

## 【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】	平成28年8月10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】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【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】	S B I 資産設計オープン（資産成長型）
【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】

SBI資産設計オープン（資産成長型）

愛称として「スゴ6」という名称を用いることがあります。

### （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】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金によるお申込みについては1円以上1円単位とします。

**( 7 ) 【申込期間】**

平成28年 8月11日から平成29年 2月10日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所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号ロ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。

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券（以下「J-REIT」「海外REIT」とい  
うことがあります。）に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の中長期的な成長を  
目指します。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

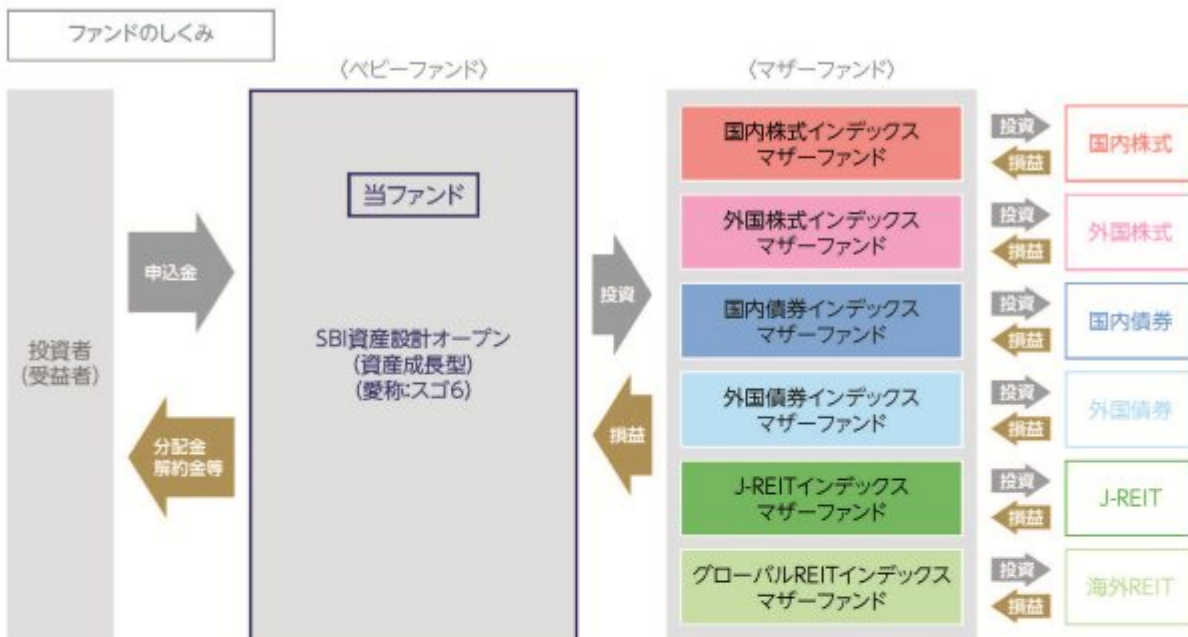
#### [ 特殊型 ]

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

< ファンドの特色 >

## 1. 国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券の6資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



※各マザーファンド（J-REITインデックス マザーファンドを除く）の運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

### ? ファミリーファンド方式とは

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

### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各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

●基本組入比率に従って、各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

●各マザーファンドの組入比率が基本組入比率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。

## 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)
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
国内債券	NOMURA-BPI 総合
外国債券	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み)
海外REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

※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。

「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。

「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。

「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。

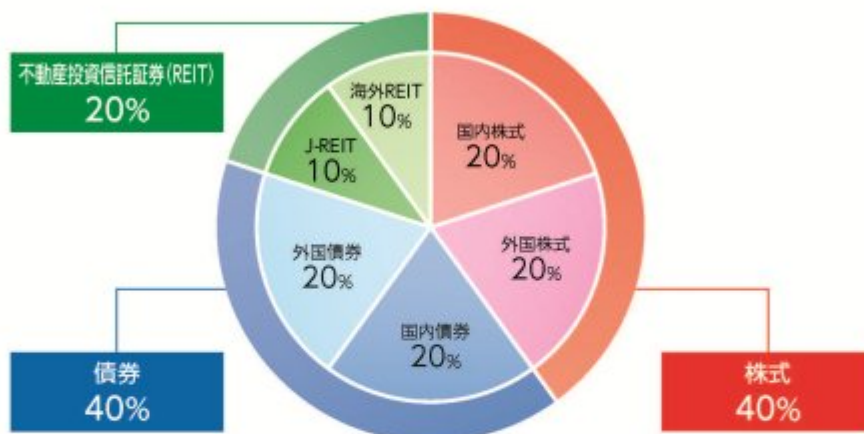
「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）はSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

### 3. 株式40%、債券40%、不動産投資信託証券(REIT)20%を基本組入比率として運用します。

#### 基本組入比率



- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

### 4. ノーロードファンドです。

- 購入時手数料が無料のノーロードファンドです。  
(運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して年率0.7344%(税抜0.68%)です。)

#### 分配方針

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

#### 主な投資制限

- 株式への直接投資は行いません。
- 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65%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】

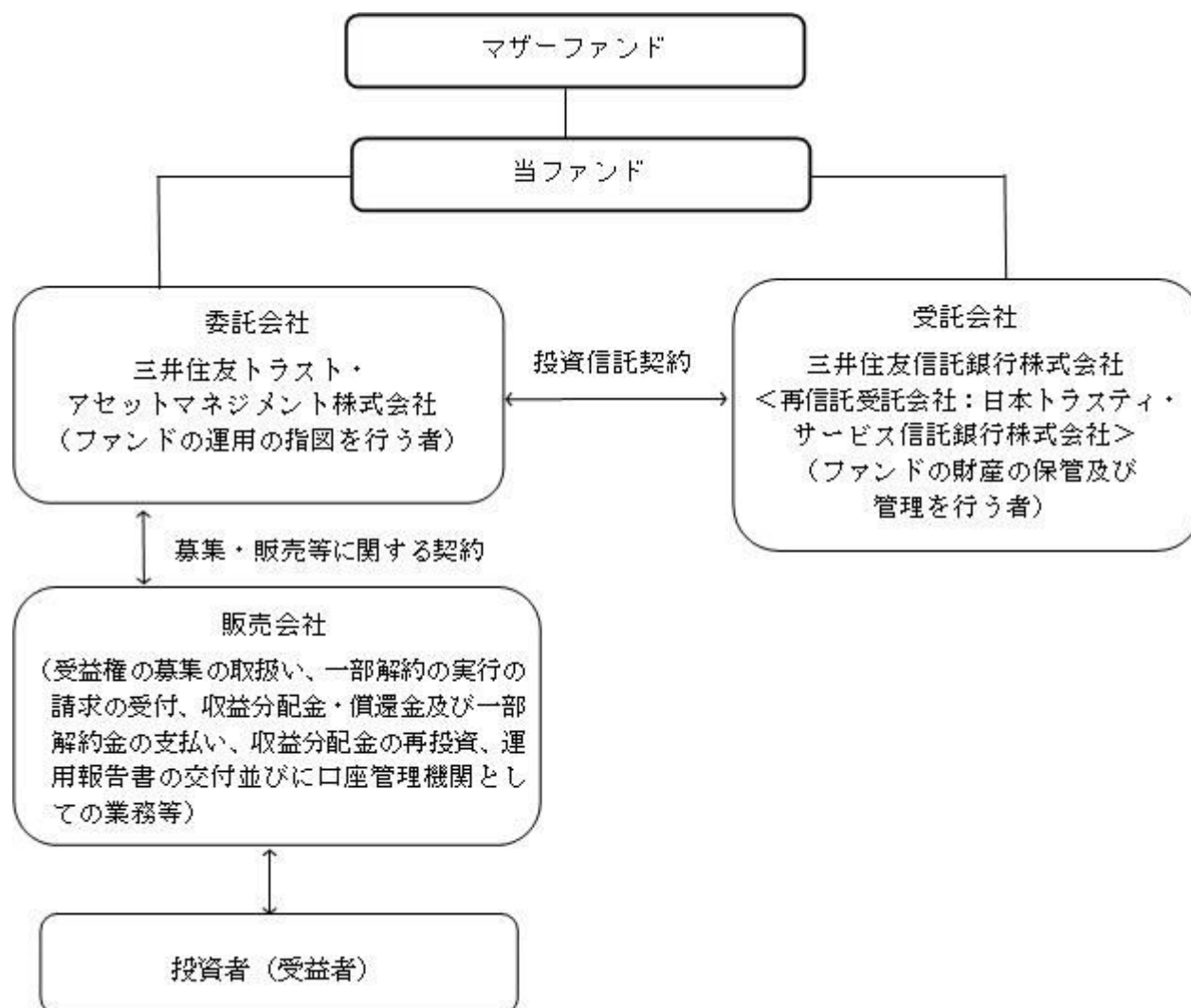
平成20年1月9日 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

平成24年4月1日

本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 J-REITインデックス マザーファンド」の名称を「J-REITインデックス マザーファンド」に、「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」の名称を「グローバルREITインデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

### （３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成28年 5月31日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

昭和61年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年2月20日：	投資顧問業の登録
昭和62年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
平成2年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11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
平成11年3月25日：	証券投資信託委託業の認可

- 平成19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）
- 平成24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

#### 八．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、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」および「グローバルREIT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」ということがあります。）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」ということがあります。）への投資を通じて、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

#### （ロ）運用方法

##### 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、主要投資対象の見直しおよび追加が行われる場合があります。

##### 投資態度

- 1)主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。
- 2)各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。

マザーファンド受益証券	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	10%

- 3)前記2)に定める各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 4)各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。
- 5)実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。



- 6) 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。
- 7) ただし、資金動向および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。

## （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（本邦通貨表示のものに限ります。）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．金銭債権

ハ．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6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7号から第11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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

2. 国内株式インデックス マザーファンド

3. 外国債券インデックス マザーファンド

4. 外国株式インデックス マザーファンド

5. J-REITインデックス マザーファンド

6. グローバルREITインデックス マザーファンド

7. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号の証券の性質を有するもの

9. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

11. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第9号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

（ハ）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

- (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)に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

## (参考)マザーファンドの概要

### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

運用の効率化をはかるため、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。

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効率的な運用に資するため、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。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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



こととなる投資の指図をしません。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所（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。

運用の効率化をはかるため、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。

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。

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。

## 「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、シティ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

シティ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。

運用の効率化をはかるため、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。

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。

## 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。

## 「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。

運用の効率化をはかるため、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効率的な運用ならびに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効率的な運用に資するため、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。

## 「J-REIT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、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 2. 運用方法

### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

## 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）および不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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、ならびに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

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、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「グローバルREIT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、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

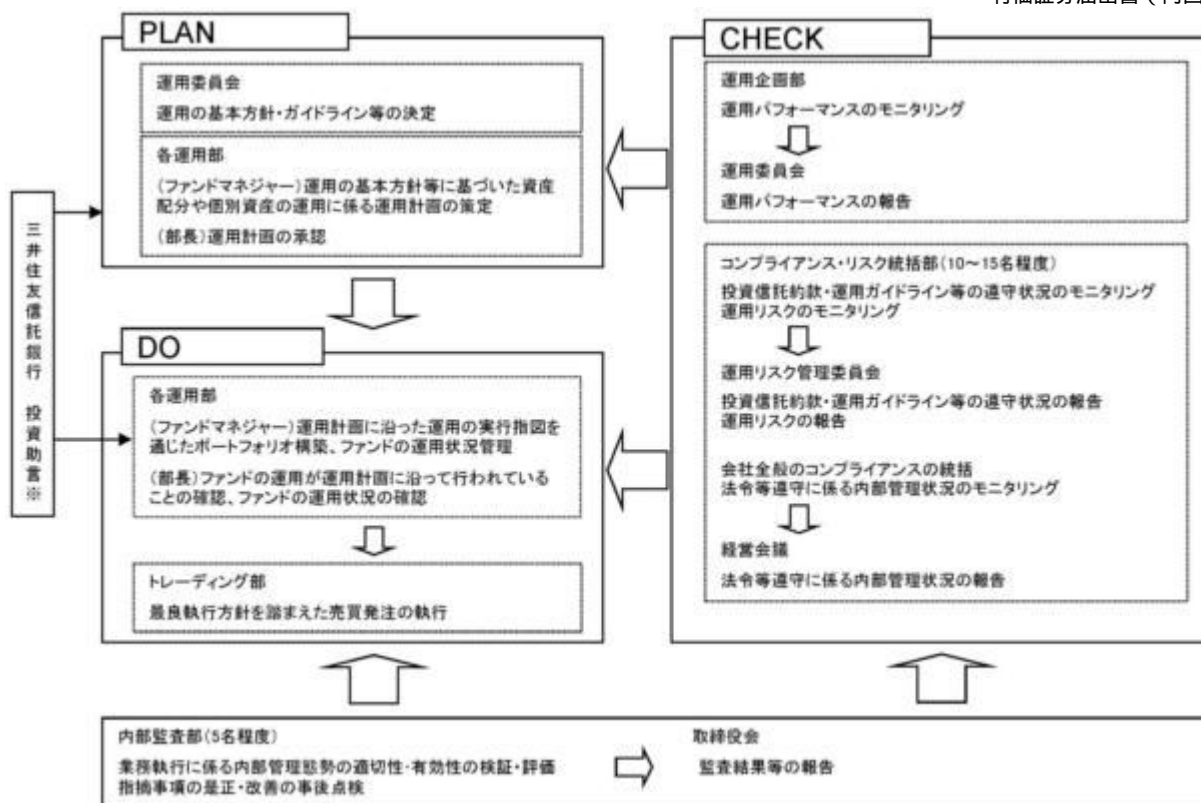
投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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

