,000	192,109,312	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,826,000	97,015,532	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,470,000	195,619,154	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,816,000	195,872,908	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	137,151,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,503,000	98,872,148	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,012,000	99,614,831	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,261,000	99,254,850	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,046,000	199,094,515	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,421,000	99,916,999	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,670,000	100,349,363	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,366,000	201,434,722	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,426,000	100,080,223	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,222,000	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,040,000	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,969,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,649,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,238,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,502,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,175,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,073,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,350,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,714,000	
い第795号商工債	200,000,000	200,056,000	
い第800号商工債	200,000,000	200,116,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,086,000	

	い第795号農林債	100,000,000	99,971,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,938,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,122,000	
	第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,275,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,289,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,608,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,329,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,261,000	
	第218号商工債（3年）	300,000,000	300,462,000	
	第221号商工債（3年）	200,000,000	200,328,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,592,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	122,008,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,049,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,238,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,664,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,977,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,806,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,052,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,680,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,068,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,656,000	
	特殊債券合計	35,134,958,000	37,353,125,858	
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	100,137,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	101,000,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,491,000	
	第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,872,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,741,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,656,000	
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,034,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	400,428,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,220,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,519,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,668,000	

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	200,000,000	210,338,000	
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	300,000,000	300,876,000	
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	403,564,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,273,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,707,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,380,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,234,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,428,000	
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,597,000	
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	102,633,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,705,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,928,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,659,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,579,000	
第7回J・フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,358,000	
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	103,321,000	
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	100,211,000	
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	100,210,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,023,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,660,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,954,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,937,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,579,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,669,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	101,388,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,872,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,888,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	100,137,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,383,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,598,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,167,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,389,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,215,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,773,000	

第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,256,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,612,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,320,000	
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	101,127,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,211,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,734,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,448,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,552,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,807,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,036,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	101,251,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,709,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,279,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,325,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,289,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,183,000	
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	100,265,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	200,458,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,309,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	200,664,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,073,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,551,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,583,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,105,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,329,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,804,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,072,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,455,000	
第11回株式会社りそなホールディングス無担保社債	700,000,000	699,692,000	
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	123,818,000	
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	101,329,000	
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	102,530,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,749,000	
	100,000,000	102,504,000	

第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債			
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	102,589,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,877,000	
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	308,226,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,257,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,349,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,040,000	
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	100,655,000	
第66回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	303,381,000	
第73回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	301,905,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,485,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,414,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,625,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,568,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,157,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,186,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	203,028,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	102,178,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,747,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,108,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	202,038,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,560,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,524,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,553,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,219,000	
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	103,818,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,321,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,812,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,992,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,734,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,897,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,174,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,575,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,336,000	

第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,640,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,762,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,468,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,655,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,055,450	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,282,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,863,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,166,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,125,600	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	136,916,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	132,592,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,809,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	114,934,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	100,277,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,766,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,654,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,474,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,079,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,800,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,671,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,218,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,494,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,939,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,370,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,762,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,563,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,325,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,194,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,964,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,270,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,722,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,052,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,670,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,788,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,363,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,607,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,596,920	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,583,000	

第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,278,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,695,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,458,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,133,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,580,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,596,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,031,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,136,250	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,399,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,435,000	
第344回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,534,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,170,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,695,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,772,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,668,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,954,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,214,000	
第6回S C S K株式会社無担保社債	100,000,000	100,067,000	
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	101,329,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担 保社債	200,000,000	203,342,000	
社債券合計	21,266,000,000	21,838,100,220	
合計		543,948,457,016	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	12,433,338,439

	2019年 9月30日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	968,735,405
株式	346,637,742,420
投資信託受益証券	283,101,700
投資証券	9,935,351,089
派生商品評価勘定	20,747,737
未収入金	3,836,770
未収配当金	418,923,660
前払金	72,053,553
差入委託証拠金	2,200,144,557
流動資産合計	372,973,975,330
資産合計	372,973,975,330
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,007,404
未払金	9,997,492,424
未払解約金	289,433,038
未払利息	2,353
その他未払費用	352
流動負債合計	10,378,935,571
負債合計	10,378,935,571
純資産の部	
元本等	
元本	139,822,058,208
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	222,772,981,551
元本等合計	362,595,039,759
純資産合計	362,595,039,759
負債純資産合計	372,973,975,330

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 9月30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>

2019年 9月30日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	139,822,058,208口

	2019年 9月30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)	2,5933円 (25,933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

	2019年 9月30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

	2019年 9月30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。

	2019年 9月30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	2019年 9月30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	20,798,064,751円
期中一部解約元本額	17,854,566,082円
期末元本額	139,822,058,208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）	2,463,346,569円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,337,017円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,190,008,339円
世界経済インデックスファンド	7,643,857,676円
外国株式インデックス・オープン	885,688,663円

区分	2019年 9月30日現在
DCマイセレクション25	1,103,978,412円
DCマイセレクション50	4,863,364,368円
DCマイセレクション75	5,072,966,710円
DC外国株式インデックス・オープン	8,704,190,039円
DCマイセレクションS25	442,140,212円
DCマイセレクションS50	1,985,531,442円
DCマイセレクションS75	1,453,200,945円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	108,939,927円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	191,759,283円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	125,955,097円
DC世界経済インデックスファンド	6,679,736,359円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,946,173,151円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,002,227円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	10,520,085円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	40,509,990円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	45,596,504円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	186,871,601円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	35,770,052円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	271,756,666円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	692,866,376円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	361,511,372円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,363,781,500円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,878,792,627円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	80,253,100円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	340,396,449円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	8,512,307円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	120,406,335円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,813,942,198円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,090,715,977円
外国株式ファンド・シリーズ1	875,218,609円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,409,544,325円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,348,263,137円
分散投資コア戦略ファンドA	2,346,017,482円
分散投資コア戦略ファンドS	5,021,477,738円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	939,046,694円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,044,611,883円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,701,369,457円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	812,279,014円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,130,347円
SMT インデックスバランス・オープン	270,943,885円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,614,096,362円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	33,032,752,400円
SMT 世界経済インデックス・オープン	85,673,583円

区分	2019年 9月30日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	339,543,537円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	51,859,538円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,482,667円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	46,685,046円
グローバル経済コア	1,057,909,136円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,162,731円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	455,684円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	384,207,146円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	77,515,965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)	1,304,954,889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)	394,918,920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)	371,048,605円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	18,228,684円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,878,422,075
投資信託受益証券	23,922,094
投資証券	576,905,815
合計	15,479,249,984

(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

(2019年 9月30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	9,979,183,668	-	9,907,130,115	72,053,553
合計		9,979,183,668	-	9,907,130,115	72,053,553

(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 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,920,742,284	-	4,921,536,170	793,886
	アメリカドル	3,400,944,400	-	3,401,370,430	426,030
	カナダドル	178,142,782	-	178,196,760	53,978
	ユーロ	544,716,675	-	544,898,340	181,665
	イギリスポンド	273,333,200	-	273,320,800	12,400
	スイスフラン	188,975,268	-	189,124,560	149,292
	スウェーデンクローナ	49,364,414	-	49,347,560	16,854
	ノルウェークローネ	11,835,468	-	11,822,520	12,948
	デンマーククローネ	37,862,640	-	37,896,570	33,930
	オーストラリアドル	155,385,208	-	155,431,710	46,502
	香港ドル	56,289,443	-	56,237,500	51,943
	シンガポールドル	23,892,786	-	23,889,420	3,366
	合計		4,920,742,284	-	4,921,536,170

(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	APACHE CORP	34,273	25.70	880,816.10	

BAKER HUGHES A GE CO	57,644	24.04	1,385,761.76
CABOT OIL & GAS CORP	35,879	17.53	628,958.87
CHENIERE ENERGY INC	19,927	63.14	1,258,190.78
CHEVRON CORP	167,394	118.60	19,852,928.40
CIMAREX ENERGY CO	7,599	47.86	363,688.14
CONCHO RESOURCES INC	17,481	68.80	1,202,692.80
CONOCOPHILLIPS	100,011	57.90	5,790,636.90
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	30.58	233,845.26
DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	24.25	918,129.25
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	89.99	1,213,695.13
EOG RESOURCES INC	51,609	74.98	3,869,642.82
EXXON MOBIL	371,576	71.48	26,560,252.48
HALLIBURTON CO	76,620	18.73	1,435,092.60
HELMERICH & PAYNE	8,315	40.57	337,339.55
HESS CORP	24,844	60.13	1,493,869.72
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	53.58	756,013.80
KINDER MORGAN INC	181,360	20.67	3,748,711.20
MARATHON OIL CORP	74,537	12.20	909,351.40
MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	62.42	3,602,882.40
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	22.04	668,054.44
NOBLE ENERGY INC	38,291	22.46	860,015.86
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,592	45.14	3,457,362.88
ONEOK INC	36,957	73.30	2,708,948.10
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	17.02	348,484.50
PHILLIPS 66	40,336	103.66	4,181,229.76
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	126.32	1,825,955.60
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	17,841	21.47	383,046.27
SCHLUMBERGER	123,022	34.33	4,223,345.26
TARGA RESOURCES CORP	20,002	39.75	795,079.50
TECHNIPFMC PLC	36,005	24.18	870,600.90
VALERO ENERGY CORP	37,256	84.44	3,145,896.64
WILLIAMS COS	103,730	24.20	2,510,266.00
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,553	221.06	4,322,386.18
ALBEMARLE CORP	8,647	68.14	589,206.58
AMCOR PLC	138,214	9.73	1,344,822.22
AVERY DENNISON CORP	7,457	112.82	841,298.74
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	30.22	532,053.32
BALL CORP	27,142	72.79	1,975,666.18
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	122.14	1,350,013.42
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	48.65	927,804.15
CORTEVA INC	64,411	27.80	1,790,625.80
CROWN HOLDINGS INC	11,700	66.01	772,317.00

DOW INC	65,790	47.07	3,096,735.30
DUPONT DE NEMOURS INC	66,679	70.25	4,684,199.75
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	73.29	869,072.82
ECOLAB INC	23,026	197.79	4,554,312.54
FMC CORP	12,118	86.13	1,043,723.34
FREEMONT-MCMORAN INC	124,849	9.65	1,204,792.85
INT'L PAPER CO	33,803	41.66	1,408,232.98
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	120.81	1,047,905.94
LINDE PLC	47,863	191.55	9,168,157.65
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,007	88.70	2,040,720.90
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,367	270.72	1,452,954.24
MOSAIC CO/THE	31,911	20.26	646,516.86
NEWMONT GOLDCORP CORP	73,290	38.40	2,814,336.00
NUCOR CORP	26,204	50.01	1,310,462.04
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	105.60	938,784.00
PPG INDUSTRIES INC	19,958	118.22	2,359,434.76
SEALED AIR CORP	14,689	41.37	607,683.93
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,387	544.28	4,020,596.36
STEEL DYNAMICS INC	18,273	29.38	536,860.74
VULCAN MATERIALS CO	11,960	149.04	1,782,518.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	65.44	226,095.20
WESTROCK CO	21,244	36.48	774,981.12
3 M COMPANY	50,865	164.53	8,368,818.45
ACUITY BRANDS INC	3,505	132.29	463,676.45
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	55.44	628,135.20
ALLEGION PLC	7,435	102.50	762,087.50
AMETEK INC	19,001	91.37	1,736,121.37
ARCONIC INC	36,550	26.11	954,320.50
BOEING CO	46,987	382.86	17,989,442.82
CATERPILLAR	50,571	126.59	6,401,782.89
CUMMINS INC	12,585	161.30	2,029,960.50
DEERE&CO	26,740	166.26	4,445,792.40
DOVER CORP	12,008	100.13	1,202,361.04
EATON CORP	36,194	83.01	3,004,463.94
EMERSON ELECTRIC CO	52,562	66.40	3,490,116.80
FASTENAL CO	51,959	32.23	1,674,638.57
FLOWSERVE CORP	10,826	46.84	507,089.84
FLUOR CORP	11,267	18.56	209,115.52
FORTIVE CORP	25,813	68.60	1,770,771.80
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	54.48	697,888.80
GENERAL DYNAMICS CORP	21,828	183.02	3,994,960.56
GENERAL ELECTRIC CO	770,523	9.04	6,965,527.92

GRAINGER (WW) INC	3,976	294.99	1,172,880.24
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	38.71	589,474.59
HEICO CORP	3,640	124.74	454,053.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	97.44	628,390.56
HONEYWELL INTL INC	64,118	168.04	10,774,388.72
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	213.39	751,559.58
IDEX CORP	6,916	164.54	1,137,958.64
ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	154.94	4,342,658.32
INGERSOLL-RAND PLC	21,603	123.56	2,669,266.68
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	90.69	1,090,637.94
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	53.65	1,078,365.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	30.71	629,555.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	68,082	43.67	2,973,140.94
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,659	208.92	4,107,158.28
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	241.58	696,958.30
LOCKHEED MARTIN CORP	22,452	387.87	8,708,457.24
MASCO CORP	24,547	41.68	1,023,118.96
MIDDLEBY CORP	4,364	116.40	507,969.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,290	371.18	5,304,162.20
OWENS CORNING	10,458	62.54	654,043.32
PACCAR INC	30,075	69.01	2,075,475.75
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	180.46	2,046,416.40
PENTAIR PLC	13,583	37.66	511,535.78
RAYTHEON COMPANY	24,818	195.52	4,852,415.36
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	166.25	1,747,453.75
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,262	354.63	3,284,583.06
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	49.40	683,103.20
SMITH (A.O.) CORP	12,146	47.66	578,878.36
SNAP-ON INC	4,900	155.34	761,166.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	82.35	698,410.35
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	143.09	1,893,653.06
TEXTRON	21,534	49.20	1,059,472.80
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	518.19	2,110,069.68
UNITED RENTALS INC	6,446	124.79	804,396.34
UNITED TECHNOLOGIES CORP	72,207	136.39	9,848,312.73
WABCO HOLDINGS INC	3,841	134.21	515,500.61
WABTEC CORP	15,679	72.00	1,128,888.00
XYLEM INC	16,060	80.13	1,286,887.80
CINTAS CORP	7,616	266.13	2,026,846.08
COPART INC	17,540	79.71	1,398,113.40
COSTAR GROUP INC	3,300	576.28	1,901,724.00
EQUIFAX INC	10,799	141.31	1,526,006.69

IHS MARKIT LTD	32,775	65.68	2,152,662.00
MANPOWER GROUP	5,123	83.00	425,209.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	21.05	578,959.20
REPUBLIC SERVICES INC	20,400	86.22	1,758,888.00
ROBERT HALF INTL INC	9,566	54.62	522,494.92
ROLLINS INC	10,546	33.44	352,658.24
TRANSUNION	15,344	79.38	1,218,006.72
VERISK ANALYTICS INC	13,480	155.59	2,097,353.20
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	90.45	2,081,073.60
WASTE MANAGEMENT INC	37,723	113.59	4,284,955.57
AMERCO	602	392.90	236,525.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	27.01	267,939.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	83.79	959,227.92
CSX CORP	68,203	68.91	4,699,868.73
DELTA AIR LINES INC	15,095	58.28	879,736.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	73.29	1,162,965.72
FEDEX CORP	21,165	144.96	3,068,078.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	111.04	792,159.36
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	132.52	1,158,622.36
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	35.88	383,916.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,624	180.87	4,272,872.88
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	172.06	902,454.70
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	54.34	623,008.10
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	30.29	477,037.21
UNION PACIFIC CORP	62,381	162.69	10,148,764.89
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	88.14	529,104.42
UNITED PARCEL SERVICE B	61,610	118.95	7,328,509.50
XPO LOGISTICS INC	8,001	70.54	564,390.54
APTIV PLC	22,107	86.88	1,920,656.16
AUTOLIV INC	6,639	77.92	517,310.88
BORGWARNER INC	15,953	36.39	580,529.67
FORD MOTOR COMPANY	335,147	9.08	3,043,134.76
GENERAL MOTORS CO	113,426	37.42	4,244,400.92
HARLEY-DAVIDSON	14,677	35.71	524,115.67
LEAR CORP	5,287	117.99	623,813.13
TESLA INC	11,730	242.13	2,840,184.90
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	32.62	376,663.14
DR HORTON INC	32,171	52.14	1,677,395.94
GARMIN LTD	11,464	84.81	972,261.84
HANESBRANDS INC	31,136	15.11	470,464.96
HASBRO INC	10,617	118.82	1,261,511.94
LEGGETT & PLATT INC	10,594	40.92	433,506.48

LENNAR CORP-CL A	23,545	54.72	1,288,382.40
LULULEMON ATHLETICA INC	9,496	189.72	1,801,581.12
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	123.58	625,561.96
NEWELL BRANDS INC	37,563	18.20	683,646.60
NIKE B	110,763	92.31	10,224,532.53
NVR INC	294	3,626.69	1,066,246.86
POLARIS INC	4,691	86.66	406,522.06
PULTE GROUP INC	21,959	35.92	788,767.28
PVH CORP	7,252	87.72	636,145.44
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	94.24	431,430.72
ROKU INC	7,065	99.74	704,663.10
TAPESTRY INC	25,989	25.99	675,454.11
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	19.57	312,141.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	17.79	289,674.57
VF CORP	28,754	88.79	2,553,067.66
WHIRLPOOL CORP	5,324	155.50	827,882.00
ARAMARK	19,980	43.02	859,539.60
BLOCK H & R INC	16,984	23.33	396,236.72
CARNIVAL CORPORATION	35,126	43.58	1,530,791.08
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,257	818.83	1,848,099.31
DARDEN RESTAURANTS INC	11,266	116.36	1,310,911.76
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	240.46	830,308.38
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	91.45	2,151,178.35
LAS VEGAS SANDS CORP	31,490	57.11	1,798,393.90
MARRIOTT INTL A	25,274	120.77	3,052,340.98
MCDONALD'S CORP	67,182	213.16	14,320,515.12
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	19.15	338,227.30
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	27.27	1,217,769.12
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	51.02	910,094.76
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	107.03	1,636,595.73
STARBUCKS CORP	106,777	88.37	9,435,883.49
VAIL RESORTS INC	3,574	236.98	846,966.52
WYNN RESORTS LTD	8,052	108.24	871,588.74
YUM BRANDS INC	26,166	112.99	2,956,496.34
ACTIVISION BLIZZARD INC	68,180	52.33	3,567,859.40
ALPHABET INC-CL A	26,286	1,225.95	32,225,321.70
ALPHABET INC-CL C	27,512	1,225.09	33,704,676.08
ALTICE USA INC- A	12,457	28.60	356,270.20
CBS CORP-CL B	28,628	40.32	1,154,280.96
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	406.21	5,537,454.72
COMCAST CORP-CL A	398,164	44.81	17,841,728.84
DISCOVERY INC - A	12,804	26.80	343,147.20

DISCOVERY INC-C	31,156	24.71	769,864.76
DISH NETWORK CORPORATION-A	22,866	34.00	777,558.33
ELECTRONIC ARTS INC	25,447	95.67	2,434,514.49
FACEBOOK INC-A	210,848	177.10	37,341,180.80
FOX CORP - CLASS A	30,270	31.44	951,688.80
FOX CORP- CLASS B	15,092	31.48	475,096.16
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	220.08	1,479,157.68
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	21.41	724,385.94
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	103.36	895,407.68
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	24.70	383,322.78
LIBERTY GLOBAL PLC-C	34,106	23.84	813,087.04
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	40.81	762,861.33
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	41.85	637,501.05
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	41.37	264,106.08
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	66.34	838,338.58
NETFLIX INC	38,532	263.08	10,136,998.56
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.86	464,018.94
OMNICOM GROUP	19,030	77.78	1,480,153.40
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.20	803,578.52
SNAP INC - A	57,914	16.02	927,782.28
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	123.97	1,184,161.44
THE WALT DISNEY CO	158,140	129.96	20,551,874.40
TRIPADVISOR INC	10,393	38.43	399,402.99
TWITTER INC	65,352	41.35	2,702,305.20
VIACOM INC-CLASS B	31,895	23.98	764,842.10
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	29.53	294,177.86
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	161.68	1,000,152.48
AMAZON.COM	36,704	1,725.45	63,330,916.80
AUTOZONE INC	2,085	1,085.65	2,263,580.25
BEST BUY COMPANY INC	20,711	68.27	1,413,939.97
BOOKING HOLDINGS INC	3,823	1,944.25	7,432,867.75
BURLINGTON STORES INC	6,004	199.09	1,195,336.36
CARMAX INC	14,253	87.48	1,246,852.44
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	160.02	3,573,246.60
DOLLAR TREE INC	21,332	114.30	2,438,247.60
EBAY	71,876	38.37	2,757,882.12
EXPEDIA GROUP INC	12,028	132.17	1,589,740.76
GAP	21,891	17.18	376,087.38
GENUINE PARTS CO	12,722	98.93	1,258,587.46
GRUBHUB INC	8,261	55.86	461,459.46
HOME DEPOT	96,670	229.86	22,220,566.20
KOHL'S CORP	14,645	49.64	726,977.80

L BRANDS INC	19,499	18.94	369,311.06
LKQ CORP	29,351	31.33	919,566.83
LOWES COMPANIES	70,188	109.54	7,688,393.52
MACY'S INC	25,926	15.29	396,408.54
MERCADOLIBRE INC	3,995	541.52	2,163,372.40
NORDSTROM INC	10,094	32.89	331,991.66
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,699	394.48	2,642,621.52
QURATE RETAIL INC	35,071	10.24	359,127.04
ROSS STORES INC	31,827	109.05	3,470,734.35
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,436	106.12	4,821,668.32
TIFFANY & CO	9,326	91.88	856,872.88
TJX COMPANIES INC	107,309	54.83	5,883,752.47
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	89.01	997,980.12
ULTA BEAUTY INC	4,911	244.40	1,200,248.40
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	114.04	607,491.08
COSTCO WHOLESALE CORP	38,741	285.95	11,077,988.95
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	6.40	216,960.00
KROGER CO	68,147	25.74	1,754,103.78
SYSCO CORP	41,755	78.87	3,293,216.85
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	54.41	3,667,614.87
WALMART INC	126,110	118.45	14,937,729.50
ALTRIA GROUP INC	165,376	40.13	6,636,538.88
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	40.94	1,956,850.12
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,439	62.67	1,656,932.13
BUNGE LIMITED	11,767	56.54	665,306.18
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	46.87	659,554.64
COCA-COLA CO	356,211	54.31	19,345,819.41
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,270	55.04	1,115,660.80
CONAGRA BRANDS INC	39,943	30.28	1,209,474.04
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,937	206.00	3,077,022.00
GENERAL MILLS INC	53,542	54.87	2,937,849.54
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	153.78	1,925,479.38
HORMEL FOODS CORP	27,157	43.54	1,182,415.78
INGREDION INC	5,835	80.49	469,659.15
JM SMUCKER CO	9,442	109.04	1,029,555.68
KELLOGG CO	21,051	64.10	1,349,369.10
KRAFT HEINZ CO/THE	57,581	27.84	1,603,055.04
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	73.36	948,104.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,092	156.80	1,739,225.60
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	57.47	867,797.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	127,274	55.39	7,049,706.86
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	57.81	2,019,418.92

PEPSICO INC	123,268	135.60	16,715,140.80
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	137,103	75.13	10,300,548.39
TYSON FOODS INC	26,508	85.20	2,258,481.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	75.66	1,608,834.24
CLOROX COMPANY	10,995	152.68	1,678,716.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	72,272	73.26	5,294,646.72
COTY INC-CL A	30,534	10.53	321,523.02
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,514	196.33	3,831,183.62
KIMBERLY-CLARK CORP	30,548	142.06	4,339,648.88
PROCTER & GAMBLE CO	220,272	124.57	27,439,283.04
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	642	52.60	33,769.20
ABBOTT LABORATORIES	155,594	81.84	12,733,812.96
ABIOMED INC	3,502	175.89	615,966.78
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	175.84	1,101,461.76
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	80.94	1,039,836.18
ANTHEM INC	22,819	237.69	5,423,848.11
BAXTER INTERNATIONAL	43,221	85.93	3,713,980.53
BECTON DICKINSON & CO	23,911	248.03	5,930,645.33
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,474	40.31	4,977,236.94
CARDINAL HEALTH	25,252	47.57	1,201,237.64
CENTENE CORP	35,914	43.17	1,550,407.38
CERNER CORP	27,944	68.37	1,910,531.28
CIGNA CORP	33,690	149.48	5,035,981.20
CVS HEALTH CORP	114,987	62.08	7,138,392.96
DANAHER CORP	56,976	141.56	8,065,522.56
DAVITA INC	9,056	56.32	510,033.92
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	52.88	1,067,541.44
DEXCOM INC	7,827	148.51	1,162,387.77
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,568	217.29	4,034,640.72
HCA HEALTHCARE INC	24,531	118.96	2,918,207.76
HENRY SCHEIN INC	12,492	62.58	781,749.36
HOLOGIC INC	24,459	49.61	1,213,410.99
HUMANA INC	11,566	257.59	2,979,285.94
IDEXX LABORATORIES INC	7,763	272.48	2,115,262.24
INTUITIVE SURGICAL INC	10,243	533.73	5,466,996.39
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	165.43	1,460,250.61
MCKESSON CORP	16,655	135.53	2,257,252.15
MEDTRONIC PLC	118,252	107.32	12,690,804.64
QUEST DIAGNOSTICS	11,580	105.49	1,221,574.20
RESMED INC	12,398	133.60	1,656,372.80
STERIS PLC	7,229	141.78	1,024,927.62
STRYKER CORP	28,773	213.61	6,146,200.53

TELEFLEX INC	3,971	335.62	1,332,747.02
THE COOPER COS INC	4,135	294.25	1,216,723.75
UNITEDHEALTH GROUP INC	83,701	215.26	18,017,477.26
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	146.83	1,064,223.84
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	118.16	973,283.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,982	149.58	1,642,687.56
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	259.29	1,141,653.87
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,404	134.13	2,468,528.52
ABBVIE INC	130,602	74.85	9,775,559.70
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	76.39	2,092,092.93
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	97.77	1,862,322.96
ALKERMES PLC	12,547	19.63	246,297.61
ALLERGAN PLC	27,804	168.25	4,678,023.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,585	81.10	777,343.50
AMGEN	53,848	194.94	10,497,129.12
BEIGENE LTD-ADR	3,149	121.59	382,886.91
BIOGEN INC	17,270	230.22	3,975,899.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	68.31	1,106,075.52
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	144,780	50.22	7,270,851.60
CELGENE CORP	62,510	98.85	6,179,113.50
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,661	26.40	809,450.40
EXACT SCIENCES CORP	10,748	92.00	988,816.00
GILEAD SCIENCES INC	112,546	62.90	7,079,143.40
ILLUMINA INC	13,100	301.28	3,946,768.00
INCYTE CORP	16,120	72.82	1,173,858.40
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	59.06	663,598.16
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	148.25	2,113,303.75
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	127.26	632,609.46
JOHNSON & JOHNSON	233,555	128.60	30,035,173.00
LILLY (ELI) & CO	77,235	112.37	8,678,896.95
MERCK & CO	226,750	82.91	18,799,842.50
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	699.28	1,581,072.08
MYLAN NV	42,644	19.29	822,602.76
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	17.90	241,775.30
PERKINELMER INC	9,475	85.16	806,891.00
PERRIGO CO PLC	11,333	54.98	623,088.34
PFIZER	489,061	36.22	17,713,789.42
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	273.46	1,892,616.66
SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,448	75.00	483,600.00
SEATTLE GENETICS INC	9,601	76.00	729,676.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	94,834	6.92	656,251.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35,324	287.40	10,152,117.60

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,826	166.74	3,806,007.24
WATERS CORP	6,363	222.53	1,415,958.39
ZOETIS INC	42,491	123.90	5,264,634.90
BANK OF AMERICA CORP	793,510	29.35	23,289,518.50
BB&T CORP	68,214	53.46	3,646,720.44
CIT GROUP INC	7,038	45.25	318,469.50
CITIGROUP	203,474	69.46	14,133,304.04
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	35.38	1,415,553.80
COMERICA INC	14,360	65.79	944,744.40
EAST WEST BANCORP INC	13,827	44.35	613,227.45
FIFTH THIRD BANCORP	63,013	27.48	1,731,597.24
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	97.57	1,378,273.82
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	14.35	1,229,264.05
JPMORGAN CHASE & CO	284,755	117.72	33,521,358.60
KEY CORP	87,033	17.86	1,554,409.38
M & T BANK CORP	11,742	158.19	1,857,466.98
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	15.71	577,054.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,972	140.39	5,611,669.08
REGIONS FINL CORP	83,851	15.96	1,338,261.96
SIGNATURE BANK	4,354	120.30	523,786.20
SUNTRUST BANKS	38,353	68.85	2,640,604.05
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	206.15	904,998.50
US BANCORP	133,575	55.43	7,404,062.25
WELLS FARGO & CO	375,317	50.71	19,032,325.07
ZIONS BANCORPORATION	15,186	44.36	673,650.96
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	82.94	367,673.02
ALLY FINANCIAL INC	36,028	33.55	1,208,739.40
AMERICAN EXPRESS	62,687	118.59	7,434,051.33
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	147.54	1,748,349.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	22.65	514,019.10
BANK NEW YORK CO	76,753	44.53	3,417,811.09
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	114,181	207.45	23,686,848.45
BLACKROCK INC	10,286	446.13	4,588,893.18
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,786	91.34	3,816,733.24
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	115.44	1,093,216.80
CME GROUP INC	31,640	213.89	6,767,479.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,078	81.51	2,370,147.78
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	43.26	913,237.62
EATON VANCE CORP	10,061	45.20	454,757.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	242.12	789,311.20
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	28.63	746,384.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,128	208.97	6,086,878.16

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	50,032	92.40	4,622,956.80
INVESCO LTD	30,943	17.02	526,649.86
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	17.76	456,538.56
KKR & CO INC -A	42,145	27.32	1,151,401.40
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	324.71	1,042,968.52
MOODY'S CORP	14,592	205.88	3,004,200.96
MORGAN STANLEY	111,907	42.84	4,794,095.88
MSCI INC	7,262	215.89	1,567,793.18
NASDAQ INC	9,996	100.08	1,000,399.68
NORTHERN TRUST CORP	17,320	93.13	1,613,098.20
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	113.03	2,268,059.98
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,942	83.87	917,705.54
S&P GLOBAL INC	21,802	246.35	5,370,922.70
SCHWAB (CHARLES) CORP	106,674	41.41	4,417,370.34
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	58.94	636,669.88
STATE STREET CORP	32,349	59.80	1,934,470.20
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	33.62	1,785,053.90
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	46.97	1,099,285.88
VOYA FINANCIAL INC	12,505	54.76	684,773.80
AFLAC	63,745	51.89	3,307,728.05
ALLEGHANY CORP	1,276	794.26	1,013,475.76
ALLSTATE CORP	28,490	107.83	3,072,076.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	106.99	750,320.87
AMERICAN INT'L GROUP	77,241	56.16	4,337,854.56
AON PLC	21,375	193.47	4,135,421.25
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	42.05	1,452,869.55
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,886	88.81	1,499,645.66
ASSURANT INC	4,769	125.47	598,366.43
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	42.54	567,781.38
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	40.52	422,056.32
CHUBB LTD	40,488	160.51	6,498,728.88
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,306	115.76	1,540,302.56
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	183.87	398,262.42
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	265.98	891,830.94
FNF GROUP	24,961	44.43	1,109,017.23
GLOBE LIFE INC	8,473	96.20	815,102.60
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	60.45	1,916,869.50
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	60.91	1,083,588.90
LOEWS CORP	22,051	51.51	1,135,847.01
MARKEL CORP	1,132	1,185.34	1,341,804.88
MARSH & MCLENNAN COS	43,684	99.76	4,357,915.84
METLIFE INC	72,012	47.36	3,410,488.32