### (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。



三井住友信託銀行は各マザーファンド（「J-REITインデックス マザーファンド」を除く）に対して投資助言を行います。

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

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

#### （４）【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

株式への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

デリバティブへの直接投資は行いません。（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65%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（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ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入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26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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

前記における「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マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### <その他の投資制限>

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

### 3【投資リスク】

#### （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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なり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。

### リートの価格変動リスク

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

### 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コンプライアンス・リスク統括部が、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。

## 【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



\*2011年6月～2016年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

#### \*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>

先進国株… MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>※2</sup>

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)<sup>※3</sup>

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>※5</sup>

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

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

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

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

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

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募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。

※5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益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。同指数は、Citigroup Index LLC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すべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。

「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0.7344%（税抜 0.68%）（ ）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。

内訳 (純資産総額 に対し)	支払先	純資産総額			主な役務
		100億円以下の部分	100億円超300億円以下の部分	300億円超の部分	
	委託会社	年率 0.4104% (税抜 0.38%)	年率 0.3456% (税抜 0.32%)	年率 0.2808% (税抜 0.26%)	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 0.2808% (税抜 0.26%)	年率 0.3456% (税抜 0.32%)	年率 0.4104% (税抜 0.38%)	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 0.0432% (税抜 0.04%)	年率 0.0432% (税抜 0.04%)	年率 0.0432% (税抜 0.04%)	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に相当する額を、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（ ）、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、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

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。また、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

	税 率（内 訳）
平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び

譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

## 二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

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

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

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

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

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

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

### 確定拠出年金の場合

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、平成28年 5月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、平成28年 5月31日現在の状況について記載してあります。

### 【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

#### （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	22,517,373,945	98.42
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		360,550,670	1.58
合計（純資産総額）		22,877,924,615	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	2,403,243,887	2.0539	4,936,227,485	1.8977	4,560,635,924	19.93
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	3,769,301,485	1.3313	5,018,444,144	1.1873	4,475,291,653	19.56
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,619,808,643	2.8044	4,542,605,606	2.6669	4,319,867,670	18.88
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	2,859,998,088	1.3379	3,826,565,213	1.4119	4,038,031,300	17.65
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,613,902,969	1.4516	2,342,804,136	1.6298	2,630,339,058	11.50
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,529,481,836	1.6369	2,503,671,590	1.6301	2,493,208,340	10.90

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.42
合計	98.42

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末（平成20年11月10日）	994,679,991	994,679,991	7,198	7,198
第2期計算期間末（平成21年11月10日）	1,764,446,119	1,764,446,119	7,679	7,679
第3期計算期間末（平成22年11月10日）	2,508,787,040	2,508,787,040	7,788	7,788
第4期計算期間末（平成23年11月10日）	3,227,431,682	3,227,431,682	7,290	7,290
第5期計算期間末（平成24年11月12日）	4,476,232,662	4,476,232,662	7,995	7,995
第6期計算期間末（平成25年11月11日）	7,540,466,177	7,554,112,856	11,051	11,071
第7期計算期間末（平成26年11月10日）	12,528,899,676	12,548,085,801	13,060	13,080
第8期計算期間末（平成27年11月10日）	20,717,882,420	20,717,882,420	13,952	13,952
平成27年 5月末日	17,751,607,973		14,491	
6月末日	18,116,143,616		14,101	
7月末日	19,090,523,050		14,322	
8月末日	18,755,325,295		13,614	
9月末日	18,874,255,925		13,215	
10月末日	20,541,362,812		13,944	
11月末日	21,084,751,631		14,027	
12月末日	21,423,693,736		13,871	
平成28年 1月末日	21,274,755,724		13,403	
2月末日	20,906,236,289		12,954	
3月末日	22,104,771,487		13,415	
4月末日	22,227,291,508		13,306	
5月末日	22,877,924,615		13,440	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成20年 1月 9日～平成20年11月10日	0
第2期計算期間	平成20年11月11日～平成21年11月10日	0

第3期計算期間	平成21年11月11日～平成22年11月10日	0
第4期計算期間	平成22年11月11日～平成23年11月10日	0
第5期計算期間	平成23年11月11日～平成24年11月12日	0
第6期計算期間	平成24年11月13日～平成25年11月11日	20
第7期計算期間	平成25年11月12日～平成26年11月10日	20
第8期計算期間	平成26年11月11日～平成27年11月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成20年 1月 9日～平成20年11月10日	28.0
第2期計算期間	平成20年11月11日～平成21年11月10日	6.7
第3期計算期間	平成21年11月11日～平成22年11月10日	1.4
第4期計算期間	平成22年11月11日～平成23年11月10日	6.4
第5期計算期間	平成23年11月11日～平成24年11月12日	9.7
第6期計算期間	平成24年11月13日～平成25年11月11日	38.5
第7期計算期間	平成25年11月12日～平成26年11月10日	18.4
第8期計算期間	平成26年11月11日～平成27年11月10日	6.8
第9期中間計算期間	平成27年11月11日～平成28年 5月10日	5.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	平成20年 1月 9日～平成20年11月10日	1,620,495,479	238,628,571	1,381,866,908
第2期計算期間	平成20年11月11日～平成21年11月10日	1,146,528,947	230,541,088	2,297,854,767
第3期計算期間	平成21年11月11日～平成22年11月10日	1,325,647,358	402,047,721	3,221,454,404
第4期計算期間	平成22年11月11日～平成23年11月10日	1,745,390,853	539,609,788	4,427,235,469
第5期計算期間	平成23年11月11日～平成24年11月12日	1,886,342,012	715,055,600	5,598,521,881
第6期計算期間	平成24年11月13日～平成25年11月11日	2,961,482,673	1,736,664,711	6,823,339,843
第7期計算期間	平成25年11月12日～平成26年11月10日	4,666,930,535	1,897,207,667	9,593,062,711
第8期計算期間	平成26年11月11日～平成27年11月10日	7,846,529,569	2,590,666,593	14,848,925,687
第9期中間計算期間	平成27年11月11日～平成28年 5月10日	3,064,491,026	1,103,716,067	16,809,700,646

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

国内債券インデックス 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	261,043,042,300	81.52
	ポーランド	201,310,000	0.06
	メキシコ	100,858,000	0.03
	小計	261,345,210,300	81.61
地方債証券	日本	18,396,449,670	5.74
特殊債券	日本	24,592,379,631	7.68
社債券	日本	12,823,338,550	4.00
	オーストラリア	403,527,000	0.13
	フランス	301,022,000	0.09
	オランダ	201,950,000	0.06
	スウェーデン	200,929,000	0.06
	アメリカ	100,590,000	0.03
	小計	14,031,356,550	4.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,869,133,744	0.58
合計(純資産総額)		320,234,529,895	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	日本	608,120,000	0.19

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	101.12	4,439,343,600	101.14	4,440,177,700	0.300	2018/6/20	1.39
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	4,100,000,000	102.17	4,189,299,900	102.18	4,189,421,000	0.100	2026/3/20	1.31



日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,830,000,000	101.14	3,873,776,900	101.15	3,874,236,500	0.200	2018/12/20	1.21
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	101.43	3,661,767,400	101.47	3,663,319,700	0.100	2020/9/20	1.14
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,560,000,000	101.20	3,602,720,000	101.23	3,603,966,000	0.100	2019/12/20	1.13
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,520,000,000	101.25	3,564,140,800	101.26	3,564,598,400	0.200	2019/3/20	1.11
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	101.35	3,557,455,200	101.38	3,558,508,200	0.200	2019/6/20	1.11
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	3,480,000,000	101.51	3,532,826,400	101.56	3,534,427,200	0.100	2020/12/20	1.10
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	3,260,000,000	100.58	3,278,973,200	100.59	3,279,364,400	0.200	2017/9/20	1.02
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,080,000,000	105.09	3,236,926,000	105.09	3,236,864,400	0.400	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	101.26	3,179,721,000	101.30	3,180,882,800	0.100	2020/3/20	0.99
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	3,080,000,000	101.46	3,125,122,000	101.49	3,126,107,600	0.200	2019/9/20	0.98
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,950,000,000	104.15	3,072,690,500	104.15	3,072,661,000	0.300	2025/12/20	0.96
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,840,000,000	105.14	2,985,976,000	105.13	2,985,919,200	0.400	2025/9/20	0.93
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,810,000,000	101.34	2,847,906,900	101.39	2,849,059,000	0.100	2020/6/20	0.89
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,600,000,000	106.54	2,770,222,000	106.54	2,770,144,000	0.600	2024/6/20	0.87
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,560,000,000	106.29	2,721,228,800	106.29	2,721,177,600	0.600	2023/12/20	0.85
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	2,490,000,000	102.72	2,557,752,900	102.73	2,558,026,800	1.500	2017/12/20	0.80
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	2,500,000,000	101.61	2,540,284,000	101.62	2,540,625,000	0.100	2021/3/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,360,000,000	107.42	2,535,119,300	107.41	2,535,064,800	0.800	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,390,000,000	105.82	2,529,121,900	105.81	2,529,074,100	0.500	2024/9/20	0.79
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	2,450,000,000	101.03	2,475,259,500	101.05	2,475,798,500	0.200	2018/9/20	0.77
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	106.65	2,442,422,400	106.65	2,442,376,600	0.800	2022/9/20	0.76
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,210,000,000	105.04	2,321,494,500	105.04	2,321,450,300	0.400	2025/3/20	0.72
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	105.48	2,278,389,600	105.49	2,278,713,600	1.300	2019/12/20	0.71
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,060,000,000	106.42	2,192,313,800	106.42	2,192,252,000	0.600	2024/3/20	0.68
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	104.03	2,184,651,000	104.03	2,184,798,000	1.500	2018/9/20	0.68
日本	国債証券	第364回利付国債(2年)	2,160,000,000	100.67	2,174,523,700	100.67	2,174,601,600	0.100	2018/5/15	0.68
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	102.55	2,143,315,900	102.55	2,143,483,100	1.700	2017/9/20	0.67
日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	1,810,000,000	106.38	1,925,586,600	106.38	1,925,532,300	0.800	2022/6/20	0.60

(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	81.61
地方債証券	5.74
特殊債券	7.68
社債券	4.38
合計	99.42

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	4円		608,120,648	608,120,000	0.19

(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	149,389,417,310	97.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,087,193,974	2.02
合計(純資産総額)		152,476,611,284	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	3,125,790,000	2.05

(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	909,000	5,681.00	5,164,029,000	5,783.00	5,256,747,000	3.45
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,787,900	546.00	3,160,193,400	553.80	3,205,339,020	2.10
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	557,600	4,846.00	2,702,129,600	4,855.00	2,707,148,000	1.78
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	408,700	6,175.00	2,523,722,500	6,228.00	2,545,383,600	1.67
日本	株式	KDDI	情報・通信業	732,800	3,193.00	2,339,830,400	3,237.00	2,372,073,600	1.56
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	484,200	4,383.00	2,122,248,600	4,402.00	2,131,448,400	1.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	577,600	3,529.00	2,038,350,400	3,617.00	2,089,179,200	1.37
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	657,700	3,122.00	2,053,339,400	3,151.00	2,072,412,700	1.36
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,224,900	172.10	1,759,705,290	174.40	1,783,222,560	1.17
日本	株式	ソニー	電気機器	515,700	3,082.00	1,589,387,400	3,100.00	1,598,670,000	1.05
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	539,000	2,744.50	1,479,285,500	2,779.00	1,497,881,000	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	304,900	4,819.00	1,469,313,100	4,797.00	1,462,605,300	0.96
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	301,800	4,702.00	1,419,063,600	4,744.00	1,431,739,200	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	133,600	10,080.00	1,346,688,000	10,135.00	1,354,036,000	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	857,200	1,493.50	1,280,228,200	1,517.00	1,300,372,400	0.85
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	65,500	19,300.00	1,264,150,000	19,630.00	1,285,765,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	74,800	16,735.00	1,251,778,000	16,980.00	1,270,104,000	0.83
日本	株式	キヤノン	電気機器	393,500	3,160.00	1,243,460,000	3,212.00	1,263,922,000	0.83
日本	株式	花王	化学	205,900	6,086.00	1,253,107,400	6,101.00	1,256,195,900	0.82
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,600	69,330.00	1,150,878,000	70,400.00	1,168,640,000	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,020,000	1,105.00	1,127,100,000	1,125.00	1,147,500,000	0.75
日本	株式	三菱地所	不動産業	536,000	2,125.00	1,139,000,000	2,139.50	1,146,772,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	292,300	3,840.00	1,122,432,000	3,839.00	1,122,139,700	0.74
日本	株式	三菱商事	卸売業	541,300	1,936.50	1,048,227,450	1,967.00	1,064,737,100	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	780,000	1,314.00	1,024,920,000	1,339.50	1,044,810,000	0.69
日本	株式	三井不動産	不動産業	383,000	2,673.50	1,023,950,500	2,721.50	1,042,334,500	0.68
日本	株式	ダイキン工業	機械	106,400	9,395.00	999,628,000	9,496.00	1,010,374,400	0.66
日本	株式	村田製作所	電気機器	77,100	12,740.00	982,254,000	12,950.00	998,445,000	0.65
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	258,300	3,734.00	964,492,200	3,826.00	988,255,800	0.65
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	231,000	4,120.00	951,720,000	4,150.00	958,650,000	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.16
		食料品	5.01
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.12
		医薬品	5.58
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.19
		非鉄金属	0.85
		金属製品	0.63
		機械	4.72
		電気機器	11.52
		輸送用機器	9.34
		精密機器	1.56
		その他製品	1.61
		電気・ガス業	1.91
		陸運業	4.44
		海運業	0.22
		空運業	0.64
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	8.25
		卸売業	4.10
		小売業	4.76
		銀行業	7.47
		証券、商品先物取引業	1.00
		保険業	2.26
		その他金融業	1.28
		不動産業	2.72
サービス業	3.78		
	小計	97.98	
合計		97.98	

(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	227円		3,103,781,000	3,125,790,000	2.05

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	89,487,609,777	41.84
	イタリア	20,776,609,616	9.71
	フランス	20,511,509,139	9.59
	イギリス	17,110,878,594	8.00
	ドイツ	15,481,386,827	7.24
	スペイン	11,550,311,259	5.40
	ベルギー	5,417,245,233	2.53
	オランダ	4,996,641,387	2.34
	カナダ	4,345,707,591	2.03
	オーストラリア	3,744,498,195	1.75
	オーストリア	3,235,971,096	1.51
	メキシコ	1,939,870,599	0.91
	アイルランド	1,702,754,893	0.80
	デンマーク	1,422,335,921	0.67
	フィンランド	1,287,087,681	0.60
	ポーランド	1,223,911,998	0.57
	スウェーデン	1,040,741,497	0.49
	マレーシア	966,425,765	0.45
	南アフリカ	860,159,037	0.40
	シンガポール	745,615,250	0.35
ノルウェー	640,097,327	0.30	
スイス	592,032,778	0.28	
	小計	209,079,401,460	97.76

現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,797,181,190	2.24
合計(純資産総額)		213,876,582,650	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	706,897,568	0.33
	買建	ドイツ	1,116,652,237	0.52

(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		2,488,175,000	1.16

(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 2.125% 05/15/25	12,450,000	11,374.38	1,416,110,750	11,374.38	1,416,110,750	2.125	2025/5/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	11,247.19	1,383,404,677	11,247.19	1,383,404,677	2.000	2025/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.5% 12/31/18	11,500,000	11,236.79	1,292,231,065	11,236.79	1,292,231,065	1.500	2018/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/30/17	11,600,000	11,113.28	1,289,140,999	11,113.28	1,289,140,999	0.875	2017/4/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	10,300,000	11,661.26	1,201,110,541	11,661.26	1,201,110,541	2.875	2043/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	10,000,000	11,144.05	1,114,405,302	11,144.05	1,114,405,302	1.375	2020/4/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	11,036.14	1,103,614,657	11,036.14	1,103,614,657	0.625	2018/4/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	10,000,000	11,021.19	1,102,119,563	11,021.19	1,102,119,563	1.250	2021/3/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	11,421.40	1,039,347,675	11,421.40	1,039,347,675	2.750	2017/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,071.89	996,470,878	11,071.89	996,470,878	1.000	2019/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	11,609.26	986,787,462	11,609.26	986,787,462	2.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	11,722.80	984,715,576	11,722.80	984,715,576	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 08/15/17	8,800,000	11,106.35	977,358,864	11,106.35	977,358,864	0.875	2017/8/15	0.46

アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	8,520,000	11,112.20	946,759,537	11,112.20	946,759,537	1.250	2020/1/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	11,268.64	946,566,083	11,268.64	946,566,083	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	8,150,000	11,497.02	937,007,477	11,497.02	937,007,477	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/18	8,000,000	11,415.76	913,261,550	11,415.76	913,261,550	2.625	2018/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	8,000,000	11,317.39	905,391,742	11,317.39	905,391,742	2.750	2017/5/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 05/31/19	8,000,000	11,238.95	899,116,700	11,238.95	899,116,700	1.500	2019/5/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	7,650,000	11,614.89	888,539,697	11,614.89	888,539,697	2.875	2045/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	7,900,000	11,242.85	888,185,857	11,242.85	888,185,857	1.875	2017/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	11,278.82	845,912,086	11,278.82	845,912,086	1.625	2019/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/23	7,550,000	11,168.32	843,208,246	11,168.32	843,208,246	1.750	2023/1/31	0.39
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000	16,233.14	836,006,862	16,200.68	834,335,269	4.250	2023/10/25	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 6% 05/01/31	4,350,000	18,949.42	824,299,958	18,936.75	823,748,634	6.000	2031/5/1	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	6,900,000	11,919.98	822,478,828	11,919.98	822,478,828	2.750	2023/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	7,150,000	11,099.20	793,592,822	11,099.20	793,592,822	1.625	2022/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	6,500,000	12,205.35	793,347,757	12,205.35	793,347,757	3.125	2044/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	7,000,000	11,224.44	785,710,880	11,224.44	785,710,880	1.750	2022/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	7,000,000	11,159.43	781,160,611	11,159.43	781,160,611	1.750	2023/5/15	0.37

(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	97.76
合計	97.76

(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	26	アメリカ ドル	3,122,843.88	346,448,300	3,122,843.88	346,448,300	0.16
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	15	アメリカ ドル	1,945,546.95	215,838,978	1,945,546.95	215,838,978	0.10
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	8	アメリカ ドル	1,303,500	144,610,290	1,303,500	144,610,290	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	16	ユーロ	1,789,600	221,284,040	1,789,440	221,264,256	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	19	ユーロ	2,497,170	308,775,070	2,495,460	308,563,629	0.14

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	29	ユーロ	4,756,000	588,079,400	4,745,850	586,824,352	0.27
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

(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	10,020,000.00	1,108,913,400	1,111,017,600	0.52
	カナダドル	買建	1,170,000.00	99,052,200	99,438,300	0.05
	ユーロ	買建	8,690,000.00	1,068,001,000	1,074,431,600	0.50
	イギリスポンド	買建	1,250,000.00	202,150,000	203,287,500	0.10

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	149,810,233,345	56.03
	イギリス	19,463,007,895	7.28
	スイス	10,220,577,906	3.82
	カナダ	9,412,048,800	3.52
	フランス	9,293,508,601	3.48
	ドイツ	9,192,964,545	3.44
	オーストラリア	6,241,177,887	2.33
	アイルランド	4,211,310,330	1.58
	オランダ	4,210,626,036	1.57
	スペイン	3,216,537,830	1.20
	スウェーデン	2,868,622,465	1.07
	香港	2,225,634,395	0.83
	デンマーク	2,082,090,929	0.78
	イタリア	1,946,213,707	0.73
	シンガポール	1,690,072,069	0.63
	ベルギー	1,521,086,323	0.57
	ジャージー	1,151,764,046	0.43
	フィンランド	974,686,738	0.36
	キュラソー	915,701,648	0.34



	バミューダ	911,674,695	0.34
	イスラエル	650,168,011	0.24
	ノルウェー	620,706,299	0.23
	ケイマン	576,767,810	0.22
	ルクセンブルク	212,824,037	0.08
	ニュージーランド	186,415,810	0.07
	ポルトガル	176,025,023	0.07
	パナマ	165,265,898	0.06
	オーストリア	165,215,548	0.06
	リベリア	112,955,207	0.04
	英ヴァージン諸島	64,535,662	0.02
	パプアニューギニア	55,892,569	0.02
	マン島	25,985,350	0.01
	モーリシャス	12,809,249	0.00
	小計	244,585,106,663	91.48
投資信託受益証券	オーストラリア	196,138,616	0.07
	香港	51,712,449	0.02
	シンガポール	22,821,633	0.01
	小計	270,672,698	0.10
投資証券	アメリカ	4,908,873,379	1.84
	オーストラリア	654,649,058	0.24
	フランス	409,504,630	0.15
	イギリス	353,487,633	0.13
	香港	119,174,454	0.04
	シンガポール	97,707,973	0.04
	カナダ	59,279,009	0.02
	小計	6,602,676,136	2.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,895,872,682	5.95
合計(純資産総額)		267,354,328,179	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	10,179,507,712	3.81
	買建	カナダ	783,674,214	0.29
	買建	ドイツ	2,556,782,832	0.96
	買建	イギリス	1,545,897,304	0.58
	買建	オーストラリア	658,778,406	0.25

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建		257,954,400	0.10

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	427,536	11,132.82	4,759,685,179	11,132.82	4,759,685,179	1.78
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	581,738	5,804.38	3,376,628,878	5,804.38	3,376,628,878	1.26
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	318,846	9,985.70	3,183,903,499	9,985.70	3,183,903,499	1.19
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	211,951	12,542.87	2,658,475,196	12,542.87	2,658,475,196	0.99
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	722,989	3,341.51	2,415,876,998	3,341.51	2,415,876,998	0.90
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	30,530	79,015.90	2,412,355,598	79,015.90	2,412,355,598	0.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	174,120	13,244.01	2,306,048,275	13,244.01	2,306,048,275	0.86
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	371,816	5,641.29	2,097,525,229	5,641.29	2,097,525,229	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	282,107	7,258.80	2,047,759,476	7,258.80	2,047,759,476	0.77
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	471,373	4,325.55	2,038,947,763	4,325.55	2,038,947,763	0.76
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	244,547	8,307.08	2,031,473,938	8,295.90	2,028,737,946	0.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	23,850	81,281.30	1,938,559,015	81,281.30	1,938,559,015	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	208,455	9,033.84	1,883,149,993	9,033.84	1,883,149,993	0.70
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	22,345	82,938.74	1,853,266,235	82,938.74	1,853,266,235	0.69
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	473,152	3,839.63	1,816,730,222	3,839.63	1,816,730,222	0.68

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	311,799	5,615.78	1,750,995,461	5,615.78	1,750,995,461	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	144,279	11,318.09	1,632,963,977	11,318.09	1,632,963,977	0.61
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	53,915	29,469.19	1,588,831,486	29,312.55	1,580,386,672	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	316,666	4,967.89	1,573,162,868	4,967.89	1,573,162,868	0.59
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	174,656	8,905.64	1,555,424,857	8,900.05	1,554,447,831	0.58
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	90,921	15,903.24	1,445,939,302	15,903.24	1,445,939,302	0.54
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,262	14,859.30	1,445,245,587	14,859.30	1,445,245,587	0.54
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	214,289	6,265.89	1,342,711,559	6,265.89	1,342,711,559	0.50
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	120,395	11,126.17	1,339,535,550	11,126.17	1,339,535,550	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	190,391	6,975.90	1,328,149,948	6,975.90	1,328,149,948	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,422	8,837.48	1,320,513,996	8,837.48	1,320,513,996	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	798,744	1,650.78	1,318,556,371	1,650.78	1,318,556,371	0.49
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	118,803	11,003.02	1,307,192,878	11,003.02	1,307,192,878	0.49
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	362,362	3,502.37	1,269,127,900	3,502.37	1,269,127,900	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	111,745	11,311.44	1,263,997,131	11,311.44	1,263,997,131	0.47

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.74
		素材	4.28
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	0.88
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.49
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.73
		メディア	2.75
		小売	3.76
		食品・生活必需品小売り	2.02
		食品・飲料・タバコ	6.20
		家庭用品・パーソナル用品	2.18

	ヘルスケア機器・サービス	3.55
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.12
	銀行	8.11
	各種金融	3.71
	保険	4.04
	不動産	0.66
	ソフトウェア・サービス	8.24
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.38
	電気通信サービス	3.15
	公益事業	3.26
	半導体・半導体製造装置	1.98
	小計	91.48
投資信託受益証券		0.10
投資証券		2.47
合計		94.05

(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 FUTU	買建	175	アメリカドル	91,756,875	10,179,507,712	91,756,875	10,179,507,712	3.81
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	56	カナダドル	9,240,000	785,769,600	9,215,360	783,674,214	0.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	65	スイスフラン	5,388,500	602,865,380	5,384,600	602,429,048	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	513	ユーロ	15,723,450	1,944,204,592	15,805,530	1,954,353,784	0.73
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	61	オーストラリアドル	8,250,250	658,534,955	8,253,300	658,778,406	0.25
	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	152	イギリスポンド	9,501,520	1,545,897,304	9,501,520	1,545,897,304	0.58

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	1,120,000.00	124,132,400	124,241,600	0.05
	ユーロ	売建	870,000.00	107,063,980	107,566,800	0.04
	スイスフラン	売建	100,000.00	11,131,000	11,188,000	0.00
	デンマーククローネ	売建	900,000.00	14,877,000	14,958,000	0.01