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	57.37	1,328,402.35
PROGRESSIVE CORP	51,928	77.10	4,003,648.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,732	90.16	3,131,437.12
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	160.46	871,458.26
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,822	191.44	731,683.68
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	148.00	3,263,548.00
UNUM GROUP	18,574	29.60	549,790.40
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	192.70	2,106,211.00
WR BERKLEY CORP	12,637	71.72	906,325.64
CBRE GROUP INC-A	26,855	52.90	1,420,629.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.65	557,655.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	139.31	624,666.04
WEYERHAEUSER CO	69,607	27.79	1,934,378.53
ACCENTURE PLC-CL A	56,196	191.38	10,754,790.48
ADOBE INC	42,967	277.54	11,925,061.18
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	89.79	1,273,042.62
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	126.42	507,702.72
ANSYS INC	7,624	217.09	1,655,094.16
AUTODESK INC	18,836	145.19	2,734,798.84
AUTOMATIC DATA PROCESS	38,497	160.43	6,176,073.71
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	123.88	1,195,442.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,110	65.20	1,571,972.00
CDK GLOBAL INC	10,687	47.06	502,930.22
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	108.17	1,168,344.17
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	95.81	1,087,635.12
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	50,849	58.75	2,987,378.75
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	98.69	305,939.00
DOCUSIGN INC	8,693	60.64	527,143.52
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	19.77	321,203.19
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	29.78	699,770.44
EPAM SYSTEMS INC	4,620	180.36	833,263.20
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	54,206	130.68	7,083,640.08
FISERV INC	50,943	102.61	5,227,261.23
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	288.00	2,100,096.00
FORTINET INC	12,963	76.21	987,975.04
GARTNER INC	7,761	142.10	1,102,838.10
GLOBAL PAYMENTS INC	26,654	156.84	4,180,413.36
GODADDY INC - CLASS A	14,919	65.42	976,000.98
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,100	143.24	11,187,044.00
INTUIT INC	22,935	263.19	6,036,262.65
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,658	143.72	956,887.76
LEIDOS HOLDINGS	10,999	85.02	935,134.98

MASTERCARD INC-CLASS A	79,856	269.13	21,491,645.28
MICROSOFT CORP	638,320	137.73	87,915,813.60
MONGODB INC	3,652	117.33	428,489.16
OKTA INC	8,635	97.06	838,113.10
ORACLE CORP	210,716	54.09	11,397,628.44
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	202.40	1,632,153.60
PAYCHEX INC	27,697	81.52	2,257,859.44
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	206.40	874,723.20
PAYPAL HOLDINGS INC	98,367	102.20	10,053,107.40
PTC INC	9,984	67.39	672,821.76
SABRE CORP	24,114	22.18	534,848.52
SALESFORCE.COM INC	73,241	148.26	10,858,710.66
SERVICENOW INC	16,409	250.26	4,106,516.34
SPLUNK INC	12,887	118.06	1,521,439.22
SQUARE INC - A	27,989	60.75	1,700,331.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,645	50.69	995,805.05
SYMANTEC CORP	53,148	23.50	1,248,978.00
SYNOPSYS INC	13,552	136.21	1,845,917.92
TWILIO INC - A	9,579	106.56	1,020,738.24
VERISIGN INC	9,194	187.25	1,721,576.50
VISA INC-CLASS A SHARES	152,715	174.00	26,572,410.00
VMWARE INC-CLASS A	6,787	145.88	990,087.56
WESTERN UNION CO	38,757	23.05	893,348.85
WIX.COM LTD	3,961	115.10	455,911.10
WORKDAY INC-CLASS A	13,860	168.65	2,337,489.00
AMPHENOL CORPORATION	25,582	95.73	2,448,964.86
APPLE INC	403,446	218.82	88,282,053.72
ARISTA NETWORKS INC	4,940	242.78	1,199,333.20
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	74.07	493,750.62
CDW CORP/DE	12,482	121.79	1,520,182.78
CISCO SYSTEMS	376,282	48.84	18,377,612.88
COGNEX CORP	16,230	48.22	782,610.60
CORNING	66,228	28.38	1,879,550.64
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	50.95	707,695.50
F5 NETWORKS INC	5,350	139.71	747,448.50
FLEX LTD	40,465	10.38	420,026.70
FLIR SYSTEMS INC	11,686	52.79	616,903.94
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,105	15.00	1,681,575.00
HP INC	135,146	18.53	2,504,255.38
IPG PHOTONICS CORP	3,207	132.83	425,985.81
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	24.87	778,530.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	96.29	1,526,485.37

MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	170.19	2,371,767.84
NETAPP INC	20,586	53.91	1,109,791.26
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	53.80	1,228,690.98
TE CONNECTIVITY LTD	30,145	92.71	2,794,742.95
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	38.22	788,172.84
WESTERN DIGITAL CORP	26,625	60.49	1,610,546.25
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	30.33	507,056.94
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	202.18	930,028.00
AT&T INC	641,062	37.43	23,994,950.66
CENTURYLINK INC	83,301	12.39	1,032,099.39
SPRINT CORP	64,825	6.05	392,191.25
T-MOBILE US INC	30,672	77.56	2,378,920.32
VERIZON COMMUNICATIONS	363,367	60.30	21,911,030.10
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	20,398	33.90	691,492.20
AES CORP	61,761	16.31	1,007,321.91
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	54.03	1,040,401.68
AMEREN CORPORATION	21,002	80.00	1,680,160.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,855	94.20	4,131,141.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,471	124.24	1,922,117.04
ATMOS ENERGY CORP	10,759	114.05	1,227,063.95
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	30.00	1,283,760.00
CMS ENERGY CORP	24,527	64.01	1,569,973.27
CONSOLIDATED EDISON INC	29,281	94.62	2,770,568.22
DOMINION ENERGY INC	71,032	80.99	5,752,881.68
DTE ENERGY COMPANY	15,603	132.49	2,067,241.47
DUKE ENERGY CORP	64,402	96.26	6,199,336.52
EDISON INTL	30,299	75.88	2,299,088.12
ENTERGY CORP	17,139	117.50	2,013,832.50
EVERGY INC	21,330	66.56	1,419,724.80
EVERSOURCE ENERGY	27,188	85.34	2,320,223.92
EXELON CORP	86,267	48.58	4,190,850.86
FIRSTENERGY CORP	45,526	48.43	2,204,824.18
NEXTERA ENERGY INC	42,221	231.26	9,764,028.46
NISOURCE INC	32,308	30.03	970,209.24
NRG ENERGY INC	23,078	39.44	910,196.32
OGE ENERGY CORP	15,686	45.43	712,614.98
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	97.41	917,212.56
PPL CORPORATION	65,108	31.60	2,057,412.80
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,254	61.98	2,680,882.92
SEMPRA ENERGY	24,447	144.48	3,532,102.56
SOUTHERN CO	92,099	61.77	5,688,955.23
UGI CORP	18,019	50.45	909,058.55

	VISTRA ENERGY CORP	29,561	26.74	790,461.14
	WEC ENERGY GROUP INC	26,996	94.87	2,561,110.52
	XCEL ENERGY INC	44,029	65.36	2,877,735.44
	ADVANCED MICRO DEVICES	87,922	28.72	2,525,119.84
	ANALOG DEVICES	32,917	111.04	3,655,103.68
	APPLIED MATERIALS	80,718	49.43	3,989,890.74
	BROADCOM INC	34,898	274.14	9,566,937.72
	INTEL CORP	393,448	50.78	19,979,289.44
	KLA CORP	13,856	158.48	2,195,898.88
	LAM RESEARCH CORP	12,864	230.08	2,959,749.12
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	24.76	1,355,288.12
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,423	57.22	1,340,264.06
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	91.29	1,893,719.76
	MICRON TECHNOLOGY	95,275	43.21	4,116,832.75
	NVIDIA CORP	51,023	171.76	8,763,710.48
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	106.53	2,671,559.34
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	18.68	672,405.28
	QORVO INC	10,609	73.23	776,897.07
	QUALCOMM	107,281	76.63	8,220,943.03
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	77.47	1,124,089.70
	TEXAS INSTRUMENTS	82,668	127.14	10,510,409.52
	XILINX INC	21,744	95.95	2,086,336.80
	アメリカドル 小計	26,411,104		2,202,689,606.32 (237,714,262,314)
カナダドル	CAMECO CORP	28,709	12.69	364,317.21
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	35.29	3,646,445.12
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	12.75	1,232,491.50
	ENBRIDGE	179,723	47.78	8,587,164.94
	ENCANA CORP	117,430	6.11	717,497.30
	HUSKY ENERGY INC	31,439	9.54	299,928.06
	IMPERIAL OIL	24,763	34.82	862,247.66
	INTER PIPELINE LTD	35,455	23.59	836,383.45
	KEYERA CORP	18,607	32.69	608,262.83
	PEMBINA PIPELINE CORP	46,962	49.37	2,318,513.94
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	18.40	337,640.00
	SUNCOR ENERGY	140,329	41.92	5,882,591.68
	TC ENERGY CORP	82,858	68.46	5,672,458.68
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	13.38	267,131.70
	VERMILION ENERGY INC	10,067	22.38	225,299.46
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	73.48	1,576,807.32
	BARRICK GOLD CORP	160,347	23.46	3,761,740.62
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	53.08	697,418.12

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	10.83	616,227.00
FRANCO-NEVADA CORP	16,758	122.70	2,056,206.60
KINROSS GOLD CORP	107,615	6.36	684,431.40
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	60.22	1,025,727.26
LUNDIN MINING CORP	62,243	6.16	383,416.88
METHANEX CORP	7,099	46.98	333,511.02
NUTRIEN LTD	51,428	65.44	3,365,448.32
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	21.67	989,820.59
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	52.66	227,859.82
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	35.43	1,305,170.34
BOMBARDIER B	151,366	1.74	263,376.84
CAE INC	25,999	33.63	874,346.37
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	18.67	274,691.71
WSP GLOBAL INC	9,471	77.41	733,150.11
THOMSON REUTERS CORP	18,789	87.83	1,650,237.87
AIR CANADA	11,591	42.95	497,833.45
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,156	118.49	7,601,844.44
CP RAILWAY LIMITED	12,636	291.84	3,687,690.24
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	69.32	1,939,434.96
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	46.79	826,264.61
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	92.59	1,978,185.35
STARS GROUP INC/THE	20,487	19.96	408,920.52
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.13	457,976.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	25.98	1,171,360.26
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	148.03	800,694.27
DOLLARAMA INC	26,700	47.32	1,263,444.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	39,704	80.66	3,202,524.64
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	35.83	546,514.99
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	74.75	1,167,445.50
METRO INC	22,050	57.91	1,276,915.50
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	111.04	764,288.32
SAPUTO INC	20,412	40.25	821,583.00
AURORA CANNABIS INC	53,000	6.12	324,360.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	31.56	517,584.00
CRONOS GROUP INC	15,900	12.08	192,072.00
BANK MONTREAL	57,133	97.61	5,576,752.13
BANK NOVA SCOTIA	108,575	76.25	8,278,843.75
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	109.33	4,153,446.70
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	65.95	1,861,636.60
ROYAL BANK OF CANADA	126,779	107.45	13,622,403.55
TORONTO-DOMINION BANK	161,692	76.79	12,416,328.68
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	75,671	71.45	5,406,692.95

	CI FINANCIAL CORP	18,671	19.37	361,657.27
	IGM FINANCIAL INC	7,685	37.68	289,570.80
	ONEX CORP	6,603	82.85	547,058.55
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	582.80	1,343,354.00
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.88	758,361.44
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	60.36	496,762.80
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	133.68	1,743,588.24
	MANULIFE FINANCIAL CORP	168,472	24.16	4,070,283.52
	POWER CORP OF CANADA	29,774	30.43	906,022.82
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	30.79	638,584.60
	SUN LIFE FINANCIAL INC	53,901	58.81	3,169,917.81
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	22.18	276,473.70
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.97	274,618.00
	CGI INC - CL A	21,192	103.90	2,201,848.80
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,310.40	2,228,990.40
	OPEN TEXT CORP	24,643	53.72	1,323,821.96
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,973	404.90	3,633,167.70
	BCE INC	12,539	64.09	803,624.51
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	64.81	2,080,076.95
	TELUS CORP	16,454	46.80	770,047.20
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	19.27	470,091.65
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	48.71	255,289.11
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	39.21	404,804.04
	EMERA INC	20,611	58.44	1,204,506.84
	FORTIS INC	38,447	56.09	2,156,492.23
	HYDRO ONE LTD	32,299	24.56	793,263.44
	カナダドル 小計	3,499,399		166,643,280.51 (13,579,760,928)
ユーロ	ENI	217,599	14.05	3,058,136.34
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	13.67	544,981.89
	NESTE OIL OYJ	36,438	30.13	1,097,876.94
	OMV AG	12,139	49.76	604,036.64
	REPSOL SA	129,100	14.30	1,846,775.50
	TENARIS SA	40,648	9.79	397,943.92
	TOTAL SA	211,151	47.59	10,048,676.09
	VOPAK	6,360	46.80	297,648.00
	AIR LIQUIDE	38,239	129.40	4,948,126.60
	AKZO NOBEL	19,742	81.56	1,610,157.52
	ARCELORMITTAL	53,985	13.01	702,560.79
	ARKEMA	5,335	85.18	454,435.30
	BASF SE	81,730	63.54	5,193,124.20
	COVESTRO AG	15,098	44.79	676,239.42

CRH PLC	71,124	31.28	2,224,758.72
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	22.56	303,522.24
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	34.08	196,368.96
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	65.54	972,154.82
IMERYS SA	3,000	35.66	106,980.00
KONINKLIJKE DSM NV	15,234	108.50	1,652,889.00
LANXESS	7,293	55.26	403,011.18
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	27.42	536,472.30
SOLVAY SA	6,906	94.62	653,445.72
STORA ENSO OYJ R	47,237	10.97	518,189.89
SYMRISE AG	11,581	88.88	1,029,319.28
THYSSEN KRUPP	33,044	12.87	425,276.28
UMICORE	17,605	35.13	618,463.65
UPM KYMMENE OYJ	43,990	26.81	1,179,371.90
VOESTALPINE AG	8,140	21.37	173,951.80
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,695	35.74	775,379.30
AIRBUS SE	51,774	119.00	6,161,106.00
ALSTOM	18,760	37.30	699,748.00
ANDRITZ AG	5,242	37.20	195,002.40
BOUYGUES ORD	19,381	36.00	697,716.00
BRENTAG AG	15,254	44.52	679,108.08
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	9.36	870,723.36
DASSAULT AVIATION SA	213	1,283.00	273,279.00
EIFFAGE	6,079	94.40	573,857.60
FERROVIAL SA	45,344	26.34	1,194,360.96
GEA GROUP AG	13,382	25.27	338,163.14
HOCHTIEF AG	2,222	102.70	228,199.40
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	44.32	523,552.16
KION GROUP AG	5,887	47.74	281,045.38
KNORR-BREMSE AG	4,123	86.50	356,639.50
KONE OYJ-B	30,120	52.40	1,578,288.00
LEGRAND SA	24,584	64.88	1,595,009.92
LEONARDO SPA	35,425	10.82	383,298.50
METSO OYJ	9,561	34.38	328,707.18
MTU AERO ENGINES AG	4,753	243.80	1,158,781.40
PRYSMIAN SPA	21,155	19.54	413,474.47
SAFRAN SA	29,221	145.00	4,237,045.00
SAINT-GOBAIN	45,357	35.23	1,598,153.89
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,188	79.54	3,912,413.52
SIEMENS	67,838	97.36	6,604,707.68
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.88	225,371.53
THALES SA	9,665	104.60	1,010,959.00