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

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

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	73,363,344,900	98.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,036,825,194	1.39
合計(純資産総額)		74,400,170,094	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	871,930,000	1.17

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	8,733	568,042.59	4,960,715,988	659,000	5,755,047,000	7.74
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,098	553,685.02	4,483,741,355	649,000	5,255,602,000	7.06
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	15,784	233,966.09	3,692,920,823	257,700	4,067,536,800	5.47

日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	23,019	155,798.97	3,586,336,494	175,000	4,028,325,000	5.41
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	17,016	166,800.45	2,838,276,472	175,000	2,977,800,000	4.00
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	11,392	225,131.95	2,564,703,282	240,400	2,738,636,800	3.68
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	14,975	162,277.35	2,430,103,374	175,300	2,625,117,500	3.53
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,399	401,583.68	2,168,150,319	474,500	2,561,825,500	3.44
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,040	269,445.53	2,166,342,095	280,500	2,255,220,000	3.03
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	3,709	507,920.97	1,883,878,896	566,000	2,099,294,000	2.82
日本	投資証券	GLP投資法人	16,042	119,954.65	1,924,312,497	127,400	2,043,750,800	2.75
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	20,545	88,449.19	1,817,188,732	96,300	1,978,483,500	2.66
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,993	614,348.47	1,838,744,979	659,000	1,972,387,000	2.65
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,827	151,319.92	1,638,340,879	165,800	1,795,116,600	2.41
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	22,734	72,640.89	1,651,418,015	76,300	1,734,604,200	2.33
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,164	212,035.61	1,731,058,742	211,400	1,725,869,600	2.32
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,068	492,228.03	1,510,155,609	542,000	1,662,856,000	2.24
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,504	545,291.14	1,365,409,015	630,000	1,577,520,000	2.12
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,997	425,757.19	1,275,994,316	457,000	1,369,629,000	1.84
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,442	229,490.07	1,248,884,986	244,400	1,330,024,800	1.79
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,169	499,851.81	1,084,178,576	599,000	1,299,231,000	1.75
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4,625	248,241.04	1,148,114,855	272,000	1,258,000,000	1.69
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,180	549,057.85	1,196,946,134	572,000	1,246,960,000	1.68
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	7,820	133,809.79	1,046,392,566	149,400	1,168,308,000	1.57
日本	投資証券	プレミアム投資法人	8,145	118,503.11	965,207,863	141,300	1,150,888,500	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	8,099	141,830.65	1,148,686,469	141,200	1,143,578,800	1.54
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	5,919	168,566.33	997,744,127	189,800	1,123,426,200	1.51
日本	投資証券	福岡リート投資法人	4,620	195,206.86	901,855,704	203,400	939,708,000	1.26
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	6,046	147,571.6	892,217,951	152,700	923,224,200	1.24
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	10,143	81,204.03	823,652,526	86,200	874,326,600	1.18

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.61
合計	98.61

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	460	円	869,995,400	871,930,000	1.17

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

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	41,724,108,793	71.36
	オーストラリア	4,762,865,448	8.15
	イギリス	3,604,284,600	6.16
	フランス	2,663,352,367	4.56
	シンガポール	1,733,209,659	2.96
	カナダ	1,163,539,782	1.99
	香港	939,202,240	1.61
	ベルギー	398,486,583	0.68
	オランダ	322,976,150	0.55
	ニュージーランド	289,751,270	0.50
	スペイン	260,023,316	0.44
	アイルランド	142,652,146	0.24
	ドイツ	113,774,074	0.19
	イタリア	60,695,008	0.10
	マン島	50,540,933	0.09
	ガーンジー	39,677,649	0.07
イスラエル	24,148,334	0.04	
	小計	58,293,288,352	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		175,470,530	0.30
合計(純資産総額)		58,468,758,882	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		34,610,050	0.06

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	153,020	21,256.10	3,252,609,034	21,940.60	3,357,351,193	5.74
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	72,750	25,317.61	1,841,856,666	28,315.21	2,059,931,979	3.52
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	48,430	29,781.10	1,442,298,794	30,263.33	1,465,653,435	2.51
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	180,130	8,453.62	1,522,752,012	7,623.79	1,373,274,518	2.35
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	258,830	4,537.44	1,174,427,148	5,278.52	1,366,240,677	2.34
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,580	18,946.33	1,280,393,198	19,985.84	1,350,643,135	2.31
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	175,190	6,572.08	1,151,363,677	7,684.81	1,346,302,530	2.30
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	165,180	5,547.00	916,253,460	7,356.43	1,215,135,339	2.08
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	76,230	13,621.41	1,038,360,547	13,912.98	1,060,586,877	1.81
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,643,790	320.87	848,329,817	372.75	985,497,574	1.69
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	86,990	10,524.87	915,559,120	10,562.59	918,840,348	1.57
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	285,740	2,956.55	844,804,882	2,989.83	854,314,881	1.46
アメリカ	投資証券	HCP INC	228,370	3,676.55	839,614,089	3,665.45	837,080,552	1.43
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	123,200	5,183.11	638,559,990	6,645.30	818,701,699	1.40
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	32,070	24,014.07	770,131,302	25,172.28	807,275,212	1.38
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	941,430	785.42	739,426,235	854.07	804,050,886	1.38
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	398,770	2,072.48	826,446,442	1,932.87	770,772,962	1.32
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	72,560	7,969.96	578,300,340	10,501.58	761,994,674	1.30
香港	投資証券	LINK REIT	1,116,500	648.04	723,539,889	673.30	751,741,683	1.29
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	62,490	8,516.88	532,220,170	10,309.65	644,250,291	1.10
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	202,500	2,834.51	573,989,692	3,118.52	631,500,988	1.08
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	368,200	1,897.07	698,502,646	1,697.38	624,976,052	1.07
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	500,750	1,332.51	667,255,885	1,236.52	619,187,390	1.06
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,960	15,862.13	554,540,249	17,040.38	595,731,825	1.02
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	49,900	12,685.95	633,029,053	11,158.34	556,801,425	0.95
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	63,640	8,610.05	547,943,799	8,452.51	537,918,284	0.92
アメリカ	投資証券	UDR INC	130,490	3,778.61	493,071,654	4,011.59	523,472,431	0.90
フランス	投資証券	KLEPIERRE	93,350	5,103.65	476,426,078	5,145.69	480,350,605	0.82
アメリカ	投資証券	VEREIT INC	450,960	894.03	403,172,715	1,056.14	476,280,863	0.81
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	116,550	3,489.51	406,703,525	4,082.59	475,826,098	0.81

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率



種類	投資比率（％）
投資証券	99.70
合計	99.70

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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	290,000.00	32,111,700	32,169,700	0.06
	イギリスポンド	買建	15,000.00	2,426,985	2,440,350	0.00

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

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

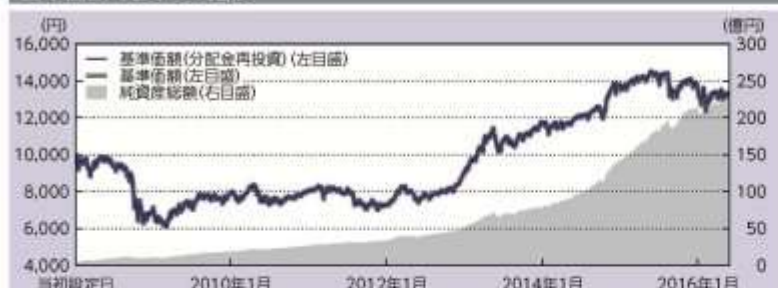
#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2008年1月9日

作成基準日：2016年5月31日

**基準価額・純資産の推移**

基準価額	13,440円
純資産総額	228.78億円

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
 ※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**分配の推移(1万口当たり、税引前)**

設定来分配金合計額:40円

決算期	2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月
分配金	0円	0円	20円	20円	0円

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	19.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	-	-	0.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
国内株式 インデックス マザーファンド	19.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
外国債券 インデックス マザーファンド	18.9%	T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.1%
		T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	17.7%	第113回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.3%	2018/06/20	0.2%
		第342回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2026/03/20	0.2%
J-REIT インデックス マザーファンド	11.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.8%
グローバル REITインデックス マザーファンド	10.9%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2008年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2016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 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

ただし、確定拠出年金によるお申込みは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 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

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

**< 受付不可日 >**

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

**< 一部解約受付の中止等 >**

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

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

**< 一部解約の制限 >**

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

**< その他 >**

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

**< 問い合わせ先 >**

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**3 【資産管理等の概要】****（1）【資産の評価】****< 基準価額の算出方法 >**

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（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

##### ・ 株式および不動産投資信託証券

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（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル： 0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （ 2 ）【保管】

該当事項はありません。

#### （ 3 ）【信託期間】

無期限とします。（平成20年 1月 9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11月11日から翌年11月10日（第1計算期間は平成20年1月9日から平成20年11月10日）までとします。なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### （５）【その他】

##### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

###### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、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等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。

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。

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

## < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。



#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）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8期計算期間(平成26年11月11日から平成27年11月10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】

## 【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （平成26年11月10日現在）	第8期 （平成27年11月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	334,955,680	397,591,221
親投資信託受益証券	12,292,937,700	20,401,900,039
未収入金	8,700,000	-
未収利息	363	640
流動資産合計	12,636,593,743	20,799,491,900
資産合計	12,636,593,743	20,799,491,900
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	19,186,125	-
未払解約金	49,584,655	11,234,887
未払受託者報酬	2,260,366	4,086,196
未払委託者報酬	36,165,870	65,379,102
その他未払費用	497,051	909,295
流動負債合計	107,694,067	81,609,480
負債合計	107,694,067	81,609,480
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,593,062,711	14,848,925,687
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,935,836,965	5,868,956,733
（分配準備積立金）	2,714,479,589	2,915,232,454
元本等合計	12,528,899,676	20,717,882,420
純資産合計	12,528,899,676	20,717,882,420
負債純資産合計	12,636,593,743	20,799,491,900

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自	平成25年11月12日 至 平成26年11月10日	自	平成26年11月11日 至 平成27年11月10日
営業収益				
受取利息		149,140		181,123
有価証券売買等損益		1,740,775,417		991,902,339
営業収益合計		1,740,924,557		992,083,462
営業費用				
受託者報酬		3,977,352		7,275,398
委託者報酬		63,637,567		116,406,298
その他費用		497,051		909,295
営業費用合計		68,111,970		124,590,991
営業利益又は営業損失（ ）		1,672,812,587		867,492,471
経常利益又は経常損失（ ）		1,672,812,587		867,492,471
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,672,812,587		867,492,471
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（ ）		111,773,424		137,547,911
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		717,126,334		2,935,836,965
剰余金増加額又は欠損金減少額		897,405,178		3,049,397,919
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		897,405,178		3,049,397,919
剰余金減少額又は欠損金増加額		220,547,585		846,222,711
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		220,547,585		846,222,711
分配金		19,186,125		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,935,836,965		5,868,956,733

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第7期 (平成26年11月10日現在)	第8期 (平成27年11月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,593,062,711口	14,848,925,687口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3060円 (13,060円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3952円 (13,952円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 平成25年11月12日 至 平成26年11月10日			第8期 自 平成26年11月11日 至 平成27年11月10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	214,072,626円	費用控除後の配当等収益額	A	328,588,292円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,346,966,537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	401,356,268円
収益調整金額	C	1,492,757,565円	収益調整金額	C	4,341,437,179円
分配準備積立金額	D	1,172,626,551円	分配準備積立金額	D	2,185,287,894円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,226,423,279円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,256,669,633円
当ファンドの期末残存口数	F	9,593,062,711口	当ファンドの期末残存口数	F	14,848,925,687口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,405円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,886円
1万口当たり分配金額	H	20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	19,186,125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8期 自 平成26年11月11日 至 平成27年11月10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コンプライアンス・リスク統括部が、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8期 (平成27年11月10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7期	第8期
	自 平成25年11月12日 至 平成26年11月10日	自 平成26年11月11日 至 平成27年11月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,823,339,843円	9,593,062,711円
期中追加設定元本額	4,666,930,535円	7,846,529,569円
期中一部解約元本額	1,897,207,667円	2,590,666,593円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第7期 (平成26年11月10日現在)	第8期 (平成27年11月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,725,954,591	991,117,998
合計	1,725,954,591	991,117,998

## （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	J-REITインデックス マザーファンド	1,435,621,009	2,071,026,867	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,346,301,836	2,212,781,697	
	国内株式インデックス マザーファンド	3,267,530,252	4,419,007,912	
	外国株式インデックス マザーファンド	2,082,477,527	4,334,885,220	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,521,764,700	3,364,538,462	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,420,434,648	3,999,659,881	
合計		12,074,129,972	20,401,900,039	

(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)

「SBI資産設計オープン(資産成長型)」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の受益証券を主要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」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成27年11月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	平成27年11月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,726,227,664
国債証券	266,325,487,450
地方債証券	19,385,319,135
特殊債証券	26,390,274,663
社債証券	16,274,067,030
派生商品評価勘定	678,704
未収利息	800,979,298
前払費用	18,137,890
差入委託証拠金	1,120,000
流動資産合計	333,922,291,834
資産合計	333,922,291,834
負債の部	
流動負債	

	平成27年11月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	240,648
前受金	440,000
未払金	3,285,020,750
未払解約金	157,038,447
流動負債合計	3,442,739,845
負債合計	3,442,739,845
純資産の部	
元本等	
元本	247,692,658,058
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,786,893,931
元本等合計	330,479,551,989
純資産合計	330,479,551,989
負債純資産合計	333,922,291,834

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年11月10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)

	平成27年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	247,692,658,058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 105,935,000円</p>

		平成27年11月10日現在
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3342円 (13,342円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

		平成27年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

		平成27年11月10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。	

	平成27年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	218,705,326,767円
期中追加設定元本額	61,601,978,854円
期中一部解約元本額	32,614,647,563円
期末元本額	247,692,658,058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）	2,521,764,700円
S B I 資産設計オープン（分配型）	26,250,300円
S M T 国内債券インデックス・オープン	7,262,481,558円
世界経済インデックスファンド	493,457,763円
マイセクション25	76,592,219円
マイセクション50	77,269,050円

区分	平成27年11月10日現在
マイセレクション75	24,607,437円
DCマイセレクション25	14,056,623,764円
DCマイセレクション50	16,760,218,481円
DCマイセレクション75	4,907,390,147円
DC日本債券インデックス・オープン	412,564,633円
DC日本債券インデックス・オープンS	58,885,122,040円
DC日本債券インデックス・オープンP	23,934,276,599円
DCマイセレクションS25	5,743,862,690円
DCマイセレクションS50	6,351,743,419円
DCマイセレクションS75	1,266,098,786円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,269,490,014円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	706,328,728円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	185,774,215円
DC世界経済インデックスファンド	490,126,001円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,248,649,758円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	19,186,347円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	163,555,469円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	27,247,765円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	975,740円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	661,633,408円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	936,216,966円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	622,281,794円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	313,060,552円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	9,400,969,281円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,583,853,125円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,832,816,871円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,365,243,876円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,197,511,388円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,173,522,566円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,842,523,810円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,235,949,627円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,222,800,960円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	220,251,709円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,709,572,430円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,411,762,132円
コア投資戦略ファンド（安定型）	7,981,594,566円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,977,753,451円
分散投資コア戦略ファンドA	1,259,208,498円
分散投資コア戦略ファンドS	768,996,154円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	14,178,466円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	212,968,840円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	33,112,411,294円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,493,809,361円

区分	平成27年11月10日現在
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,445,607円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,352,822円
SMT インデックスバランス・オープン	57,064,312円
債券コア戦略ファンド	91,061円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,093,928,268円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,566,153,650
地方債証券	2,552,783
特殊債券	4,245,823
社債券	21,957,390
合計	1,542,503,220

(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

（平成27年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	債券先物取引	890,081,944	890,520,000	438,056
	買建			
合計		890,081,944	890,520,000	438,056

## (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。

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349回利付国債(2年)	1,850,000,000	1,852,442,000	
	第350回利付国債(2年)	1,030,000,000	1,031,442,000	
	第351回利付国債(2年)	130,000,000	130,193,700	
	第353回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,602,656,000	
	第354回利付国債(2年)	310,000,000	310,542,500	
	第355回利付国債(2年)	3,940,000,000	3,947,249,600	
	第356回利付国債(2年)	1,090,000,000	1,092,103,700	
	第357回利付国債(2年)	740,000,000	741,487,400	
	第101回利付国債(5年)	950,000,000	954,246,500	
	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	2,287,660,800	
	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	2,510,275,000	
	第104回利付国債(5年)	810,000,000	812,235,600	
	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	3,511,480,000	
	第106回利付国債(5年)	3,260,000,000	3,272,388,000	
	第107回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,124,704,000	
	第108回利付国債(5年)	590,000,000	591,239,000	
	第109回利付国債(5年)	1,190,000,000	1,192,796,500	
	第110回利付国債(5年)	700,000,000	704,935,000	
	第111回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,604,946,000	
	第112回利付国債(5年)	900,000,000	909,369,000	
	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	4,424,242,000	
	第114回利付国債(5年)	1,210,000,000	1,220,188,200	
	第115回利付国債(5年)	2,850,000,000	2,865,846,000	
	第116回利付国債(5年)	3,960,000,000	3,983,958,000	
	第117回利付国債(5年)	4,520,000,000	4,549,515,600	
	第118回利付国債(5年)	4,350,000,000	4,380,537,000	
	第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,003,420,000	
	第120回利付国債(5年)	4,240,000,000	4,271,036,800	
	第121回利付国債(5年)	630,000,000	632,179,800	
	第122回利付国債(5年)	5,090,000,000	5,107,713,200	
	第123回利付国債(5年)	4,640,000,000	4,656,100,800	
	第124回利付国債(5年)	3,210,000,000	3,221,042,400	
	第125回利付国債(5年)	2,300,000,000	2,307,797,000	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	188,218,500		
第2回利付国債(40年)	300,000,000	361,131,000		
第3回利付国債(40年)	420,000,000	505,558,200		
第4回利付国債(40年)	530,000,000	638,565,200		
第5回利付国債(40年)	490,000,000	562,858,100		

第6回利付国債（40年）	690,000,000	772,717,200	
第7回利付国債（40年）	1,090,000,000	1,155,727,000	
第8回利付国債（40年）	750,000,000	726,937,500	
第284回利付国債（10年）	570,000,000	580,727,400	
第285回利付国債（10年）	1,990,000,000	2,035,829,700	
第286回利付国債（10年）	870,000,000	895,169,100	
第287回利付国債（10年）	540,000,000	556,486,200	
第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,156,085,800	
第289回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,568,310,500	
第290回利付国債（10年）	470,000,000	485,463,000	
第291回利付国債（10年）	840,000,000	865,662,000	
第292回利付国債（10年）	1,110,000,000	1,154,355,600	
第293回利付国債（10年）	370,000,000	387,330,800	
第294回利付国債（10年）	180,000,000	187,963,200	
第295回利付国債（10年）	100,000,000	103,904,000	
第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,189,607,000	
第297回利付国債（10年）	560,000,000	584,242,400	
第298回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,726,715,400	
第299回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,366,827,800	
第300回利付国債（10年）	830,000,000	871,566,400	
第301回利付国債（10年）	840,000,000	885,234,000	
第302回利付国債（10年）	200,000,000	210,048,000	
第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,464,156,500	
第304回利付国債（10年）	480,000,000	503,760,000	
第305回利付国債（10年）	2,160,000,000	2,273,356,800	
第306回利付国債（10年）	1,370,000,000	1,451,857,500	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	738,787,000	
第308回利付国債（10年）	990,000,000	1,047,786,300	
第309回利付国債（10年）	1,780,000,000	1,867,540,400	
第310回利付国債（10年）	1,590,000,000	1,664,761,800	
第311回利付国債（10年）	610,000,000	632,765,200	
第312回利付国債（10年）	2,170,000,000	2,298,789,500	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,650,000,000	1,760,517,000	
第314回利付国債（10年）	910,000,000	961,242,100	
第315回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,436,737,500	
第316回利付国債（10年）	720,000,000	762,235,200	
第317回利付国債（10年）	620,000,000	657,807,600	
第318回利付国債（10年）	1,010,000,000	1,065,701,500	
第319回利付国債（10年）	750,000,000	797,437,500	
第320回利付国債（10年）	720,000,000	761,155,200	
第321回利付国債（10年）	2,130,000,000	2,255,946,900	
第322回利付国債（10年）	950,000,000	999,846,500	



第323回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,275,582,000	
第324回利付国債（10年）	2,020,000,000	2,116,212,600	
第325回利付国債（10年）	3,370,000,000	3,534,186,400	
第326回利付国債（10年）	720,000,000	750,470,400	
第327回利付国債（10年）	1,580,000,000	1,658,004,600	
第328回利付国債（10年）	2,220,000,000	2,296,789,800	
第329回利付国債（10年）	2,300,000,000	2,414,172,000	
第330回利付国債（10年）	2,240,000,000	2,352,112,000	
第331回利付国債（10年）	680,000,000	703,480,400	
第332回利付国債（10年）	2,700,000,000	2,791,692,000	
第333回利付国債（10年）	2,060,000,000	2,128,536,200	
第334回利付国債（10年）	3,000,000,000	3,097,530,000	
第335回利付国債（10年）	3,040,000,000	3,111,227,200	
第336回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,339,147,500	
第337回利付国債（10年）	1,550,000,000	1,556,897,500	
第338回利付国債（10年）	3,480,000,000	3,521,238,000	
第339回利付国債（10年）	3,480,000,000	3,515,739,600	
第340回利付国債（10年）	3,040,000,000	3,066,144,000	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	51,553,200	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	197,995,200	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	146,948,400	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	144,266,100	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	60,667,500	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	236,190,900	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	221,004,000	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	57,406,500	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	260,294,400	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	165,422,400	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	101,557,800	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	226,464,800	
第13回利付国債（30年）	290,000,000	340,721,000	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	372,042,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	427,023,000	
第16回利付国債（30年）	370,000,000	464,675,600	
第17回利付国債（30年）	330,000,000	408,358,500	
第18回利付国債（30年）	445,000,000	542,308,150	
第19回利付国債（30年）	280,000,000	340,774,000	
第20回利付国債（30年）	420,000,000	525,667,800	
第21回利付国債（30年）	270,000,000	328,203,900	
第22回利付国債（30年）	400,000,000	500,188,000	
第23回利付国債（30年）	420,000,000	524,932,800	
第24回利付国債（30年）	390,000,000	487,164,600	

第25回利付国債(30年)	350,000,000	424,480,000
第26回利付国債(30年)	730,000,000	898,739,500
第27回利付国債(30年)	730,000,000	913,281,100
第28回利付国債(30年)	530,000,000	664,302,000
第29回利付国債(30年)	940,000,000	1,161,050,400
第30回利付国債(30年)	660,000,000	802,665,600
第31回利付国債(30年)	770,000,000	921,343,500
第32回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,290,666,600
第33回利付国債(30年)	1,180,000,000	1,362,026,800
第34回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,892,618,800
第35回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,639,304,800
第36回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,431,431,200
第37回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,426,093,200
第38回利付国債(30年)	790,000,000	875,880,900
第39回利付国債(30年)	740,000,000	836,991,800
第40回利付国債(30年)	530,000,000	587,192,300
第41回利付国債(30年)	580,000,000	629,044,800
第42回利付国債(30年)	710,000,000	768,830,600
第43回利付国債(30年)	720,000,000	779,234,400
第44回利付国債(30年)	720,000,000	778,795,200
第45回利付国債(30年)	680,000,000	702,045,600
第46回利付国債(30年)	750,000,000	773,647,500
第47回利付国債(30年)	900,000,000	949,590,000
第48回利付国債(30年)	720,000,000	723,038,400
第34回利付国債(20年)	50,000,000	52,363,500
第35回利付国債(20年)	10,000,000	10,445,700
第36回利付国債(20年)	70,000,000	73,887,800
第37回利付国債(20年)	70,000,000	74,018,000
第38回利付国債(20年)	20,000,000	21,266,800
第39回利付国債(20年)	500,000,000	530,495,000
第40回利付国債(20年)	100,000,000	106,550,000
第41回利付国債(20年)	330,000,000	346,526,400
第42回利付国債(20年)	80,000,000	86,954,400
第43回利付国債(20年)	140,000,000	155,590,400
第44回利付国債(20年)	170,000,000	188,326,000
第45回利付国債(20年)	290,000,000	320,000,500
第46回利付国債(20年)	170,000,000	186,976,200
第47回利付国債(20年)	90,000,000	99,472,500
第48回利付国債(20年)	130,000,000	146,334,500
第49回利付国債(20年)	140,000,000	155,414,000
第50回利付国債(20年)	220,000,000	241,870,200
第51回利付国債(20年)	100,000,000	110,931,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	123,134,000

第53回利付国債(20年)	80,000,000	89,952,800	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	226,098,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	157,140,200	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	169,026,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	268,864,800	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	337,221,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	222,650,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	382,228,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	255,480,000	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	335,884,800	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	225,058,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	363,472,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	250,423,800	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	372,999,000	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	148,333,900	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	221,574,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	451,600,500	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	474,420,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	233,828,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	732,866,400	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	416,818,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	233,350,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	151,973,900	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	310,705,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	336,368,100	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	195,935,200	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	313,718,400	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	257,802,600	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	453,893,700	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	704,046,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	341,022,600	
第84回利付国債(20年)	670,000,000	780,931,900	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	341,544,600	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	251,531,700	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	653,262,500	
第88回利付国債(20年)	550,000,000	660,319,000	
第89回利付国債(20年)	450,000,000	535,653,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	751,092,300	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	541,197,000	
第92回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,277,910,000	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	481,225,200	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	722,984,200	