VINCI S.A.	45,508	97.02	4,415,186.16
WARTSILA OYJ	34,386	10.14	348,674.04
BUREAU VERITAS SA	25,073	22.16	555,617.68
EDENRED	22,756	44.22	1,006,270.32
RANDSTAD NV	9,588	44.75	429,063.00
SOCIETE BIC SA	2,424	61.75	149,682.00
TELEPERFORMANCE	5,057	197.00	996,229.00
WOLTERS KLUWER	25,709	66.14	1,700,393.26
ADP	2,382	161.70	385,169.40
AENA SME SA	5,610	167.10	937,431.00
ATLANTIA SPA	42,039	21.95	922,756.05
BOLLORE	61,805	3.79	234,364.56
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	14.28	332,324.16
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	30.19	2,565,727.34
FRAPORT AG	3,561	76.74	273,271.14
GETLINK	36,478	13.73	500,842.94
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	63.89	1,849,359.94
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	50.90	254,041.90
CONTINENTAL AG	9,928	117.50	1,166,540.00
DAIMLER AG	81,382	45.38	3,693,115.16
FAURECIA	5,945	43.86	260,747.70
FERRARI NV	11,268	140.25	1,580,337.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	11.86	1,143,633.21
MICHELIN	14,695	101.40	1,490,073.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	25.66	264,092.72
PEUGEOT SA	52,883	23.00	1,216,309.00
PIRELLI & C SPA	39,097	5.54	216,597.38
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	58.68	823,163.04
RENAULT SA	17,362	53.04	920,880.48
VALEO SA	19,350	30.10	582,435.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	154.90	2,478,245.10
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	156.85	406,868.90
ADIDAS AG	16,091	285.10	4,587,544.10
ESSILORLUXOTTICA	24,247	130.50	3,164,233.50
HERMES INTERNATIONAL	2,899	630.80	1,828,689.20
HUGO BOSS AG	4,852	49.08	238,136.16
KERING	6,807	464.75	3,163,553.25
LVMH	24,557	360.15	8,844,203.55
MONCLER SPA	15,736	32.89	517,557.04
PUMA SE	7,720	69.95	540,014.00
SEB SA	2,075	139.40	289,255.00
ACCOR	17,931	38.14	683,888.34

FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	85.68	612,012.24
SODEXO	8,135	102.55	834,244.25
AXEL SPRINGER SE-TEND	3,827	63.00	241,101.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	17.15	205,388.40
JC DECAUX SA	4,674	24.68	115,354.32
PUBLICIS GROUPE	17,601	44.89	790,108.89
RTL GROUP	3,513	43.88	154,150.44
SES	31,369	16.71	524,332.83
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	43.26	216,213.48
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	67.28	459,522.40
VIVENDI	77,307	25.39	1,962,824.73
DELIVERY HERO SE	8,671	41.26	357,765.46
INDITEX	93,820	28.12	2,638,218.40
PROSUS	41,700	67.27	2,805,159.00
ZALANDO SE	13,985	41.22	576,461.70
CARREFOUR	53,759	16.21	871,702.18
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	44.67	164,698.29
COLRUYT SA	4,160	50.32	209,331.20
JERONIMO MARTINS	20,234	15.44	312,514.13
KONINKLIJKE AHOLD NV	107,149	23.02	2,466,569.98
METRO AG	13,712	14.56	199,715.28
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,662	87.04	5,889,300.48
DANONE (GROUPE)	55,084	80.38	4,427,651.92
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	8.25	350,839.50
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	91.15	975,396.15
HEINEKEN NV	22,649	99.20	2,246,780.80
KERRY GROUP PLC-A	14,641	106.30	1,556,338.30
PERNOD-RICARD	18,169	162.45	2,951,554.05
REMY COINTREAU	1,575	121.40	191,205.00
BEIERSDORF AG	9,190	108.00	992,520.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	84.30	726,497.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	91.54	1,440,473.44
LOREAL	22,456	253.40	5,690,350.40
UNILEVER NV	129,135	55.04	7,107,590.40
BIOMERIEUX	3,246	75.40	244,748.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	103.50	355,005.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	61.92	1,114,312.32
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	43.96	1,615,398.12
KONINKLIJKE PHILIPS	82,897	41.54	3,443,541.38
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	169.00	548,574.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	35.68	446,062.50
BAYER	82,883	64.68	5,360,872.44

EUROFINS SCIENTIFIC	971	430.40	417,918.40
GRIFOLS SA	27,685	27.04	748,602.40
IPSEN	2,722	87.35	237,766.70
MERCK KGAA	12,078	103.65	1,251,884.70
ORION OYJ-CLASS B	7,975	34.12	272,107.00
QIAGEN N.V.	21,801	30.23	659,044.23
RECORDATI SPA	7,493	39.35	294,849.55
SANOFI	99,497	85.06	8,463,214.82
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	129.20	388,116.80
UCB (GROUPE)	10,465	66.74	698,434.10
ABN AMRO BANK NV-CVA	33,189	16.12	535,172.62
AIB GROUP PLC	70,200	2.63	185,187.60
BANCO BILBAO VIZCAYA	600,761	4.74	2,851,812.46
BANCO DE SABADELL SA	442,961	0.89	395,121.21
BANCO SANTANDER SA	1,493,926	3.70	5,527,526.20
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	3.58	300,720.00
BANKIA SA	110,053	1.71	189,126.08
BANKINTER SA	58,881	5.73	337,741.41
BNP PARIBAS	100,335	44.19	4,433,803.65
CAIXABANK	286,347	2.40	688,091.84
COMMERZBANK AG	80,494	5.37	432,413.76
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	11.11	1,194,451.24
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	30.24	833,414.40
FINECOBANK SPA	53,120	9.61	510,908.16
ING GROEP NV-CVA	349,585	9.57	3,348,674.71
INTESA SANPAOLO	1,286,795	2.16	2,780,120.59
KBC GROEP NV	21,492	58.98	1,267,598.16
MEDIOBANCA	53,990	9.97	538,604.24
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	21.48	268,285.20
SOCIETE GENERALE	70,347	24.94	1,754,454.18
UNICREDIT SPA	172,440	10.80	1,863,041.76
AMUNDI SA	4,764	63.80	303,943.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	6.92	1,116,649.92
DEUTSCHE BOERSE	17,199	143.55	2,468,916.45
EURAZEO SA	3,357	67.80	227,604.60
EXOR NV	10,345	61.52	636,424.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	87.80	548,486.60
NATIXIS	69,996	3.77	264,164.90
WENDEL	2,023	125.80	254,493.40
AEGON	166,267	3.83	637,301.41
AGEAS	16,065	51.02	819,636.30
ALLIANZ SE-REG	37,563	211.85	7,957,721.55

ASSICURAZIONI GENERALI	100,566	17.86	1,796,108.76
AXA	173,280	23.15	4,011,432.00
CNP ASSURANCES	11,830	17.81	210,692.30
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	154.00	891,506.00
MAPFRE SA	90,939	2.47	225,074.02
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	237.20	3,004,138.00
NN GROUP NV	27,631	32.71	903,810.01
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.26	472,319.10
SAMPO OYJ-A SHS	38,075	36.25	1,380,218.75
SCOR SE	13,354	37.97	507,051.38
AROUNDTOWN SA	79,006	7.44	588,278.67
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	33.43	969,770.87
VONOVIA SE	43,528	46.23	2,012,299.44
ADYEN NV	884	619.00	547,196.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,633	65.80	2,607,851.40
ATOS SE	7,634	65.42	499,416.28
CAPGEMINI SA	13,238	109.95	1,455,518.10
DASSAULT SYSTEMES SA	11,300	132.00	1,491,600.00
SAP SE	86,843	107.80	9,361,675.40
WIRECARD AG	9,864	149.90	1,478,613.60
WORLDLINE SA	7,022	58.45	410,435.90
INGENICO GROUP	4,681	90.00	421,290.00
NOKIA OYJ	489,813	4.59	2,249,466.20
1&1 DRILLISCH AG	3,773	28.60	107,907.80
CELLNEX TELECOM SA	16,559	38.42	636,196.78
DEUTSCHE TELEKOM	297,100	15.36	4,564,050.20
ELISA A	11,722	47.25	553,864.50
ILIAD SA	2,053	85.50	175,531.50
KPN (KON.)	308,450	2.87	887,719.10
ORANGE	170,925	14.39	2,460,465.37
PROXIMUS	13,141	27.29	358,617.89
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.51	443,071.27
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.49	234,133.20
TELEFONICA	400,024	6.99	2,798,967.92
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.56	171,904.28
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	32.46	308,791.98
E.ON SE	201,539	8.95	1,804,378.66
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	10.08	501,338.88
ENAGAS	18,299	21.11	386,291.89
ENDESA	24,774	23.85	590,859.90
ENEL	724,150	6.78	4,914,081.90
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.54	837,255.23

	ENGIE	156,560	14.62	2,289,690.00
	FORTUM OYJ	38,328	21.49	823,668.72
	IBERDROLA SA	534,398	9.41	5,032,960.36
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,130	24.01	555,351.30
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	18.16	719,717.12
	RWE STAMM	47,044	28.57	1,344,047.08
	SNAM SPA	163,694	4.60	753,810.87
	SUEZ	28,043	14.32	401,715.97
	TERNA SPA	130,230	5.80	756,375.84
	UNIPER SE	20,192	30.36	613,029.12
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	23.00	1,052,066.00
	VERBUND AG	7,463	50.65	378,000.95
	ASML HOLDING NV	37,644	225.45	8,486,839.80
	INFINEON TECHNOLOGIES	107,254	16.60	1,781,059.92
	STMICROELECTRONICS	57,598	17.77	1,023,804.45
	ユーロ 小計	16,924,787		346,864,780.41 (40,936,981,383)
イギリスポンド	BP PLC	1,796,256	5.19	9,327,957.40
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	384,364	24.08	9,257,406.94
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	331,137	24.10	7,980,401.70
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	3.85	208,116.00
	ANGLO AMERICAN PLC	96,044	18.86	1,811,774.01
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.03	324,066.52
	BHP GROUP PLC	189,010	17.54	3,316,747.48
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	48.48	484,751.52
	EVRAZ PLC	43,000	4.67	200,939.00
	FRESNILLO PLC	17,743	7.03	124,733.29
	GLENCORE PLC	941,686	2.47	2,325,964.42
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	30.18	508,472.64
	MONDI PLC	42,009	15.50	651,139.50
	RIO TINTO PLC REG	101,122	42.49	4,297,179.39
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	22.72	954,717.12
	BAE SYSTEMS PLC	274,735	5.69	1,563,791.62
	BUNZL PLC	27,712	21.47	594,976.64
	DCC PLC	9,127	70.96	647,651.92
	FERGUSON PLC	19,208	59.24	1,137,881.92
	MEGGITT PLC	66,268	6.38	422,922.37
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	2.01	822,282.31
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	7.92	1,180,278.00
	SMITHS GROUP PLC	37,146	15.70	583,192.20
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	78.90	495,255.30
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	14.33	266,430.31

EXPERIAN PLC	77,938	25.95	2,022,491.10
G4S PLC	132,555	1.90	252,914.94
INTERTEK GROUP PLC	15,404	55.58	856,154.32
RELX PLC	174,568	19.35	3,377,890.80
RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	4.62	729,701.03
EASYJET PLC	11,633	11.55	134,361.15
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.45	622,803.86
BURBERRY GROUP PLC	35,328	21.69	766,264.32
PERSIMMON PLC	26,389	21.75	573,960.75
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.62	439,447.90
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	41.87	443,780.13
CARNIVAL PLC	13,721	33.67	461,986.07
COMPASS GROUP PLC	136,301	21.04	2,867,773.04
GVC HOLDINGS PLC	42,500	7.42	315,350.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	50.53	810,551.73
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.52	294,568.45
TUI AG-DI	37,945	9.45	358,580.25
WHITBREAD PLC	11,623	44.67	519,199.41
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.11	409,491.18
INFORMA PLC	117,961	8.52	1,005,971.40
ITV PLC	295,435	1.26	372,543.53
PEARSON	66,305	7.34	486,943.92
WPP PLC	113,065	9.99	1,129,971.61
KINGFISHER PLC	170,994	2.08	357,206.46
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	1.88	254,294.44
NEXT PLC	11,202	62.16	696,316.32
OCADO GROUP PLC	38,762	13.04	505,650.29
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.02	423,968.17
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.22	330,045.37
TESCO	856,393	2.44	2,093,880.88
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	23.02	664,011.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO	203,330	29.45	5,988,068.50
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.49	475,760.40
DIAGEO	210,292	32.99	6,938,584.54
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	17.74	1,477,265.77
RECKITT BENCKISER PLC	63,097	66.06	4,168,187.82
UNILEVER PLC	98,655	49.17	4,851,359.62
NMC HEALTH PLC	9,509	27.72	263,589.48
SMITH & NEPHEW PLC	75,051	19.60	1,471,374.85
ASTRAZENECA	115,877	73.83	8,555,198.91
GLAXOSMITHKLINE	441,129	17.25	7,609,475.25
BARCLAYS	1,471,691	1.50	2,221,076.05

	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,784,402	6.24	11,140,021.68
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,344,250	0.54	3,485,530.95
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	2.09	826,645.16
	STANDARD CHARTERED PLC	254,760	6.83	1,740,010.80
	3I GROUP PLC	79,251	11.84	938,728.09
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	20.77	561,226.17
	INVESTEC PLC	54,280	4.23	230,038.64
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	28,508	73.60	2,098,188.80
	SCHRODERS PLC	8,614	30.64	263,932.96
	ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	9.75	436,312.50
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.86	553,577.75
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.84	338,754.20
	AVIVA PIC	348,023	3.97	1,384,087.47
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.01	343,078.15
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.49	1,374,344.64
	PRUDENTIAL	229,107	14.73	3,374,746.11
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.31	460,209.08
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	11.29	328,376.37
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.90	616,493.54
	HALMA PLC	32,374	19.67	636,958.45
	BT GROUP PLC	730,298	1.77	1,296,278.95
	VODAFONE GROUP PLC	2,384,174	1.62	3,867,130.22
	CENTRICA PLC	440,558	0.73	323,633.90
	NATIONAL GRID PLC	291,880	8.83	2,577,300.40
	SEVERN TRENT PLC	18,112	21.48	389,045.76
	SSE PLC	93,277	12.43	1,159,899.49
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.17	481,249.08
	イギリスボンド 小計	26,238,467		159,312,844.74 (21,139,221,368)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.42	337,869.16
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	616.50	414,288.00
	GIVAUDAN-REG	813	2,772.00	2,253,636.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	44,261	49.29	2,181,624.69
	SIKA AG-BR	11,762	144.50	1,699,609.00
	ABB LTD	165,849	19.43	3,222,446.07
	GEBERIT AG-REG	3,423	474.90	1,625,582.70
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	221.60	327,746.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	222.40	838,003.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	54.30	718,063.20
	SGS SA	437	2,471.00	1,079,827.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	145.70	738,261.90
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	73.04	3,268,101.76

SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	263.60	654,518.80	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	49.60	195,324.80	
DUFREY AG-REG	3,825	83.06	317,704.50	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	2,048.00	327,680.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	82,700.00	661,600.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,465.00	776,360.00	
NESTLE SA - REGISTERED	269,186	107.70	28,991,332.20	
ALCON INC	35,606	58.39	2,079,034.34	
SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	232.80	1,188,211.20	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	895	811.20	726,024.00	
LONZA GROUP AG-REG	6,507	337.00	2,192,859.00	
NOVARTIS	189,231	86.38	16,345,773.78	
ROCHE HOLDING GENUSS	61,860	288.60	17,852,796.00	
VIFOR PHARMA AG	3,601	159.90	575,799.90	
CREDIT SUISSE GROUP AG	218,862	12.12	2,652,607.44	
JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	44.16	935,176.32	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	76.60	260,210.20	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,608	768.80	1,236,230.40	
UBS GROUP AG	345,678	11.26	3,892,334.28	
BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	178.50	692,044.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	472.40	1,393,107.60	
SWISS RE LTD	26,239	104.00	2,728,856.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,483	382.60	5,158,595.80	
SWISS PRIME SITE-REG	6,277	97.30	610,752.10	
TEMENOS AG - REG	5,252	169.40	889,688.80	
SWISSCOM	2,441	493.50	1,204,633.50	
スイスフラン 小計	1,546,645		113,244,314.54 (12,330,040,967)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	296.30	4,204,793.30
	BOLIDEN AB	23,903	228.90	5,471,396.70
	ALFA LAVAL AB	25,639	191.30	4,904,740.70
	ASSA ABLOY AB-B	85,980	216.30	18,597,474.00
	ATLAS COPCO A	59,675	304.70	18,182,972.50
	ATLAS COPCO B	36,538	271.30	9,912,759.40
	EPIROC AB-A	53,833	107.15	5,768,205.95
	EPIROC AB-B	29,972	102.05	3,058,642.60
	SANDVIK AB	100,730	152.95	15,406,653.50
	SKANSKA B	28,530	196.05	5,593,306.50
	SKF AB-B	28,335	160.85	4,557,684.75
	VOLVO B	125,906	137.35	17,293,189.10
	SECURITAS B	22,844	152.10	3,474,572.40
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	236.50	4,297,205.00

	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	77.86	3,014,116.32	
	HENNES & MAURITZ B	69,119	192.06	13,274,995.14	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	452.70	3,603,039.30	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	406.70	6,161,098.30	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	52,085	288.10	15,005,688.50	
	NORDEA BANK ABP	295,938	68.96	20,407,884.48	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	90.52	12,556,029.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	92.34	12,593,883.24	
	SWEDBANK AB-A	80,216	140.10	11,238,261.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	214.50	2,743,884.00	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	477.20	19,297,013.60	
	KINNEVIK AB - B	18,104	258.60	4,681,694.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	368.40	2,681,952.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	78.88	21,199,394.40	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	474.60	10,205,798.40	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	488.00	3,022,672.00	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	148.15	7,409,277.80	
	TELIA CO AB	235,437	44.29	10,427,504.73	
	スウェーデンクローナ 小計	2,149,036		300,247,783.81 (3,308,730,577)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	10,311	245.00	2,526,195.00	
	EQUINOR ASA	92,158	174.35	16,067,747.30	
	NORSK HYDRO	106,150	32.70	3,471,105.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	388.10	7,168,207.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	254.20	1,772,028.20	
	MOWI ASA	40,968	209.80	8,595,086.40	
	ORKLA	69,804	82.46	5,756,037.84	
	DNB ASA	80,217	159.45	12,790,600.65	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	181.10	3,363,751.40	
	TELENOR ASA	60,821	182.45	11,096,791.45	
	ノルウェークローネ 小計	504,444		72,607,550.24 (862,577,696)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	589.00	5,347,531.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	289.70	5,123,923.90	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,605	545.00	9,594,725.00	
	ISS A/S	14,253	171.35	2,442,251.55	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	7,280.00	2,176,720.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	7,760.00	3,942,080.00	
	DSV A/S	18,714	646.60	12,100,472.40	
	PANDORA A/S	8,431	285.50	2,407,050.50	
	CARLSBERG AS-B	9,692	1,017.00	9,856,764.00	
	COLOPLAST-B	10,223	830.00	8,485,090.00	

	DEMANT A/S	7,420	178.00	1,320,760.00
	GENMAB A/S	5,595	1,400.00	7,833,000.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	227.00	1,105,717.00
	NOVO NORDISK A/S-B	156,652	354.70	55,564,464.40
	DANSKE BANK A/S	59,378	95.74	5,684,849.72
	TRYG A/S	9,828	198.40	1,949,875.20
	ORSTED A/S	15,908	636.80	10,130,214.40
	デンマーククローネ 小計	366,143		145,065,489.07 (2,293,485,382)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	25.85	533,259.65
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.35	873,040.35
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	8.01	1,326,415.95
	SANTOS	156,437	7.79	1,218,644.23
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	21.16	271,123.08
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	32.03	2,677,387.70
	WORLEYPARSONS LTD	34,596	12.95	448,018.20
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.38	405,690.04
	BHP GROUP LTD	261,560	36.84	9,635,870.40
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.01	592,429.28
	BORAL LIMITED	81,732	4.87	398,034.84
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	8.82	1,187,842.32
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.39	510,530.61
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	24.72	923,613.36
	NEWCREST MINING LIMITED	66,006	35.08	2,315,490.48
	ORICA LTD	29,211	22.92	669,516.12
	RIO TINTO LTD	32,522	91.60	2,979,015.20
	SOUTH32 LTD	408,172	2.63	1,073,492.36
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	31.44	289,876.80
	BRAMBLES LTD	129,297	11.40	1,473,985.80
	SEEK LTD	26,358	21.68	571,441.44
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	6.03	961,706.61
	TRANSURBAN GROUP	229,164	14.74	3,377,877.36
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	30.50	1,608,936.00
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.12	367,575.36
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	47.81	156,004.03
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.87	812,540.02	
REA GROUP LTD	3,593	108.27	389,014.11	
HARVEY NORMAN HOLDING-RIGHTS	2,656	1.82	4,833.92	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.54	205,040.02	
WESFARMERS LTD	97,071	40.35	3,916,814.85	
COLES GROUP LTD	93,277	15.27	1,424,339.79	
WOOLWORTHS GROUP LTD	107,751	37.54	4,044,972.54	

	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.79	497,742.70
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	18.33	1,070,013.75
	COCHLEAR LIMITED	4,811	207.37	997,657.07
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	64.67	792,078.16
	SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	28.12	1,096,370.68
	CSL LIMITED	40,233	234.30	9,426,591.90
	AUST AND NZ BANKING GROUP	252,665	28.68	7,246,432.20
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	9.92	353,152.00
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.61	492,658.74
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	156,654	81.54	12,773,567.16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	250,533	29.83	7,473,399.39
	WESTPAC BANKING	306,284	29.90	9,157,891.60
	AMP LTD	244,230	1.80	439,614.00
	ASX LTD	15,814	82.00	1,296,748.00
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	7.46	328,747.28
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,283	132.09	3,867,991.47
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	51.88	566,114.56
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.93	1,660,185.15
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.45	740,066.40
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.62	1,427,233.66
	SUNCORP GROUP LIMITED	122,919	13.62	1,674,156.78
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.22	719,778.72
	TELSTRA CORP	342,339	3.51	1,201,609.89
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.92	217,807.00
	AGL ENERGY LTD	51,344	19.09	980,156.96
	AUSNET SERVICES	120,230	1.80	217,015.15
	オーストラリアドル 小計	6,009,200		114,359,153.19 (8,334,495,084)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	5.08	389,351.52
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	9.27	787,911.25
	A2 MILK CO LTD	66,854	13.08	874,450.32
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	16.80	764,534.40
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.05	473,936.85
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.39	638,521.11
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.18	572,617.92
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,501,323.37 (304,829,618)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	69.10	16,169,123.60
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	11.96	1,949,480.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	55.20	6,568,800.00
	MTR CORP	133,000	44.35	5,898,550.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	21.55	1,476,175.00

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	187,000	48.30	9,032,100.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.42	834,624.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	35.45	7,189,260.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	7.97	781,060.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.51	991,320.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	15.52	2,185,216.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	31.60	2,022,400.00	
	WH GROUP LTD	829,500	6.95	5,765,025.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	19.16	2,091,505.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	26.45	8,199,500.00	
	HANG SENG BANK	68,000	169.50	11,526,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,200	226.80	23,178,960.00	
	AIA GROUP LTD	1,068,000	74.00	79,032,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	53.20	11,490,987.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.92	3,100,160.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	36.60	4,583,344.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	31.35	1,849,650.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	23.95	1,544,775.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.18	5,003,470.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.70	3,690,180.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	136,500	112.00	15,288,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	72.40	2,932,200.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	24.80	2,385,760.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	16.92	1,539,720.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	42.95	4,080,250.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	44.50	2,892,500.00	
	PCCW LTD	357,000	4.40	1,570,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	52.70	2,635,000.00	
	CLP HOLDINGS	141,000	82.40	11,618,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	15.30	13,731,811.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	52.10	5,783,100.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	96.55	2,288,235.00	
	香港ドル 小計	7,645,184		282,899,442.40 (3,892,696,327)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.98	671,554.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.13	227,910.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.84	418,560.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.97	194,902.50	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.38	396,270.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.15	396,496.95	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.82	246,784.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.88	374,000.00	

	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.11	268,181.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	30.17	298,683.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.23	96,370.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.72	664,392.00	
	DBS GROUP	156,300	24.90	3,891,870.00	
	OCBC BANK	290,600	10.82	3,144,292.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	115,000	25.68	2,953,200.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	8.49	528,927.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.52	786,720.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.72	303,264.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.50	356,250.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.27	392,439.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	3.12	2,346,998.16	
	シンガポールドル 小計	3,653,176		18,958,063.61 (1,480,245,606)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	17.26	1,169,468.56	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	576.00	1,236,096.00	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	27.40	2,693,694.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.74	3,479,804.70	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.29	1,521,355.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	86.40	1,080,259.20	
	AZRIELI GROUP	4,323	273.00	1,180,179.00	
	NICE LTD	4,894	511.00	2,500,834.00	
	イスラエルシェケル 小計	430,087		14,861,690.46 (460,415,170)	
	合 計	95,943,938		346,637,742,420 (346,637,742,420)	

(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	102,205	1,182,511.85	
		LENDLEASE GROUP	44,009	786,440.83	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	727,866.00	
		オーストラリアドル 小計	236,074	2,696,818.68 (196,544,145)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,640,520.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,650,000.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,290,520.00 (86,557,555)	
		投資信託受益証券合計	831,574	283,101,700 (283,101,700)	

投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	741,085.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,502,621.54	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,995	8,539,125.10	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,095,357.98	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,833	2,749,726.91	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,768,330.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	974,061.92	
		CROWN CASTLE INTL CORP	37,198	5,128,488.26	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,838	2,298,426.30	
		DUKE REALTY CORP	29,929	1,018,783.16	
		EQUINIX INC	7,467	4,305,621.54	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,285	971,964.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	33,874	2,921,632.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,857,257.85	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,951	1,277,872.19	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	823,320.24	
		HCP INC	41,014	1,456,817.28	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,158,500.99	
		INVITATION HOMES INC	46,500	1,376,865.00	
		IRON MOUNTAIN INC	24,669	793,848.42	
		KIMCO REALTY CORP	35,407	738,235.95	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	16,322	841,235.88	
		MACERICH CO/THE	10,128	327,235.68	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,334,188.21	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	800,006.62	
		PROLOGIS INC	56,738	4,866,985.64	
		PUBLIC STORAGE	13,426	3,289,504.26	
		REALTY INCOME CORP	27,116	2,091,457.08	
		REGENCY CENTERS CORP	14,271	985,840.68	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,160	2,406,192.80	
		SIMON PROPERTY GROUP	27,453	4,336,475.88	
		SL GREEN REALTY CORP	8,067	659,799.93	
	SUN COMMUNITIES INC	7,365	1,092,082.20		
UDR INC	24,799	1,198,535.67			
VENTAS INC	30,413	2,239,917.45			
VEREIT INC	105,798	1,020,950.70			
VORNADO REALTY TRUST	15,390	985,883.40			
WELLTOWER INC	34,628	3,126,562.12			
WP CAREY INC	14,644	1,318,545.76			
	アメリカドル 小計	1,068,305	76,419,343.79 (8,247,175,581)		
	カナダドル	9,455	218,977.80		

	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT			
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	407,696.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	183,964.77	
カナダドル 小計		30,576	810,639.37 (66,059,002)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	345,277.00	
	GECINA SA	4,459	636,745.20	
	ICADE	2,845	232,009.75	
	KLEPIERRE	17,225	530,702.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,888	1,564,460.80	
ユーロ 小計		39,995	3,309,195.00 (390,551,193)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	461,871.82	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	501,070.90	
	SEGRO PLC	94,451	761,652.86	
イギリスポンド 小計		232,415	1,724,595.58 (228,836,587)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	1,152,602.50	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,970,807.55	
	GPT GROUP	167,884	1,050,953.84	
	MIRVAC GROUP	306,089	942,754.12	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,917,452.22	
	STOCKLAND	207,412	943,724.60	
	VICINITY CENTERS	291,115	756,899.00	
オーストラリアドル 小計		1,693,524	8,735,193.83 (636,620,926)	
香港ドル	LINK REIT	179,500	15,365,200.00	
香港ドル 小計		179,500	15,365,200.00 (211,425,152)	
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	620,150.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	505,440.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	526,789.00	
	SUNTEC REIT	173,000	328,700.00	
シンガポールドル 小計		813,800	1,981,079.00 (154,682,648)	
投資証券合計		4,058,115	9,935,351,089 (9,935,351,089)	
合計			10,218,452,789 (10,218,452,789)	

(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 611銘柄	96.6%			66.6%
	投資証券 39銘柄			3.4%	2.3%
カナダドル	株式 86銘柄	99.5%			3.8%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.1%			11.5%
	投資証券 5銘柄			0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式 94銘柄	98.9%			5.9%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
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 59銘柄	90.9%			2.3%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券 7銘柄			6.9%	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 37銘柄	92.9%			1.1%
	投資信託受益証券 2銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券 1銘柄			5.0%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	90.5%			0.4%
	投資証券 4銘柄			9.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	311,776,594
コール・ローン	5,023,176,608
国債証券	385,211,771,402
派生商品評価勘定	14,979,163
未収入金	1,849,160
未収利息	2,582,113,158
前払金	20,300,084
前払費用	246,635,647
差入委託証拠金	268,470,003
流動資産合計	393,681,071,819
資産合計	393,681,071,819
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,093,305
未払金	450,569
未払解約金	253,346,641
未払利息	12,204
その他未払費用	948
流動負債合計	290,903,667
負債合計	290,903,667
純資産の部	
元本等	
元本	139,801,569,209
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	253,588,598,943
元本等合計	393,390,168,152
純資産合計	393,390,168,152
負債純資産合計	393,681,071,819

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p>

2019年 9月30日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	139,801,569,209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 2.8139円 (1万口当たり純資産額) (28,139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

2019年 9月30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>

	2019年 9月30日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年 9月30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>

	2019年 9月30日現在

（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	2019年 9月30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	95,813,127,162円
期中追加設定元本額	60,546,533,876円
期中一部解約元本額	16,558,091,829円
期末元本額	139,801,569,209円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,752,815,834円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	708,339,844円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,017,111,341円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,492,818円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,133,552,304円
世界経済インデックスファンド	6,731,798,838円
DCマイセレクション25	1,704,734,807円
DCマイセレクション50	1,294,876,081円
DCマイセレクション75	822,443,024円
DC外国債券インデックス・オープン	1,900,257,015円
DCマイセレクションS25	686,664,230円
DCマイセレクションS50	530,705,948円
DCマイセレクションS75	235,988,316円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	47,959,325円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	66,502,218円