第95回利付国債(20年)	860,000,000	1,040,600,000	
第96回利付国債(20年)	420,000,000	498,615,600	
第97回利付国債(20年)	640,000,000	767,776,000	
第98回利付国債(20年)	580,000,000	689,254,600	
第99回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,190,080,000	
第100回利付国債(20年)	540,000,000	649,425,600	
第101回利付国債(20年)	435,000,000	533,623,200	
第102回利付国債(20年)	610,000,000	749,629,000	
第103回利付国債(20年)	420,000,000	511,140,000	
第104回利付国債(20年)	300,000,000	357,753,000	
第105回利付国債(20年)	790,000,000	943,236,300	
第106回利付国債(20年)	360,000,000	434,181,600	
第107回利付国債(20年)	250,000,000	298,640,000	
第108回利付国債(20年)	480,000,000	561,264,000	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	397,579,000	
第110回利付国債(20年)	850,000,000	1,015,750,000	
第111回利付国債(20年)	330,000,000	399,161,400	
第112回利付国債(20年)	800,000,000	956,928,000	
第113回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,447,716,600	
第114回利付国債(20年)	810,000,000	969,885,900	
第115回利付国債(20年)	720,000,000	871,495,200	
第116回利付国債(20年)	550,000,000	666,270,000	
第117回利付国債(20年)	820,000,000	981,868,000	
第118回利付国債(20年)	850,000,000	1,006,391,500	
第119回利付国債(20年)	380,000,000	439,451,000	
第120回利付国債(20年)	330,000,000	372,553,500	
第121回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,275,430,800	
第122回利付国債(20年)	280,000,000	323,618,400	
第123回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,510,236,000	
第124回利付国債(20年)	280,000,000	331,531,200	
第125回利付国債(20年)	630,000,000	764,164,800	
第126回利付国債(20年)	430,000,000	509,244,700	
第127回利付国債(20年)	460,000,000	538,002,200	
第128回利付国債(20年)	660,000,000	771,401,400	
第129回利付国債(20年)	420,000,000	484,642,200	
第130回利付国債(20年)	630,000,000	726,818,400	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	432,991,000	
第132回利付国債(20年)	530,000,000	603,208,900	
第133回利付国債(20年)	880,000,000	1,014,948,000	
第134回利付国債(20年)	420,000,000	483,873,600	
第135回利付国債(20年)	380,000,000	431,946,000	
第136回利付国債(20年)	610,000,000	684,017,400	
第137回利付国債(20年)	290,000,000	329,216,700	

	第138回利付国債（20年）	630,000,000	695,652,300
	第139回利付国債（20年）	410,000,000	459,081,100
	第140回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,541,777,600
	第141回利付国債（20年）	360,000,000	407,520,000
	第142回利付国債（20年）	780,000,000	895,330,800
	第143回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,169,952,000
	第144回利付国債（20年）	640,000,000	702,899,200
	第145回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,670,061,600
	第146回利付国債（20年）	1,710,000,000	1,926,349,200
	第147回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,628,921,700
	第148回利付国債（20年）	1,530,000,000	1,666,705,500
	第149回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,641,279,400
	第150回利付国債（20年）	1,570,000,000	1,674,923,100
	第151回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,359,072,000
	第152回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,457,772,000
	第153回利付国債（20年）	1,580,000,000	1,644,211,200
	第154回利付国債（20年）	1,300,000,000	1,326,585,000
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,721,000
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,462,000
	国債証券合計	249,020,000,000	266,325,487,450
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,009,000
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,675,000
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	118,335,000
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	114,596,000
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,612,000
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,285,000
	第23回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,199,000
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	224,272,000
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	221,680,000
	第695回東京都公募公債	200,000,000	211,652,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	106,014,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	105,230,000
	第702回東京都公募公債	200,000,000	211,038,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	104,034,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	103,004,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	104,744,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	103,055,000
	平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	102,020,000
	平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	113,569,500
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	105,352,000
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	106,078,000
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	210,626,000

平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,868,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	122,975,000	
第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,813,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,565,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	104,495,000	
第144回神奈川県公募公債	100,000,000	101,954,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	103,370,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	210,852,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	226,432,000	
第26回大阪府公募公債(2年)	270,000,000	269,767,800	
第91回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,103,000	
第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,360,000	
第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,568,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,507,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,487,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,545,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,042,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,957,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	101,819,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	105,165,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,112,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,156,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,922,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,770,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,000,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	103,332,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,861,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,907,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	98,897,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	103,032,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	104,407,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	105,680,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	109,325,234	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	105,198,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,316,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,990,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	120,080,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	211,492,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,807,000	

平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,953,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,139,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,003,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,591,000	
平成19年度第2回広島県公募公債	200,000,000	206,640,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,418,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,746,000	
平成23年度第6回広島県公募公債(5年)	200,000,000	200,720,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,243,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,392,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,879,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	204,715,100	
平成23年度第11回埼玉県公募公債(5年)	100,000,000	100,375,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,726,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,512,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,522,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,128,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,531,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	211,738,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,845,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	111,284,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	125,000,000	128,266,250	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	105,775,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,281,200	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,506,000	
第46回共同発行市場公募地方債	336,500,000	343,475,645	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,100,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	163,858,464	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,332,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,203,000	
第67回共同発行市場公募地方債	265,700,000	276,824,859	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,034,600	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,037,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,942,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,453,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,998,871	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,797,000	

第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,697,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,712,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	265,037,500	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	379,965,920	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,713,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,683,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,330,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,656,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,659,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,411,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,650,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,396,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,353,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,232,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,986,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,435,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,686,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,033,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,625,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,962,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	208,314,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,441,000	
第13回大田市公募公債（20年）	200,000,000	234,058,000	
平成19年度第7回大田市公募公債	100,000,000	103,168,000	
平成22年度第5回大田市公募公債	100,000,000	105,134,000	
平成26年度第1回大田市公募公債（3年）	200,000,000	200,100,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	120,573,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	117,299,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	104,270,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,851,000	
平成18年度第3回京都市公募公債	100,000,000	102,358,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	106,866,420	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	105,464,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,121,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,508,000	
平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,123,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,205,000	
平成18年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	101,999,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,785,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	210,634,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,935,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,274,000	



	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,171,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	114,111,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	105,021,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,560,000	
	平成18年度第6回福岡市公募公債	120,050,000	122,383,772	
	平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	103,490,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,896,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,990,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	210,838,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	120,162,000	
	地方債証券合計	18,270,240,000	19,385,319,135	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,450,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,422,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,930,000	
	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	109,420,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,901,000	
	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	219,054,000	
	第14回道路債券	100,000,000	111,515,000	
	第17回道路債券	100,000,000	108,896,000	
	第21回道路債券	100,000,000	125,812,000	
	第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,466,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	303,000,000	310,556,820	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,685,000	
	第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	324,216,900	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,000,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,215,000	
	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,122,000	
	第42回道路債券	100,000,000	115,990,000	
	第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,924,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,662,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,163,000	
	第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,006,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,316,000	

第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,296,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,800,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	30,934,500	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	114,569,760	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,520,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	188,969,430	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,982,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,179,000	
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	120,228,000	
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	237,082,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,995,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,144,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,986,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,309,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	145,468,560	
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	117,425,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,515,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,281,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,086,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,710,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,928,000	
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	211,118,000	
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	118,670,000	
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	105,626,000	
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	106,438,000	
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	105,535,000	
	300,000,000	315,366,000	

第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	315,029,610	
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	209,756,000	
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	104,899,000	
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	104,320,000	
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	311,706,000	
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	111,210,000	
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	104,626,000	
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	313,497,000	
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	206,850,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,469,000	
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	308,691,000	
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	210,016,000	
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	103,072,000	
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	214,416,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,980,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,601,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,955,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,206,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	210,978,900	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,083,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,770,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,808,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,344,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	334,335,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,822,300	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	105,185,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,927,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	124,794,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	118,247,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,132,800	

第 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,548,000	
第 1 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,609,000	
第 1 1 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,806,000	
第 1 5 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,986,000	
第 1 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,972,330	
第 1 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,516,000	
第 2 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,341,790	
第 2 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,455,920	
第 2 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,811,000	
第 2 4 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	110,387,000	
第 3 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,649,000	
第 3 8 回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	519,675,000	
第 4 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,784,000	
第 4 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,462,000	
第 4 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,920,000	
第 5 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,649,000	
第 5 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,474,000	
第 5 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,998,000	
第 6 5 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,990,000	
第 8 7 1 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,079,000	
第 8 7 2 回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,416,000	
第 8 7 4 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,331,000	
第 8 7 5 回政府保証公営企業債券	212,000,000	217,234,280	
第 8 7 6 回政府保証公営企業債券	122,000,000	125,559,960	
第 3 回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	105,295,870	
第 5 回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	82,500,000	
第 1 1 回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	300,939,000	
第 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	105,709,630	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	117,896,000	
第 4 3 回都市再生債券	100,000,000	105,546,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,517,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	109,784,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	21,194,800	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,348,000	31,545,578	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	24,328,000	26,225,827	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	24,993,000	27,184,386	
第 3 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,635,000	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,332,000	32,850,465	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	26,818,000	28,881,913	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	21,451,000	22,756,936	

第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,374,000
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,834,000	48,561,050
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,390,000	28,241,258
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,464,000	25,352,852
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,945,000	29,904,503
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,109,000	24,993,770
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,185,000	30,002,086
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,446,000	36,075,295
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,692,000	36,268,057
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,449,000	43,968,871
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,459,000	45,239,231
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,176,000	45,890,440
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,955,000	51,508,465
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,669,000	54,438,266
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,201,000	55,864,988
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,867,000
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,534,000	116,977,930
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,186,000	31,145,839
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,629,000	64,575,947
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,990,000	30,881,597
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,555,000
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,005,000	31,605,878
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,919,000	75,776,951
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,714,000	29,047,735
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,070,000	76,184,907
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,325,000	74,434,252
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,779,000	32,433,797
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,850,000	146,225,766
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,629,000	78,033,486
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,806,000	32,197,335
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,759,000	84,560,326
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,599,000	83,391,096
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,033,000	83,945,013
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,240,000
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,214,000	169,132,427
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,893,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,035,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,928,000	173,681,633
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,917,000	88,126,785
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,237,000	89,438,979

第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,909,000	90,255,865	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,121,000	88,258,560	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,289,000	87,427,195	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,635,000	91,154,421	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	173,680,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,401,000	90,512,899	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,068,000	93,856,881	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,260,000	95,101,885	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,034,000	95,442,629	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,855,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,952,000	193,596,685	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,202,000	96,011,217	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,884,000	192,392,145	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,284,000	97,507,753	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,677,000	97,450,389	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,967,000	98,398,054	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,820,000	199,119,677	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,226,000	99,503,832	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,198,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,883,000	
第146回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,282,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	118,123,000	
第11回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,850,000	
い第741号商工債	100,000,000	100,372,000	
い第750号商工債	100,000,000	100,270,000	
い第752号商工債	200,000,000	200,572,000	
い第756号商工債	100,000,000	100,290,000	
い第740号農林債	100,000,000	100,372,000	
い第743号農林債	100,000,000	100,374,000	
い第746号農林債	100,000,000	100,258,000	
い第748号農林債	100,000,000	100,275,000	
い第749号農林債	300,000,000	300,585,000	
い第752号農林債	200,000,000	200,440,000	
第267回信金中金債(5年)	200,000,000	200,744,000	
第274回信金中金債(5年)	100,000,000	100,238,000	
第290回信金中金債(5年)	100,000,000	100,389,000	
第299回信金中金債(5年)	100,000,000	100,059,000	
第300回信金中金債(5年)	300,000,000	300,420,000	
第303回信金中金債(5年)	100,000,000	100,237,000	
第175号商工債(3年)	100,000,000	99,967,000	
第178号商工債(3年)	300,000,000	299,892,000	
第179号商工債(3年)	200,000,000	199,892,000	

	第19回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,431,000	
	第20回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,345,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,495,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	209,562,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,241,000	
	第26回政府保証銀行等保有株式取得機構債	300,000,000	300,063,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,832,000	
	特殊債券合計	25,089,096,000	26,390,274,663	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	101,620,000	
	第6回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,159,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	100,237,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	99,957,000	
	第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	200,340,000	
	第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	101,370,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	102,149,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,719,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,362,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,825,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,249,000	
	第9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	100,000,000	101,347,000	
	第9回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	100,459,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,818,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	100,275,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,744,000	
	第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,395,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,596,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,619,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,256,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,944,000	
	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	100,785,000	
	第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	104,689,000	
	第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	101,614,000	

第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,047,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,729,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,308,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,040,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,377,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	99,510,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,050,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,209,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,325,000	
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,083,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,069,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,589,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,160,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,407,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,160,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,075,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,110,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	199,758,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,390,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,122,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,690,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,045,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,623,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,003,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,508,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,333,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,368,000	
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	100,292,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,093,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,725,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,929,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,031,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	111,853,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,619,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,420,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,608,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,383,000	



第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,392,000	
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,251,000	
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	200,322,000	
第33回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	201,038,000	
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	124,960,000	
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	104,840,000	
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	106,948,000	
第134回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,370,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	99,220,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,200,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,683,000	
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）	100,000,000	99,921,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,078,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,233,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,626,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	207,564,000	
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,525,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,396,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,332,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,453,000	
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	100,588,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,464,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,288,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,570,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,487,000	
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,362,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,407,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,842,000	