区分	2019年 9月30日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	31,538,961円
DC世界経済インデックスファンド	5,891,982,602円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	621,161,048円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	35,597,907円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,691,027円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,021,753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)	49,470,597円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	94,057,513円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	168,797,625円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	154,670,021円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	388,543,247円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,102,633,388円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	602,160,090円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,141,401,504円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	833,313,227円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	83,279,166円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	605,273,742円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	35,876,229円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	231,961,448円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	293,971,385円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	962,408,465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)	2,058,725,111円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	824,333,420円
外国債券ファンド・シリーズ1	470,971,342円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,378,191,685円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,502,910,725円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,587,483円
分散投資コア戦略ファンドS	3,998,332,513円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	271,339,866円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,717,190,562円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,113,993,106円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	233,227,918円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,726,380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)	1,085,156,680円
SMT インデックスバランス・オープン	231,730,581円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	23,853,823,721円
SMT 世界経済インデックス・オープン	74,672,251円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	97,815,397円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	133,636,062円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,343,513円
グローバル経済コア	977,592,135円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	6,193,153円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	89,146円

区分	2019年 9月30日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	214,648,407円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,478,275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）	825,456,232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）	11,471,846,836円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	351,098,799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）	41,628,040,971円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	15,559,781,505	
合計	15,559,781,505	

(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

（2019年 9月30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	6,611,891,900	-	6,591,591,816	20,300,084
合計		6,611,891,900	-	6,591,591,816	20,300,084

(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

（2019年 9月30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	8,577,858,458	-	8,576,044,400	1,814,058
	アメリカドル	4,274,877,309	-	4,284,369,400	9,492,091
	カナダドル	344,431,908	-	344,406,600	25,308
	ユーロ	3,393,611,939	-	3,383,633,400	9,978,539
	イギリスポンド	564,937,302	-	563,635,000	1,302,302
	合計	8,577,858,458	-	8,576,044,400	1,814,058

(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	6,443,505.83	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,701,234.42	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,949,511.70	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,770,304.68	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,474,570.33	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,493,658.21	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,916,406.30	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,941,347.67	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,446,933.57	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,655,785.13	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,961,523.45	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,480,761.72	
		T 1.375% 09/30/20	15,970,000.00	15,901,378.98	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,938,437.52	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,972,109.36	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,486,992.21	

T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,777,148.41	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,989,375.00	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	13,090,687.50	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,100,632.85	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,503,828.12	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,270,646.13	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,008,398.45	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,502,832.02	
T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	15,009,960.90	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,485,791.02	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	9,016,523.46	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,163,763.64	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,043,745.12	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,588,339.88	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,507,519.52	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,586,558.64	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,239,812.52	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,814,398.42	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,596,386.67	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,583,574.26	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,029,531.25	
T 1.75% 06/30/24	12,600,000.00	12,700,898.40	
T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,370,470.27	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,197,181.66	
T 1.75% 10/31/20	9,200,000.00	9,194,250.00	
T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,081,158.16	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,195,035.14	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,064,687.56	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,514,160.15	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,535,664.09	
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,517,761.77	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,066,093.75	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,032,812.52	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,775,898.43	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,426,578.15	
T 1.875% 12/15/20	10,000,000.00	10,009,570.30	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,013,593.75	
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,312,214.82	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,575,460.95	
T 2.125% 05/15/22	10,000,000.00	10,128,906.30	
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,335,625.00	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,555,078.12	

T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,130,023.44
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,920,562.51
T 2.125% 08/15/21	14,950,000.00	15,068,548.85
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,516,884.79
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,391,130.89
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,207,187.52
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	12,954,898.46
T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,696,562.50
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,409,567.20
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,111,718.76
T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,366,631.28
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,334,570.31
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,072,100.57
T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,154,687.50
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,527,685.56
T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,447,070.35
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,029,589.84
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,934,750.00
T 2.25% 08/15/46	19,200,000.00	19,662,000.00
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,503,519.54
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,477,892.60
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,561,390.63
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,317,261.79
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,814,902.31
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,678,250.00
T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,376,757.85
T 2.375% 03/15/21	10,000,000.00	10,088,867.20
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,609,384.78
T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,282,093.75
T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	19,751,953.12
T 2.375% 05/15/29	18,010,000.00	19,111,705.54
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,961,425.75
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,078,203.18
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,285,937.50
T 2.5% 01/31/21	10,000,000.00	10,093,945.30
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,541,171.87
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,231,445.30
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,956,304.66
T 2.5% 02/15/45	7,300,000.00	7,845,789.09
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	17,738,789.14
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,175,929.68
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	3,018,378.89
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	17,208,750.08

T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,706,406.25	
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,085,351.60	
T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	19,082,812.50	
T 2.625% 02/15/29	15,000,000.00	16,224,609.45	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,447,960.93	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,639,121.13	
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,730,847.62	
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,434,679.67	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,404,044.91	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,098,828.18	
T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	11,990,097.68	
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,694,171.87	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,148,007.82	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,284,812.55	
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,905,484.35	
T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	20,825,000.00	
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,155,019.50	
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,258,750.00	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,213,984.43	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,365,156.25	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	11,245,832.08	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,341,222.63	
T 2.75% 09/30/20	11,100,000.00	11,201,894.55	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,218,855.48	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,707,937.50	
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	10,234,277.38	
T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,676,171.90	
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,640,323.50	
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	13,170,195.37	
T 2.875% 05/15/49	3,800,000.00	4,424,625.00	
T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,469,921.92	
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,123,308.61	
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,492,100.00	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	12,543,515.62	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,987,314.46	
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,545,244.11	
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,147,265.69	
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,560,312.50	
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,561,033.22	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,522,167.97	
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,159,843.72	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,572,921.89	

T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,013,750.00	
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,185,937.50	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,817,292.96	
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,157,500.00	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,700,566.38	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,033,984.39	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,566,179.74	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,840,375.00	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,009,082.05	
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,688,402.37	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,417,625.00	
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,477,895.36	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,511,494.12	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,024,687.50	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,217,359.38	
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,799,437.50	
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,957,421.90	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,418,318.36	
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,703,523.46	
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	14,360,625.00	
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	16,156,125.07	
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,869,023.43	
T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	8,223,769.56	
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	10,559,804.72	
T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	4,918,947.67	
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,380,968.75	
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	9,684,375.00	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,576,562.50	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,603,906.26	
T 3.75% 11/15/43	8,500,000.00	11,167,539.10	
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	4,160,707.04	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,275,335.93	
T 3% 02/15/49	14,970,000.00	17,818,978.12	
T 3% 05/15/42	2,950,000.00	3,446,429.68	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,115,234.37	
T 3% 05/15/47	12,750,000.00	15,084,843.75	
T 3% 08/15/48	11,950,000.00	14,191,558.65	
T 3% 09/30/25	15,000,000.00	16,183,593.75	
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,800,000.00	
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	7,098,351.56	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,238,765.62	
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	6,031,886.74	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,385,937.50	

T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,670,390.62	
T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,742,710.93	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,784,218.75	
T 4.5% 02/15/36	3,840,000.00	5,290,200.00	
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,254,000.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,415,992.19	
T 4.625% 02/15/40	8,700,000.00	12,585,773.48	
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,357,472.67	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,621,125.00	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,637,500.00	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,693,148.44	
T 5.375% 02/15/31	3,300,000.00	4,548,070.32	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,579,500.00	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,151,296.87	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,943,792.97	
T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,739,710.94	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,939,265.62	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,923,589.84	
アメリカドル 小計	1,615,290,000.00	1,704,686,527.20 (183,969,770,015)	
カナダドル			
CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,023,786.50	
CAN 0.75% 03/01/21	5,690,000.00	5,618,903.45	
CAN 0.75% 09/01/20	5,320,000.00	5,273,210.60	
CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,658,744.00	
CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	454,204.00	
CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,206,464.00	
CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,320,263.00	
CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	603,018.00	
CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,036,580.00	
CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,706,129.00	
CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,919,597.55	
CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,478,430.00	
CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,380,626.50	
CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	3,979,816.00	
CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,091,545.60	
CAN 2.5% 06/01/24	3,060,000.00	3,210,934.50	
CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,068,715.75	
CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,683,300.60	
CAN 2.75% 12/01/64	1,190,000.00	1,665,125.35	
CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,253,580.50	
CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,154,362.75	
CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,116,815.30	

	CAN 2% 12/01/51	950,000.00	1,061,753.25	
	CAN 3.25% 06/01/21	5,630,000.00	5,781,728.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,720,175.10	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	3,955,715.40	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	3,023,515.25	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,070,000.00	3,175,566.30	
	CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,568,925.60	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,740,414.25	
	カナダドル 小計	81,940,000.00	90,931,946.60 (7,410,044,328)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,572,858.25	
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,511,416.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	36,084,268.80	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,567,839.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	63,590,000.00	63,441,517.35	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	30,550,912.20	
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	56,394,198.95	
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,710,248.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	37,702,584.15	
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	20,751,265.60	
	MBONO 8.5% 05/31/29	39,240,000.00	43,710,220.80	
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	27,181,734.55	
	MBONO 8% 09/05/24	18,970,000.00	20,034,975.80	
	MBONO 8% 11/07/47	18,970,000.00	20,413,427.30	
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,902,740.00	
	メキシコペソ 小計	524,610,000.00	552,530,207.55 (3,027,865,537)	
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,276,120.00	
	BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,393,363.15	
	BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,338,560.50	
	BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,404,501.45	
	BGB 0.8% 06/22/28	3,910,000.00	4,301,997.05	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,040,000.00	2,274,610.20	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,003,327.25	
	BGB 1.45% 06/22/37	980,000.00	1,201,078.20	
	BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,944,271.50	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,665,018.75	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,330,000.00	1,747,992.40	
	BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,225,680.95	
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,692,938.00	
	BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,543,265.00	
	BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,954,688.10	
	BGB 2.25% 06/22/57	800,000.00	1,217,796.00	

BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,813,930.00
BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,931,192.00
BGB 3.75% 09/28/20	3,270,000.00	3,412,849.95
BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,211,230.00
BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	6,158,590.75
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,583,601.75
BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,784,750.20
BGB 4.5% 03/28/26	2,420,000.00	3,217,438.40
BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,467,381.00
BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,406,158.30
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,190,558.10
BGB 5% 03/28/35	3,580,000.00	6,330,066.50
BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	2,993,018.80
BTPS 0.05% 04/15/21	7,190,000.00	7,224,943.40
BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,397,506.00
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,610,224.70
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,416,765.00
BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,301,643.10
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,566,003.75
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,270,184.80
BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,612,210.00
BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,712,972.50
BTPS 1.2% 04/01/22	1,450,000.00	1,499,140.50
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,054,822.25
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	3,009,243.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,440,944.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,097,864.25
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,379,638.00
BTPS 1.5% 06/01/25	4,210,000.00	4,483,944.70
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,876,552.00
BTPS 1.65% 03/01/32	5,250,000.00	5,601,723.75
BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,289,900.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,154,590.00
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,711,150.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,277,446.25
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,630,050.00
BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	7,063,969.50
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,993,983.25
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,838,280.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,897,137.50
BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,331,131.20
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,322,319.50
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	7,128,704.00

BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,631,290.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	2,237,258.65	
BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,742,444.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,517,156.50	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,833,199.50	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,458,290.50	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,337,837.05	
BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,616,570.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	3,390,000.00	4,326,504.45	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,530,000.00	3,452,071.15	
BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	8,080,998.95	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	4,019,165.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,797,409.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,576,745.65	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,517,800.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,270,000.00	3,286,994.05	
BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,531,466.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,534,871.75	
BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,759,228.40	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,523,220.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,952,157.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,327,560.75	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,721,812.95	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,940,000.00	4,691,416.80	
BTPS 4% 02/01/37	5,470,000.00	7,565,174.10	
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,571,050.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,781,895.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,780,191.60	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,956,529.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	4,038,121.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	6,119,796.00	
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,429,917.00	
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	7,071,879.00	
BTPS 5% 08/01/34	4,240,000.00	6,338,990.80	
BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	6,351,298.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	7,520,000.00	11,010,445.60	
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,402,200.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,054,339.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,089,844.00	
DBR 0.25% 02/15/27	4,690,000.00	5,036,309.60	
DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,801,189.60	
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,497,188.80	

DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	4,057,763.50
DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,412,650.00
DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,407,470.80
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	5,101,863.75
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,219,606.40
DBR 0% 08/15/29	1,810,000.00	1,915,930.25
DBR 1.25% 08/15/48	3,100,000.00	4,346,060.50
DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,690,098.05
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,202,195.50
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,538,224.55
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,993,690.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,837,572.00
DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,591,477.75
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,486,400.00
DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,445,062.40
DBR 2.25% 09/04/20	4,650,000.00	4,779,595.50
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,065,128.00
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,024,468.00
DBR 2.5% 07/04/44	5,120,000.00	8,612,761.60
DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	8,981,518.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,513,279.00
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,277,889.00
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,916,241.30
DBR 3.25% 07/04/42	2,600,000.00	4,731,402.00
DBR 4.0% 01/04/37	4,360,000.00	7,774,054.40
DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	5,218,978.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,795,037.50
DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,422,952.25
DBR 4.75% 07/04/40	3,210,000.00	6,688,693.05
DBR 5.5% 01/04/31	3,900,000.00	6,661,531.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,776,899.50
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,613,020.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,161,331.25
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,023,142.25
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,052,825.00
FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,156,569.25
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,312,391.45
FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	11,101,480.00
FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,536,165.00
FRTR 0.75% 05/25/28	9,010,000.00	9,897,935.50
FRTR 0.75% 11/25/28	8,510,000.00	9,358,021.50
FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,059,610.00
FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,276,045.00

FRTR 0% 03/25/24	11,240,000.00	11,567,140.20	
FRTR 0% 03/25/25	2,530,000.00	2,607,291.50	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,148,154.50	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,658,669.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,681,895.50	
FRTR 1.25% 05/25/36	6,420,000.00	7,643,844.60	
FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,555,158.60	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,020,000.00	3,856,993.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	5,007,185.10	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,621,883.90	
FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	5,253,494.80	
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,779,413.80	
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,394,035.25	
FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,890,948.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,660,593.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,270,232.50	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	10,305,453.80	
FRTR 2.5% 10/25/20	6,520,000.00	6,740,636.80	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,313,150.00	
FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,840,928.60	
FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,660,852.85	
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,751,472.25	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,670,000.00	7,197,753.15	
FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	12,170,845.95	
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,345,375.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,528,781.25	
FRTR 4.5% 04/25/41	6,860,000.00	13,052,659.20	
FRTR 4.75% 04/25/35	4,880,000.00	8,492,810.40	
FRTR 4% 04/25/55	2,900,000.00	6,071,179.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	5,384,230.25	
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	8,433,006.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,341,429.25	
FRTR 5.75% 10/25/32	6,340,000.00	11,268,716.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,666,868.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,334,195.00	
IRISH 0.8% 03/15/22	2,180,000.00	2,252,419.60	
IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,862,916.75	
IRISH 0% 10/18/22	1,340,000.00	1,362,733.10	
IRISH 1.1% 05/15/29	910,000.00	1,009,867.95	
IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	890,717.10	
IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	1,016,028.45	
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	1,043,408.40	

IRISH 1.7% 05/15/37	1,050,000.00	1,278,889.50
IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,215,766.40
IRISH 2.4% 05/15/30	1,630,000.00	2,040,393.25
IRISH 2% 02/18/45	1,480,000.00	1,968,644.20
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,726,625.25
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,490,807.85
IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,122,854.20
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	243,507.90
NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	3,032,827.20
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,708,912.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,445,990.40
NETHER 0.5% 07/15/26	3,070,000.00	3,307,249.60
NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	4,995,887.85
NETHER 0.75% 07/15/28	2,540,000.00	2,823,819.60
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,563,000.00
NETHER 0% 01/15/24	3,410,000.00	3,516,647.75
NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,237,757.75
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,803,374.20
NETHER 2.5% 01/15/33	2,430,000.00	3,368,320.20
NETHER 2.75% 01/15/47	2,680,000.00	4,797,709.20
NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,407,500.60
NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,142,893.80
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,653,757.85
NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,490,294.50
NETHER 4% 01/15/37	3,000,000.00	5,243,490.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,723,030.20
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	255,553.00
OBL 0.25% 10/16/20	6,360,000.00	6,427,320.60
OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,114,376.50
OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,502,287.50
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,285,390.10
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,577,721.15
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,642,120.00
OBL 0% 10/13/23	3,710,000.00	3,834,581.80
OBL 0% 10/18/24	960,000.00	998,347.20
RAGB 0.5% 02/20/29	1,190,000.00	1,283,129.40
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,251,294.50
RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,152,666.30
RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,604,192.80
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,538,797.50
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,123,061.50
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,895,329.80
RAGB 1.5% 02/20/47	1,130,000.00	1,507,826.80

RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	952,297.60
RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,085,835.40
RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,562,242.75
RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	1,923,590.00
RAGB 2.4% 05/23/34	1,550,000.00	2,119,051.50
RAGB 3.15% 06/20/44	1,330,000.00	2,300,906.65
RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,883,361.50
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,350,446.35
RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,570,325.45
RAGB 3.8% 01/26/62	680,000.00	1,580,357.40
RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,554,435.60
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,871,084.20
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	199,322.50
RFGB 0.375% 09/15/20	1,390,000.00	1,403,997.30
RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,249,565.85
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,129,542.75
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	724,008.70
RFGB 0.5% 09/15/29	580,000.00	627,908.00
RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	971,742.15
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	749,805.75
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	865,708.00
RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,499,558.70
RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	914,170.95
RFGB 1.375% 04/15/47	550,000.00	734,659.75
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	701,629.50
RFGB 1.625% 09/15/22	1,430,000.00	1,530,493.25
RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,463,729.20
RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,178,671.80
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	673,623.00
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	852,416.00
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,436,252.60
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,626,352.00
SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,752,499.00
SPGB 0.25% 07/30/24	1,790,000.00	1,837,560.30
SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,908,964.40
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,353,898.40
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,927,876.25
SPGB 0.6% 10/31/29	2,330,000.00	2,435,933.45
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,251,502.00
SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,584,926.15
SPGB 1.4% 04/30/28	6,230,000.00	6,956,418.00
SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,591,008.00

	SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,368,421.80	
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,902,263.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,401,619.25	
	SPGB 1.6% 04/30/25	4,910,000.00	5,413,250.45	
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,878,202.75	
	SPGB 1.95% 04/30/26	4,820,000.00	5,477,110.60	
	SPGB 1.95% 07/30/30	3,650,000.00	4,330,798.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,370,000.00	3,847,781.75	
	SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,455,868.80	
	SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,288,843.60	
	SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,081,054.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	4,982,212.20	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,850,000.00	3,166,719.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,935,441.05	
	SPGB 4.2% 01/31/37	3,490,000.00	5,571,994.40	
	SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,078,728.75	
	SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	5,096,745.55	
	SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	7,083,564.20	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,732,574.75	
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,181,667.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	3,300,000.00	5,938,152.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,727,354.40	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,590,000.00	5,056,120.30	
	SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,809,716.90	
	SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,551,418.90	
	SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	7,254,616.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,917,099.40	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,908,818.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,628,665.50	
	ユーロ 小計	1,019,570,000.00	1,242,519,637.95 (146,642,167,670)	
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,762,403.15	
	UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	6,032,796.55	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,430,000.00	1,483,031.55	
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,248,071.50	
	UKT 1.5% 01/22/21	3,120,000.00	3,162,572.40	
	UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,439,521.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	5,040,000.00	5,700,492.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	5,750,000.00	6,371,661.25	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,330,000.00	1,610,935.90	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,604,082.00	
	UKT 1.75% 01/22/49	2,310,000.00	2,777,289.90	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,525,596.25	

UKT 1.75% 09/07/22	4,170,000.00	4,346,307.60	
UKT 1.75% 09/07/37	4,920,000.00	5,636,204.40	
UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,192,116.90	
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,692,550.00	
UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,765,199.50	
UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,746,731.75	
UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,394,953.05	
UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,983,821.55	
UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	5,277,098.40	
UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	7,502,250.70	
UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,902,983.20	
UKT 3.75% 09/07/20	8,060,000.00	8,304,177.70	
UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	4,015,408.15	
UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,587,466.60	
UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,329,660.00	
UKT 4.25% 09/07/39	2,450,000.00	3,963,573.25	
UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	883,237.55	
UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	5,014,566.00	
UKT 4.25% 12/07/46	3,950,000.00	7,077,412.50	
UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	4,040,670.20	
UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,581,599.20	
UKT 4.5% 09/07/34	3,170,000.00	4,868,644.50	
UKT 4.5% 12/07/42	3,910,000.00	6,818,160.25	
UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,966,274.70	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,215,579.00	
UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	6,096,012.75	
UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,125,773.00	
UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,136,525.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,882,481.25	
UKT 8% 06/07/21	740,000.00	834,886.50	
イギリスポンド 小計	139,210,000.00	185,900,778.60 (24,667,174,312)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	8,246,377.65
	SGB 0.75% 11/12/29	7,590,000.00	8,401,029.45
	SGB 1.5% 11/13/23	16,650,000.00	18,120,944.25
	SGB 1% 11/12/26	11,970,000.00	13,248,036.90
	SGB 2.5% 05/12/25	12,740,000.00	14,965,678.00
	SGB 3.5% 03/30/39	8,580,000.00	14,152,409.70
	SGB 3.5% 06/01/22	17,590,000.00	19,553,747.60
	SGB 5% 12/01/20	18,910,000.00	20,153,143.40
スウェーデンクローナ 小計	101,520,000.00	116,841,366.95 (1,287,591,863)	

ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	7,460,000.00	7,588,647.70
	NGB 1.75% 02/17/27	7,460,000.00	7,749,746.40
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	5,959,848.00
	NGB 1.75% 09/06/29	5,140,000.00	5,397,822.40
	NGB 2% 04/26/28	6,190,000.00	6,587,676.55
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,787,894.40
	NGB 3.75% 05/25/21	16,540,000.00	17,227,154.30
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,701,324.50
ノルウェークローネ 小計		71,980,000.00	75,000,114.25 (891,001,357)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,516,325.00
	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	19,181,294.10
	DGB 0.5% 11/15/29	7,190,000.00	7,981,151.65
	DGB 1.5% 11/15/23	13,990,000.00	15,348,918.65
	DGB 1.75% 11/15/25	11,230,000.00	12,991,818.55
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	14,027,904.00
	DGB 4.5% 11/15/39	24,490,000.00	49,493,800.20
デンマーククローネ 小計		96,720,000.00	128,541,212.15 (2,032,236,564)
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,810,000.00	7,847,331.80
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,788,350.85
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,027,039.30
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	7,035,819.60
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,690,913.10
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	7,041,612.40
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,520,000.00	6,919,415.20
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,960,000.00	3,161,605.60
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,614,743.20
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,714,195.60
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,785,012.20
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,110,000.00	3,243,170.20
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	805,605.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,750,000.00	5,320,665.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,693,845.00
ポーランドズロチ 小計		77,890,000.00	81,689,324.05 (2,200,710,389)
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	2,470,000.00	2,604,195.10
	ACGB 1.75% 11/21/20	6,310,000.00	6,379,031.40
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,420,994.20
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,064,491.05
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,540,000.00	4,084,168.80
	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,610,884.30
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	990,236.00

	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,746,988.10	
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,577,137.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	5,410,000.00	6,260,208.55	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,228,703.30	
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,796,350.40	
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,649,909.60	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,944,830.45	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,570,000.00	2,075,296.65	
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,217,341.20	
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,266,383.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	6,370,000.00	7,759,679.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,792,839.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,259,685.80	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,672,820.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,246,954.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,071,056.55	
	オーストラリアドル 小計	90,090,000.00	104,720,184.85	(7,632,007,071)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	982,228.50	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	802,332.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	780,000.00	781,879.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	873,196.50	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,606,448.55	
	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	736,417.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	653,905.35	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	279,253.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,125,936.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,506,516.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	830,000.00	943,747.35	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,663,208.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	617,178.80	
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	743,686.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	415,846.60	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,146,073.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,085,675.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,140,000.00	1,352,621.40	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,190,000.00	1,339,226.00	
	SIGB 3% 09/01/24	1,570,000.00	1,669,082.70	
	シンガポールドル 小計	19,110,000.00	20,324,459.65	(1,586,933,809)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,522,350.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,723,827.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,709,783.20	

	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,719,347.90
	MGS 3.659% 10/15/20	2,360,000.00	2,373,487.40
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,320,065.50
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	356,200.25
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,527,952.50
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,224,827.40
	MGS 3.844% 04/15/33	2,990,000.00	3,050,697.00
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	763,897.50
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,058,448.60
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,158,645.50
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,023,810.55
	MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,670,591.40
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,786,089.50
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,086,408.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,969,720.50
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	2,150,644.75
	MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,767,599.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,613,015.25
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,125,000.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,491,014.00
	MGS 4.392% 04/15/26	3,160,000.00	3,339,725.00
	MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,283,032.80
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,664,917.50
	MGS 4.736% 03/15/46	2,270,000.00	2,579,242.10
	MGS 4.762% 04/07/37	3,370,000.00	3,861,565.05
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	932,932.00
	MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,815,615.75
	MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,682,683.20
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	677,901.00
	マレーシアリングット 小計	65,780,000.00	69,031,037.60 (1,778,929,838)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	46,150,000.00	51,575,624.75
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	8,006,250.40
	SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,421,981.75
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,714,980.00
	SAGB 7.75% 02/28/23	17,600,000.00	17,783,568.00
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,842,777.70
	SAGB 8.25% 03/31/32	25,870,000.00	23,850,070.40
	SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	24,324,147.00
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,236,291.40
	SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	39,983,674.50
	SAGB 8.875% 02/28/35	21,250,000.00	20,034,393.75

	SAGB 8% 01/31/30	29,930,000.00	27,970,033.95	
	SAGB 9% 01/31/40	19,620,000.00	18,140,848.20	
	南アフリカランド 小計	315,260,000.00	292,884,641.80 (2,085,338,649)	
	合計		385,211,771,402 (385,211,771,402)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 204銘柄	100.0%	47.8%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 300銘柄	100.0%	38.1%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【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19期中間計算期間(2019年10月1日から2020年3月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DCマイセレクション75】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 (2019年 9月30日現在)	第19期中間計算期間 (2020年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,545,372,507	1,510,114,756
親投資信託受益証券	50,216,372,731	45,800,817,847
未収入金	93,760,000	-
流動資産合計	51,855,505,238	47,310,932,603
資産合計	51,855,505,238	47,310,932,603
負債の部		
流動負債		
未払解約金	59,846,062	19,344,344
未払受託者報酬	8,158,631	8,733,177
未払委託者報酬	78,866,646	84,420,623
未払利息	3,754	4,059
その他未払費用	1,723,113	887,959
流動負債合計	148,598,206	113,390,162
負債合計	148,598,206	113,390,162
純資産の部		
元本等		
元本	23,546,671,519	23,331,149,115
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	28,160,235,513	23,866,393,326
(分配準備積立金)	14,500,076,105	13,323,040,201
元本等合計	51,706,907,032	47,197,542,441
純資産合計	51,706,907,032	47,197,542,441
負債純資産合計	51,855,505,238	47,310,932,603

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2018年10月 2日 至 2019年 4月 1日	第19期中間計算期間 自 2019年10月 1日 至 2020年 3月31日
営業収益		
受取利息	162	1,203
有価証券売買等損益	2,836,968,410	3,979,714,884
営業収益合計	2,836,968,248	3,979,713,681
営業費用		
支払利息	603,546	339,568
受託者報酬	7,975,553	8,733,177
委託者報酬	77,096,940	84,420,623
その他費用	916,448	888,069
営業費用合計	86,592,487	94,381,437
営業利益又は営業損失（ ）	2,923,560,735	4,074,095,118
経常利益又は経常損失（ ）	2,923,560,735	4,074,095,118
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,923,560,735	4,074,095,118
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（ ）	194,970,066	14,701,654
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	30,154,482,179	28,160,235,513
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,828,223,357	2,174,729,791
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,828,223,357	2,174,729,791
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,450,467,530	2,379,775,206
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,450,467,530	2,379,775,206
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	27,803,647,337	23,866,393,326

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第18期 (2019年 9月30日現在)	第19期中間計算期間 (2020年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,546,671,519口	23,331,149,115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) 2.1959円 (21,959円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0229円 (20,229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19期中間計算期間 (2020年 3月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第19期中間計算期間 (2020年 3月31日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第18期 自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日	第19期中間計算期間 自 2019年10月 1日 至 2020年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	22,839,035,740円	23,546,671,519円
期中追加設定元本額	3,074,624,736円	1,768,758,626円
期中一部解約元本額	2,366,988,957円	1,984,281,030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

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,462,344,079
株式	278,084,056,570

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	108,254,800
未収入金	150,440,000
未収配当金	3,689,823,329
前払金	83,941,550
差入委託証拠金	534,031,200
流動資産合計	286,112,891,528
資産合計	286,112,891,528
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	192,224,950
未払金	20,305,500
未払解約金	168,059,990
未払利息	9,306
流動負債合計	380,599,746
負債合計	380,599,746
純資産の部	
元本等	
元本	215,676,267,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,056,024,391
元本等合計	285,732,291,782
純資産合計	285,732,291,782
負債純資産合計	286,112,891,528

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月31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>

2020年 3月31日現在	
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）

2020年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	215,676,267,391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 1.3248円 (1万口当たり純資産額) (13,248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

2020年 3月31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>

	2020年 3月31日現在

（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	2020年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	207,951,200,444円
期中追加設定元本額	29,969,761,206円
期中一部解約元本額	22,244,694,259円
期末元本額	215,676,267,391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）	592,989,209円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,001,383,233円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,199,044円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,630,403,729円
世界経済インデックスファンド	2,141,900,972円
日本株式インデックス・オープン	4,349,908,700円
D C マイセレクション 2 5	7,605,626,222円
D C マイセレクション 5 0	19,995,149,703円
D C マイセレクション 7 5	17,577,886,062円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,729,051,329円
D C マイセレクション S 2 5	3,167,360,279円
D C マイセレクション S 5 0	8,343,357,281円
D C マイセレクション S 7 5	5,163,813,669円
D C 日本株式インデックス・オープン S	6,890,642,445円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	337,999,390円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	766,926,022円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	505,185,827円
D C 世界経済インデックスファンド	2,839,578,144円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,063,201,671円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,001,542円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	36,537,652円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	40,287,416円

区分	2020年 3月31日現在
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	273,964,505円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,765,336円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	77,183,583円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	259,870,679円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	56,816,289円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	336,075,521円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,855,889,689円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	721,807,410円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,355,715,905円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	638,155,991円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	43,282,825円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	804,623,687円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	36,995,498円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	471,980,935円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	597,040,485円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	57,354,066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）	845,167,258円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,925,074,305円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,084,122,027円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	6,481,723,918円
分散投資コア戦略ファンドS	18,222,622,901円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	308,231,695円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	340,153,862円
コア投資戦略ファンド（切替型）	561,696,405円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,307,790円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,590,544円
SMT インデックスバランス・オープン	68,176,877円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	13,122,045,633円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	19,934,839円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	69,814,452円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	12,327,835円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,335,519円
グローバル経済コア	268,425,313円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,369,643円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	45,194,253円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,796,332円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	239,188,128円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,642,992円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	82,015円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	115,808円