第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,554,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,493,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,642,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,391,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,301,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,913,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,784,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,398,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,667,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,791,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,159,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,981,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,023,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,283,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,878,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	239,904,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,058,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,445,110	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	120,243,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,514,600	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,660,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,427,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,865,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,477,000	
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,317,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,732,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,836,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	124,788,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,616,900	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,923,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,053,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,124,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,176,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,286,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,978,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,745,000	

第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,986,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,477,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,745,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,315,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,635,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,367,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,835,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,631,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,206,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,217,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	20,844,600	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,257,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,118,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,290,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,754,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,840,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,727,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,645,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,254,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,288,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,452,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	32,562,710	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	101,819,110	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,621,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,601,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,148,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,998,000	
社債券合計	15,821,000,000	16,274,067,030	
合計		328,375,148,278	

(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

注記事項(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。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,950,916,671
株式	152,998,708,780
派生商品評価勘定	93,038,460
未収入金	604,767,176
未収配当金	1,101,673,591
未収利息	3,143
差入委託証拠金	92,923,000
流動資産合計	156,842,030,821
資産合計	156,842,030,821
負債の部	
流動負債	
前受金	93,039,000
未払金	203,838,860
未払解約金	542,549,007
流動負債合計	839,426,867
負債合計	839,426,867
純資産の部	
元本等	
元本	115,353,132,477
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	40,649,471,477
元本等合計	156,002,603,954
純資産合計	156,002,603,954
負債純資産合計	156,842,030,821

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

	平成27年11月10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）

	平成27年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,353,132,477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 1.3524円 (1万口当たり純資産額) (13,524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

	平成27年11月10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コンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成27年11月10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	平成27年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	平成27年11月10日現在
期首	平成26年11月11日
期首元本額	128,828,967,080円
期中追加設定元本額	21,703,718,040円
期中一部解約元本額	35,179,552,643円
期末元本額	115,353,132,477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）	1,168,465,573円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,267,530,252円
SBI資産設計オープン（分配型）	30,797,323円
SMT TOPIXインデックス・オープン	7,688,039,550円
世界経済インデックスファンド	697,340,398円
マイセクション25	26,142,327円
マイセクション50	73,620,706円
マイセクション75	73,380,848円
日本株式インデックス・オープン	13,661,638,579円
DCマイセクション25	4,965,081,849円
DCマイセクション50	15,765,133,329円
DCマイセクション75	14,587,155,539円
DC日本株式インデックス・オープン	4,534,054,012円
DCマイセクションS25	1,948,881,379円
DCマイセクションS50	5,955,941,910円
DCマイセクションS75	3,816,431,076円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,044,211,635円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	449,873,308円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	500,528,920円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	263,274,159円
DC世界経済インデックスファンド	699,879,207円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	365,744,257円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	65,522,363円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	155,127,737円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	88,906,018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）	945,905,609円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,951,623円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	341,605,475円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,143,527,766円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	658,467,744円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,135,453,752円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,020,798,736円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,239,927,878円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	7,041,072,754円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,155,238,674円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,014,469,883円

区分	平成27年11月10日現在
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,418,531,297円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,581,588,401円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	775,017,762円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,066,459,952円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	84,956,352円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,955,378,904円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,839,335,443円
日本株式ファンド・シリーズ2	679,762,840円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	48,963,378円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	76,262,474円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	164,074,512円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,480,626円
SMT インデックスバランス・オープン	59,198,388円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,607,201,087
合計	6,607,201,087

(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

（平成27年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,582,361,540	-	2,675,400,000	93,038,460
	合計	2,582,361,540	-	2,675,400,000	93,038,460

## (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。

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

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	31,000	269.00	8,339,000	
日本水産	84,400	390.00	32,916,000	
マルハニチロ	15,000	1,966.00	29,490,000	
サカタのタネ	11,800	2,486.00	29,334,800	
ホクト	7,400	2,270.00	16,798,000	
住石ホールディングス	21,500	123.00	2,644,500	
日鉄鉱業	20,000	566.00	11,320,000	
三井松島産業	48,000	126.00	6,048,000	
国際石油開発帝石	385,900	1,167.50	450,538,250	
日本海洋掘削	2,200	2,654.00	5,838,800	
石油資源開発	11,600	3,445.00	39,962,000	
K & O エナジーグループ	4,900	1,621.00	7,942,900	
ショーボンドホールディングス	7,100	4,860.00	34,506,000	
ミライト・ホールディングス	22,500	1,020.00	22,950,000	
タマホーム	5,500	463.00	2,546,500	
サンヨーホームズ	1,500	520.00	780,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,198.00	2,036,600	
安藤・間	48,900	713.00	34,865,700	
東急建設	23,900	852.00	20,362,800	
コムシスホールディングス	32,600	1,589.00	51,801,400	
ミサワホーム	9,200	823.00	7,571,600	
高松コンストラクショングループ	5,500	2,506.00	13,783,000	
東建コーポレーション	2,700	9,350.00	25,245,000	
ヤマウラ	3,700	472.00	1,746,400	
大成建設	380,000	772.00	293,360,000	
大林組	220,000	1,073.00	236,060,000	
清水建設	224,000	1,062.00	237,888,000	
飛島建設	50,700	223.00	11,306,100	
長谷工コーポレーション	85,500	1,252.00	107,046,000	
松井建設	8,100	685.00	5,548,500	
銭高組	10,000	566.00	5,660,000	
鹿島建設	343,000	684.00	234,612,000	
不動テトラ	51,800	154.00	7,977,200	
大末建設	2,800	870.00	2,436,000	
鉄建建設	45,000	338.00	15,210,000	
西松建設	85,000	492.00	41,820,000	
三井住友建設	280,700	119.00	33,403,300	

大豊建設	28,000	570.00	15,960,000
前田建設工業	45,000	842.00	37,890,000
佐田建設	5,100	565.00	2,881,500
ナカノフドー建設	5,600	681.00	3,813,600
奥村組	70,000	637.00	44,590,000
東鉄工業	8,800	2,635.00	23,188,000
イチケン	8,000	422.00	3,376,000
浅沼組	24,000	309.00	7,416,000
戸田建設	85,000	623.00	52,955,000
熊谷組	107,000	356.00	38,092,000
青木あすなろ建設	4,800	862.00	4,137,600
北野建設	16,000	326.00	5,216,000
植木組	11,000	265.00	2,915,000
三井ホーム	10,000	577.00	5,770,000
矢作建設工業	10,000	895.00	8,950,000
ピーエス三菱	8,900	405.00	3,604,500
日本ハウスホールディングス	14,900	467.00	6,958,300
大東建託	27,400	12,660.00	346,884,000
新日本建設	8,800	555.00	4,884,000
N I P P O	17,000	2,081.00	35,377,000
東亜道路工業	14,000	476.00	6,664,000
前田道路	23,000	2,213.00	50,899,000
日本道路	22,000	664.00	14,608,000
東亜建設工業	64,000	295.00	18,880,000
若築建設	42,000	156.00	6,552,000
東洋建設	23,000	551.00	12,673,000
五洋建設	81,300	520.00	42,276,000
大林道路	9,000	890.00	8,010,000
世紀東急工業	11,500	634.00	7,291,000
福田組	12,000	1,199.00	14,388,000
住友林業	50,400	1,611.00	81,194,400
日本基礎技術	8,100	525.00	4,252,500
日成ビルド工業	21,000	388.00	8,148,000
巴コーポレーション	10,000	373.00	3,730,000
パナホーム	27,000	900.00	24,300,000
大和ハウス工業	216,400	3,337.00	722,126,800
ライト工業	14,100	1,135.00	16,003,500
積水ハウス	244,900	2,032.00	497,636,800
日特建設	8,000	530.00	4,240,000
北陸電気工事	2,700	1,064.00	2,872,800
ユアテック	12,000	1,145.00	13,740,000
西部電気工業	6,000	424.00	2,544,000

四電工	6,000	432.00	2,592,000
中電工	10,600	2,612.00	27,687,200
関電工	29,000	823.00	23,867,000
きんでん	44,300	1,619.00	71,721,700
東京エネシス	8,000	1,169.00	9,352,000
トーエネック	10,000	868.00	8,680,000
住友電設	5,800	1,615.00	9,367,000
日本電設工業	11,900	2,323.00	27,643,700
協和エクシオ	28,700	1,170.00	33,579,000
新日本空調	6,200	1,046.00	6,485,200
N D S	12,000	315.00	3,780,000
九電工	13,000	2,320.00	30,160,000
三機工業	16,300	1,065.00	17,359,500
日揮	74,000	1,970.00	145,780,000
中外炉工業	22,000	233.00	5,126,000
ヤマト	6,600	499.00	3,293,400
太平電業	11,000	1,276.00	14,036,000
高砂熱学工業	21,800	1,791.00	39,043,800
三晃金属工業	8,000	289.00	2,312,000
朝日工業社	8,000	450.00	3,600,000
明星工業	13,300	575.00	7,647,500
大気社	9,000	2,881.00	25,929,000
ダイダン	10,000	877.00	8,770,000
日比谷総合設備	8,800	1,658.00	14,590,400
東芝プラントシステム	11,900	1,266.00	15,065,400
O S J Bホールディングス	14,900	237.00	3,531,300
東洋エンジニアリング	40,000	313.00	12,520,000
千代田化工建設	53,000	919.00	48,707,000
新興プランテック	15,000	980.00	14,700,000
日本製粉	48,000	801.00	38,448,000
日清製粉グループ本社	80,300	1,887.00	151,526,100
日東富士製粉	6,000	353.00	2,118,000
昭和産業	30,000	473.00	14,190,000
鳥越製粉	5,900	805.00	4,749,500
中部飼料	6,800	1,061.00	7,214,800
フィード・ワン	44,300	139.00	6,157,700
東洋精糖	11,000	117.00	1,287,000
日本甜菜製糖	38,000	197.00	7,486,000
三井製糖	29,000	519.00	15,051,000
塩水港精糖	8,000	252.00	2,016,000
森永製菓	66,000	642.00	42,372,000
中村屋	17,000	473.00	8,041,000

江崎グリコ	16,900	6,390.00	107,991,000
名糖産業	3,300	1,310.00	4,323,000
不二家	42,000	202.00	8,484,000
山崎製パン	54,000	2,342.00	126,468,000
第一屋製パン	11,000	121.00	1,331,000
モロゾフ	11,000	416.00	4,576,000
亀田製菓	4,100	4,750.00	19,475,000
寿スピリッツ	1,700	4,605.00	7,828,500
カルビー	27,100	4,725.00	128,047,500
森永乳業	66,000	541.00	35,706,000
六甲バター	3,300	1,742.00	5,748,600
ヤクルト本社	39,300	6,610.00	259,773,000
明治ホールディングス	43,400	9,630.00	417,942,000
雪印メグミルク	17,200	2,454.00	42,208,800
プリマハム	46,000	355.00	16,330,000
日本ハム	54,000	2,395.00	129,330,000
伊藤ハム	35,000	639.00	22,365,000
丸大食品	38,000	467.00	17,746,000
米久	2,400	2,319.00	5,565,600
S Foods	4,600	2,120.00	9,752,000
サッポロホールディングス	112,000	523.00	58,576,000
アサヒグループホールディングス	137,400	3,811.00	523,631,400
キリンホールディングス	296,900	1,681.50	499,237,350
宝ホールディングス	53,100	910.00	48,321,000
オエノンホールディングス	20,000	224.00	4,480,000
養命酒製造	2,300	1,989.00	4,574,700
コカ・コーラウエスト	24,800	2,418.00	59,966,400
コカ・コーライーストジャパン	25,900	1,744.00	45,169,600
サントリー食品インターナショナル	50,200	4,860.00	243,972,000
ダイトードリンコ	3,700	5,400.00	19,980,000
伊藤園	21,700	2,576.00	55,899,200
キーコーヒー	6,500	1,930.00	12,545,000
ユニカフェ	2,000	913.00	1,826,000
ジャパンフーズ	1,000	1,134.00	1,134,000
日清オイリオグループ	39,000	488.00	19,032,000
不二製油グループ本社	19,600	1,792.00	35,123,200
かどや製油	700	2,686.00	1,880,200
J - オイルミルズ	31,000	349.00	10,819,000
キッコーマン	56,000	3,945.00	220,920,000
味の素	157,000	2,794.00	438,658,000
キューピー	37,300	2,758.00	102,873,400
ハウス食品グループ本社	25,000	2,125.00	53,125,000