区分	2020年 3月31日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	53,399円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	26,167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）	52,226,477,229円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	589,532,116円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	24,694,481円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	17,796,798円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 3月31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	7,561,931,550	-	7,477,990,000	83,941,550
	合計	7,561,931,550	-	7,477,990,000	83,941,550

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,227,865,938
国債証券	448,050,550,450
地方債証券	29,119,683,915
特殊債券	35,698,139,810
社債券	23,441,814,600
未収入金	1,593,153,900
未収利息	561,441,711
前払費用	8,083,786
流動資産合計	541,700,734,110
資産合計	541,700,734,110
負債の部	
流動負債	
未払金	4,496,290,980
未払解約金	183,941,841
未払利息	8,676
流動負債合計	4,680,241,497

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
負債合計	4,680,241,497
純資産の部	
元本等	
元本	379,552,519,382
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	157,467,973,231
元本等合計	537,020,492,613
純資産合計	537,020,492,613
負債純資産合計	541,700,734,110

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	379,552,519,382口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,647,000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 1.4149円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,149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

	2020年 3月31日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	379,521,438,312円
期中追加設定元本額	29,257,821,219円
期中一部解約元本額	29,226,740,149円
期末元本額	379,552,519,382円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,633,762,106円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,602,060円
S M T 国内債券インデックス・オープン	18,595,107,412円
世界経済インデックスファンド	1,911,849,940円

区分	2020年 3月31日現在
DCマイセレクション25	20,470,715,188円
DCマイセレクション50	21,495,960,890円
DCマイセレクション75	5,618,192,014円
DC日本債券インデックス・オープン	457,676,226円
DC日本債券インデックス・オープンS	89,513,017,977円
DC日本債券インデックス・オープンP	68,940,007,201円
DCマイセレクションS25	8,565,110,184円
DCマイセレクションS50	8,970,137,447円
DCマイセレクションS75	1,650,521,576円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,073,788,885円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,317,588,334円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	438,899,746円
DC世界経済インデックスファンド	2,542,866,396円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	66,197,677円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	5,096,715円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	40,184,195円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,020,141円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	831,352円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	146,142,160円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	205,337,830円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	55,628,100円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	86,774,565円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,845,994,844円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	823,133,477円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,070,565,928円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	671,112,760円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	82,807,769円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,110,968,770円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	24,697,883円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,288,633,502円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,640,483,680円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	146,762,162円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,713,574,733円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,705,935,753円
分散投資コア戦略ファンドA	11,470,976,711円
分散投資コア戦略ファンドS	10,369,691,619円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	84,019,538円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	904,984,982円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	45,968,477円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,630,349円
SMT インデックスバランス・オープン	56,952,249円
SMT 世界経済インデックス・オープン	12,410,132円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	24,542,517円

区分	2020年 3月31日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	35,935,499円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,781,245円
グローバル経済コア	222,635,973円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	14,498,405円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	1,212,426円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	72,376円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	103,752円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	30,659円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	6,381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)	70,297,686,533円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	23,464,741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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 3月31日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,063,667,903
コール・ローン	1,332,818,313
株式	312,456,956,652
投資信託受益証券	213,865,636
投資証券	8,458,160,627
派生商品評価勘定	1,267,048,642
未収入金	5,366,057
未収配当金	618,846,497
差入委託証拠金	6,500,944,115
流動資産合計	338,917,674,442
資産合計	338,917,674,442
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,533,694
前受金	1,249,145,292
未払金	114,092,418
未払解約金	74,024,319
未払利息	3,582
流動負債合計	1,445,799,305
負債合計	1,445,799,305
純資産の部	
元本等	
元本	149,458,546,758
剰余金	

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	188,013,328,379
元本等合計	337,471,875,137
純資産合計	337,471,875,137
負債純資産合計	338,917,674,442

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月31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>
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>

	2020年 3月31日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	149,458,546,758口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.2580円 (1万口当たり純資産額) (22,580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

	2020年 3月31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

	2020年 3月31日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	2020年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	139,822,058,208円
期中追加設定元本額	23,878,012,919円
期中一部解約元本額	14,241,524,369円
期末元本額	149,458,546,758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）	2,362,047,406円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,845,974円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,471,968,135円
世界経済インデックスファンド	8,104,857,043円
外国株式インデックス・オープン	821,211,330円
D C マイセレクション 2 5	1,002,853,662円
D C マイセレクション 5 0	5,283,170,595円
D C マイセレクション 7 5	5,416,236,721円
D C 外国株式インデックス・オープン	9,113,807,796円
D C マイセレクション S 2 5	418,858,401円

区分	2020年 3月31日現在
DCマイセレクションS50	2,204,613,703円
DCマイセレクションS75	1,591,167,196円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	90,533,358円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	224,844,929円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	145,672,241円
DC世界経済インデックスファンド	10,482,365,259円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	2,027,218,513円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,322,191円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,582,811円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	37,952,787円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	44,413,924円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	160,261,711円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	29,782,077円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	198,856,439円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	672,165,666円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	392,496,292円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,556,944,837円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,966,937,282円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	79,429,866円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	352,432,243円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	9,129,824円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	107,530,457円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,025,028,928円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,213,828,100円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,044,531,820円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,147,459,980円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,268,074,755円
分散投資コア戦略ファンドA	2,764,375,374円
分散投資コア戦略ファンドS	8,222,047,058円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,100,495,818円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,300,418,588円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,164,578,575円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	750,934,809円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	39,796,818円
SMT インデックスバランス・オープン	247,059,818円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,207,813,997円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,591,836,852円
SMT 世界経済インデックス・オープン	111,863,115円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	371,704,472円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	75,943,293円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,984,333円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	62,373,878円
グローバル経済コア	996,742,522円

区分	2020年 3月31日現在
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,184,653円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	824,891円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	492,227,230円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	75,904,900円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	275,554円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	399,830円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	189,869円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	93,466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）	1,283,393,879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）	1,240,144,837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）	1,773,607,671円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	122,458,669円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	105,598,090円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	423,022,144円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	822,817,503円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 3月31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	15,025,441,680	-	16,274,586,972	1,249,145,292
	合計	15,025,441,680	-	16,274,586,972	1,249,145,292

（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

（2020年 3月31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	1,268,929,494	-	1,278,299,150	9,369,656
	アメリカドル	922,981,780	-	931,925,870	8,944,090

カナダドル	41,952,232	-	41,971,320	19,088
ユーロ	142,330,998	-	142,491,680	160,682
イギリスポンド	38,863,870	-	38,792,000	71,870
スイスフラン	40,492,687	-	40,638,800	146,113
スウェーデンク ローナ	12,993,619	-	12,970,800	22,819
ノルウェークロー ネ	5,711,064	-	5,781,000	69,936
デンマーククロー ネ	13,116,720	-	13,120,000	3,280
オーストラリアド ル	39,376,924	-	39,383,680	6,756
香港ドル	11,109,600	-	11,224,000	114,400
合計	1,268,929,494	-	1,278,299,150	9,369,656

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 3月31日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	99,550,342
コール・ローン	4,079,572,363
国債証券	386,523,048,850
派生商品評価勘定	91,149,929
未収入金	38,801,950
未収利息	2,698,348,438
前払費用	102,837,182
差入委託証拠金	503,384,826
流動資産合計	394,136,693,880
資産合計	
394,136,693,880	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,700,085
前受金	75,448,910
未払金	17,991,302
未払解約金	1,396,485,396
未払利息	10,965
流動負債合計	1,496,636,658
負債合計	
1,496,636,658	
純資産の部	
元本等	
元本	134,837,064,235

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	257,802,992,987
元本等合計	392,640,057,222
純資産合計	392,640,057,222
負債純資産合計	394,136,693,880

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		134,837,064,235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)	2.9120円 (29,120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

	2020年 3月31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	2020年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	139,801,569,209円
期中追加設定元本額	10,361,529,844円
期中一部解約元本額	15,326,034,818円
期末元本額	134,837,064,235円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,650,531,105円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	627,828,701円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	448,133,431円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,012,718,695円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,906,861円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,598,489,552円
世界経済インデックスファンド	6,282,312,174円
D C マイセレクション 2 5	1,750,062,580円
D C マイセレクション 5 0	1,303,691,890円
D C マイセレクション 7 5	801,714,285円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,961,483,321円
D C マイセレクション S 2 5	729,139,714円
D C マイセレクション S 5 0	544,032,781円
D C マイセレクション S 7 5	235,531,786円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	43,438,073円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	63,881,377円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	29,955,870円
D C 世界経済インデックスファンド	8,365,580,618円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	606,893,351円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	30,660,722円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,444,495円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,714,185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）	46,281,286円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	82,979,690円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	118,601,065円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	136,287,645円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	240,520,610円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,866,241,877円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	499,147,229円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,821,646,316円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	695,850,876円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	65,607,451円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	534,864,829円

区分	2020年 3月31日現在
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	30,388,277円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	217,398,292円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	272,625,283円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	910,884,946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）	2,036,427,839円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	749,217,932円
外国債券ファンド・シリーズ1	595,985,015円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンドA	1,620,550,045円
分散投資コア戦略ファンドS	5,911,115,011円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	297,143,474円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,735,682,866円
コア投資戦略ファンド（切替型）	563,477,235円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	196,276,405円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,077,505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）	1,052,262,634円
SMT インデックスバランス・オープン	174,632,072円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	19,832,270,434円
SMT 世界経済インデックス・オープン	84,134,369円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	95,512,200円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	162,208,055円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,473,060円
グローバル経済コア	825,420,266円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	8,010,960円
DCターゲット・イヤーフンド2055	138,864円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	218,715,325円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,162,672円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	54,921円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	121,637円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	57,235円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	28,522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）	602,687,638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）	10,657,600,261円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	347,459,529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）	40,492,974,649円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	104,154,952円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2020年 3月31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	2,792,353,964	-	2,867,802,874	75,448,910
	合計	2,792,353,964	-	2,867,802,874	75,448,910

(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

(2020年 3月31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	2,803,472,066	-	2,812,473,000	9,000,934
	アメリカドル	1,386,720,274	-	1,382,918,400	3,801,874
	カナダドル	114,568,045	-	116,340,800	1,772,755
	ユーロ	1,103,343,807	-	1,105,375,000	2,031,193
	イギリスポンド	198,839,940	-	207,838,800	8,998,860
	合計	2,803,472,066	-	2,812,473,000	9,000,934

(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75】

【純資産額計算書】

(2020年 4月30日現在)

資産総額	49,333,942,665円
負債総額	57,987,021円
純資産総額(-)	49,275,955,644円
発行済口数	23,291,534,857口
1口当たり純資産額(/)	2.1156円
(1万口当たり純資産額)	(21,156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

(2020年 4月30日現在)

資産総額	294,798,535,703円
負債総額	1,636,182,762円
純資産総額(-)	293,162,352,941円
発行済口数	212,102,266,945口
1口当たり純資産額(/)	1.3822円
(1万口当たり純資産額)	(13,822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

(2020年 4月30日現在)

資産総額	540,922,670,695円
負債総額	3,860,343,332円
純資産総額(-)	537,062,327,363円
発行済口数	378,280,330,209口
1口当たり純資産額(/)	1.4197円
(1万口当たり純資産額)	(14,197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

(2020年 4月30日現在)

資産総額	382,511,487,117円
負債総額	1,411,196,025円
純資産総額（ - ）	381,100,291,092円
発行済口数	153,717,598,248口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4792円
（1万口当たり純資産額）	（24,792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

(2020年 4月30日現在)

資産総額	270,337,252,888円
負債総額	177,950,414円
純資産総額（ - ）	270,159,302,474円
発行済口数	94,397,910,521口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8619円
（1万口当たり純資産額）	（28,619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（2020年 4月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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、監査等委員以外の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2020年 6月30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。

2020年4月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	542	12,099,508
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	289,453
単位型公社債投資信託	26	199,687
合計	647	12,588,648

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

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。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 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33期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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 (2018年3月31日現在)		当事業年度 (2019年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		23,973,152		23,830,484
有価証券		-		2,268,127
前払費用		157,614		197,843
未収委託者報酬		5,373,307		6,351,590
未収運用受託報酬		-		5,525,778
未収収益		896		212,722
その他		8,946		2,261,900
流動資産合計		29,513,917		40,648,447
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	36,782	1	282,407
器具備品	1	79,655	1	564,981
その他	1	1,912	1	14,462
有形固定資産合計		118,350		861,851
無形固定資産				
ソフトウェア		210,679		1,487,265
その他		4,377		7,256
無形固定資産合計		215,056		1,494,522
投資その他の資産				
投資有価証券		42,802		11,334,053
関係会社株式		-		4,663,000
長期貸付金		17,088		-
繰延税金資産		248,633		141,789
その他		32,880		32,492
貸倒引当金		17,088		-
投資その他の資産合計		324,317		16,171,335
固定資産合計		657,724		18,527,709
資産合計		30,171,641		59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日現在）	当事業年度 （2019年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240

営業利益	5,516,262	8,554,888
------	-----------	-----------

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
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			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	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	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算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. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 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。

6. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. 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。

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）

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、当事業年度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、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期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）

「『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）を当事業年度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。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017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
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
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

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

2019年6月27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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと

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

有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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（2018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) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

(*) 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（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

（*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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。

（4）有価証券及び投資有価証券

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、及び（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。

（7）デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位：千円）

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019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、「(4)有価証券及び投資有価証券 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（2018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	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度（2019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	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（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

当事業年度（2019年3月31日）

（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	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585

合計	13,602,178	13,035,220	566,957
----	------------	------------	---------

(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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018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

当事業年度（2019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
1,538,203	46,789	34,437

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
スイスフラン	1,110	-	5	5	
香港ドル	560	-	4	4	
ユーロ	2,492	-	0	0	
合計	1,346,753	-	7,916	7,916	

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計		6,739,103	-	8,766	8,766

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式				
	米ドル		3,432,867	-	13,731	
	英ポンド		2,575,513	-	50,256	
	カナダドル		40,963	-	566	
	スイスフラン		34,448	-	132	
	香港ドル		566,113	-	2,528	
	人民元		1,725,146	-	9,137	
	ユーロ		262,583	-	6,080	
	買建					
	ユーロ		6,313	-	86	
	合計		8,643,951	-	82,081	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(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15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"

退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	
有価証券評価差額	-		173,602	"
繰延ヘッジ損益	-		58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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。

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

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

企業結合日

2018年10月1日

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

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)

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)実施した会計処理の概要

「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しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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いません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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	9,571,581	未払 手数料	1,568,277
							投資助言費用	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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継			
							(承継資産合計)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	無対価		

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

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

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。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

(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（2018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（2019年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
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：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826
固定資産		
有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780
資産合計		62,606
負債の部		
流動負債		
未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216
固定負債		
退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	2	1,110
営業外費用	3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		18
法人税等合計		2,179

中間純利益

4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
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	2,000	17,239	17,239

	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	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
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	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日
至 2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

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．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、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。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．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。

7．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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。

(2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
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」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019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 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

（金融商品関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

2019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：百万円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(7)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)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並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

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。

(6)未払金

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。

(7)デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円）は、市場

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

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

（デリバティブ取引関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引				
為替予約取引				
売建				
米ドル	872	-	1	1
英ポンド	52	-	0	0
カナダドル	2	-	0	0
スイスフラン	6	-	0	0
香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2
合計	1,285	-	5	5

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
合計			5,046	-	48

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(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34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019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34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019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34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83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34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
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)

該当事項はありません。

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

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年6月30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（2019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） （2019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。
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（2019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。

再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

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みます。）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

2019年6月5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 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員

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2019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

2019年11月29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75の2018年10月2日から2019年9月30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75の2019年9月30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

2019年12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019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2019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（2019年4月1日から2019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

2020年5月29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75の2019年10月1日から2020年3月31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、DCマイセレクション75の2020年3月31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（2019年10月1日から2020年3月31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。