カゴメ	26,300	1,982.00	52,126,600
焼津水産化学工業	3,500	991.00	3,468,500
アリアケジャパン	6,000	5,520.00	33,120,000
エバラ食品工業	1,800	2,069.00	3,724,200
ニチレイ	78,000	824.00	64,272,000
東洋水産	36,000	4,305.00	154,980,000
イトアンド	800	2,222.00	1,777,600
日清食品ホールディングス	31,000	5,600.00	173,600,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,069.00	7,483,000
一正蒲鉾	2,600	1,139.00	2,961,400
フジッコ	7,100	2,308.00	16,386,800
ロック・フィールド	3,800	2,965.00	11,267,000
日本たばこ産業	433,000	4,443.00	1,923,819,000
ケンコーマヨネーズ	2,400	1,687.00	4,048,800
わらべや日洋	4,000	2,397.00	9,588,000
なとり	3,700	1,622.00	6,001,400
ユーグレナ	24,700	1,678.00	41,446,600
ミヨシ油脂	25,000	140.00	3,500,000
理研ビタミン	2,200	3,980.00	8,756,000
片倉工業	8,700	1,398.00	12,162,600
ゲンゼ	55,000	371.00	20,405,000
東洋紡	272,000	183.00	49,776,000
ユニチカ	199,000	58.00	11,542,000
富士紡ホールディングス	33,000	215.00	7,095,000
倉敷紡績	70,000	210.00	14,700,000
シキボウ	42,000	124.00	5,208,000
日本毛織	22,000	992.00	21,824,000
トーア紡コーポレーション	2,900	665.00	1,928,500
ダイドーリミテッド	7,700	497.00	3,826,900
帝国繊維	7,200	1,583.00	11,397,600
帝人	280,000	420.00	117,600,000
東レ	497,000	1,092.00	542,724,000
サカイオーベックス	18,000	210.00	3,780,000
住江織物	19,000	352.00	6,688,000
日本フェルト	3,600	502.00	1,807,200
イチカワ	5,000	345.00	1,725,000
芦森工業	18,000	233.00	4,194,000
アツギ	58,000	121.00	7,018,000
ダイニック	13,000	168.00	2,184,000
セーレン	17,100	1,517.00	25,940,700
東海染工	10,000	125.00	1,250,000
小松精練	11,300	698.00	7,887,400

ワコールホールディングス	41,000	1,485.00	60,885,000
ホギメディカル	4,300	6,300.00	27,090,000
レナウン	18,500	140.00	2,590,000
クラウドディア	3,200	585.00	1,872,000
T S Iホールディングス	30,600	880.00	26,928,000
三陽商会	39,000	309.00	12,051,000
オンワードホールディングス	46,000	776.00	35,696,000
ルック	14,000	178.00	2,492,000
ゴールドウイン	3,100	6,090.00	18,879,000
デサント	15,700	1,558.00	24,460,600
キング	3,500	420.00	1,470,000
ヤマトインターナショナル	4,500	418.00	1,881,000
特種東海製紙	40,000	415.00	16,600,000
王子ホールディングス	281,000	572.00	160,732,000
日本製紙	35,400	2,031.00	71,897,400
三菱製紙	104,000	87.00	9,048,000
北越紀州製紙	42,500	843.00	35,827,500
中越パルプ工業	27,000	216.00	5,832,000
巴川製紙所	11,000	226.00	2,486,000
大王製紙	30,300	1,183.00	35,844,900
レンゴー	61,000	557.00	33,977,000
トモク	22,000	279.00	6,138,000
ザ・パック	4,800	2,946.00	14,140,800
クラレ	108,000	1,532.00	165,456,000
旭化成	427,000	746.00	318,542,000
共和レザー	4,500	963.00	4,333,500
昭和電工	456,000	154.00	70,224,000
住友化学	504,000	684.00	344,736,000
日本化成	13,000	133.00	1,729,000
住友精化	14,000	771.00	10,794,000
日産化学工業	41,200	3,150.00	129,780,000
ラサ工業	26,000	140.00	3,640,000
クレハ	52,000	472.00	24,544,000
多木化学	4,000	729.00	2,916,000
テイカ	11,000	576.00	6,336,000
石原産業	123,000	105.00	12,915,000
片倉コープアグリ	8,000	261.00	2,088,000
日東エフシー	4,000	949.00	3,796,000
日本曹達	44,000	773.00	34,012,000
東ソー	185,000	653.00	120,805,000
トクヤマ	114,000	276.00	31,464,000
セントラル硝子	74,000	609.00	45,066,000

東亜合成	42,900	1,061.00	45,516,900
大阪ソーダ	29,000	437.00	12,673,000
関東電化工業	16,000	994.00	15,904,000
デンカ	142,000	547.00	77,674,000
信越化学工業	122,800	7,241.00	889,194,800
日本カーバイド工業	23,000	182.00	4,186,000
堺化学工業	28,000	379.00	10,612,000
エア・ウォーター	56,000	1,999.00	111,944,000
大陽日酸	52,700	1,219.00	64,241,300
日本化学工業	25,000	275.00	6,875,000
日本パーカライズン	35,000	1,163.00	40,705,000
高压ガス工業	10,000	640.00	6,400,000
チタン工業	8,000	211.00	1,688,000
四国化成工業	10,000	1,253.00	12,530,000
戸田工業	14,000	310.00	4,340,000
ステラ ケミファ	3,500	1,335.00	4,672,500
保土谷化学工業	20,000	170.00	3,400,000
日本触媒	9,900	9,310.00	92,169,000
大日精化工業	26,000	574.00	14,924,000
カネカ	92,000	1,049.00	96,508,000
三菱瓦斯化学	118,000	630.00	74,340,000
三井化学	290,000	492.00	142,680,000
J S R	67,600	1,886.00	127,493,600
東京応化工業	13,700	3,715.00	50,895,500
大阪有機化学工業	5,000	653.00	3,265,000
三菱ケミカルホールディングス	458,700	800.20	367,051,740
日本合成化学工業	16,000	879.00	14,064,000
ダイセル	96,300	1,826.00	175,843,800
住友ベークライト	64,000	517.00	33,088,000
積水化学工業	158,500	1,449.00	229,666,500
日本ゼオン	59,000	991.00	58,469,000
アイカ工業	20,600	2,408.00	49,604,800
宇部興産	366,000	246.00	90,036,000
積水樹脂	10,600	1,656.00	17,553,600
タキロン	16,000	554.00	8,864,000
旭有機材工業	22,000	231.00	5,082,000
日立化成	33,800	2,064.00	69,763,200
ニチバン	7,000	590.00	4,130,000
リケンテクノス	11,100	426.00	4,728,600
大倉工業	16,000	360.00	5,760,000
積水化成成品工業	18,000	398.00	7,164,000
群栄化学工業	18,000	313.00	5,634,000

タイガースポリマー	3,400	702.00	2,386,800
ミライアル	2,500	1,183.00	2,957,500
ダイキアクシス	1,300	1,018.00	1,323,400
ダイキョーニシカワ	2,200	6,620.00	14,564,000
日本化薬	44,000	1,364.00	60,016,000
カーリットホールディングス	6,400	545.00	3,488,000
日本精化	5,700	931.00	5,306,700
A D E K A	33,700	1,783.00	60,087,100
日油	52,000	949.00	49,348,000
ハリマ化成グループ	5,900	536.00	3,162,400
花王	184,100	6,095.00	1,122,089,500
第一工業製薬	15,000	387.00	5,805,000
ニイタカ	1,000	1,562.00	1,562,000
三洋化成工業	22,000	964.00	21,208,000
大日本塗料	39,000	191.00	7,449,000
日本ペイントホールディングス	52,800	2,751.00	145,252,800
関西ペイント	77,500	1,863.00	144,382,500
神東塗料	5,000	204.00	1,020,000
中国塗料	20,000	906.00	18,120,000
日本特殊塗料	4,800	1,088.00	5,222,400
藤倉化成	9,300	575.00	5,347,500
太陽ホールディングス	5,000	4,245.00	21,225,000
D I C	274,000	323.00	88,502,000
サカタインクス	14,000	1,141.00	15,974,000
東洋インキ S C ホールディングス	68,000	504.00	34,272,000
T & K T O K A	2,500	2,277.00	5,692,500
富士フイルムホールディングス	156,700	5,000.00	783,500,000
資生堂	129,900	2,744.50	356,510,550
ライオン	79,000	1,172.00	92,588,000
高砂香料工業	4,500	3,210.00	14,445,000
マンダム	6,400	4,680.00	29,952,000
ミルボン	4,000	4,660.00	18,640,000
ファンケル	15,900	1,725.00	27,427,500
コーセー	11,100	11,450.00	127,095,000
コタ	2,200	1,231.00	2,708,200
ドクターシーラボ	9,300	2,283.00	21,231,900
シーボン	800	2,536.00	2,028,800
ポーラ・オルビスホールディングス	7,000	7,790.00	54,530,000
ノエビアホールディングス	4,300	3,135.00	13,480,500
アジュバンコスメジャパン	1,300	940.00	1,222,000
エステー	4,700	1,026.00	4,822,200
アグロ カネショウ	2,700	976.00	2,635,200



コニシ	5,400	2,374.00	12,819,600
長谷川香料	8,700	1,580.00	13,746,000
星光P M C	3,800	1,066.00	4,050,800
小林製薬	10,400	9,360.00	97,344,000
荒川化学工業	5,800	1,200.00	6,960,000
メック	5,300	858.00	4,547,400
日本高純度化学	1,900	2,325.00	4,417,500
J C U	2,000	4,645.00	9,290,000
新田ゼラチン	4,500	780.00	3,510,000
デクセリアルズ	15,400	1,375.00	21,175,000
アース製薬	4,900	4,995.00	24,475,500
イハラケミカル工業	10,600	1,515.00	16,059,000
北興化学工業	7,000	460.00	3,220,000
大成ラミック	1,900	2,934.00	5,574,600
クミアイ化学工業	14,100	995.00	14,029,500
日本農薬	15,600	833.00	12,994,800
アキレス	58,000	154.00	8,932,000
有沢製作所	10,100	809.00	8,170,900
日東電工	52,900	8,781.00	464,514,900
レック	2,200	1,307.00	2,875,400
きもと	11,300	270.00	3,051,000
藤森工業	5,900	3,300.00	19,470,000
前澤化成工業	4,800	1,080.00	5,184,000
J S P	4,500	2,679.00	12,055,500
エフピコ	6,100	4,685.00	28,578,500
天馬	5,300	2,187.00	11,591,100
信越ポリマー	13,400	647.00	8,669,800
東リ	18,000	358.00	6,444,000
ニフコ	13,100	4,975.00	65,172,500
日本バルカー工業	27,000	314.00	8,478,000
ユニ・チャーム	138,600	2,607.50	361,399,500
協和発酵キリン	82,000	2,121.00	173,922,000
武田薬品工業	272,600	6,180.00	1,684,668,000
アステラス製薬	766,700	1,801.00	1,380,826,700
大日本住友製薬	48,500	1,399.00	67,851,500
塩野義製薬	99,800	5,253.00	524,249,400
田辺三菱製薬	79,800	2,121.00	169,255,800
わかもと製薬	8,000	286.00	2,288,000
あすか製薬	8,700	1,207.00	10,500,900
日本新薬	16,000	5,110.00	81,760,000
バイオフェルミン製薬	1,100	3,545.00	3,899,500
中外製薬	68,200	4,170.00	284,394,000

科研製薬	11,800	8,090.00	95,462,000
エーザイ	84,300	7,774.00	655,348,200
ロート製薬	33,500	2,120.00	71,020,000
小野薬品工業	31,100	17,415.00	541,606,500
久光製薬	21,200	4,990.00	105,788,000
有機合成薬品工業	4,000	287.00	1,148,000
持田製薬	4,700	7,460.00	35,062,000
参天製薬	126,000	1,791.00	225,666,000
扶桑薬品工業	23,000	285.00	6,555,000
日本ケミファ	10,000	617.00	6,170,000
ツムラ	21,500	3,270.00	70,305,000
日医工	16,000	3,085.00	49,360,000
キッセイ薬品工業	12,100	3,230.00	39,083,000
生化学工業	13,100	1,738.00	22,767,800
栄研化学	5,700	2,252.00	12,836,400
日水製薬	2,700	1,386.00	3,742,200
鳥居薬品	4,700	2,799.00	13,155,300
JCRファーマ	5,300	2,707.00	14,347,100
東和薬品	3,100	7,950.00	24,645,000
富士製薬工業	1,900	2,202.00	4,183,800
沢井製薬	11,600	7,400.00	85,840,000
ゼリア新薬工業	14,000	1,774.00	24,836,000
第一三共	230,300	2,488.00	572,986,400
キョーリン製薬ホールディングス	18,300	2,197.00	40,205,100
大幸薬品	3,300	1,850.00	6,105,000
ダイト	3,000	2,872.00	8,616,000
大塚ホールディングス	147,200	4,191.00	616,915,200
大正製薬ホールディングス	16,500	8,070.00	133,155,000
日本コークス工業	55,200	105.00	5,796,000
昭和シェル石油	68,800	1,080.00	74,304,000
ニチレキ	8,000	989.00	7,912,000
東燃ゼネラル石油	103,000	1,262.00	129,986,000
ユシロ化学工業	3,700	1,492.00	5,520,400
ビーピー・カストロール	2,800	1,280.00	3,584,000
富士石油	15,900	397.00	6,312,300
MORESCO	2,200	1,604.00	3,528,800
出光興産	35,700	1,984.00	70,828,800
JXホールディングス	810,400	473.70	383,886,480
コスモエネルギーホールディングス	20,600	1,568.00	32,300,800
横浜ゴム	41,300	2,184.00	90,199,200
東洋ゴム工業	31,000	2,717.00	84,227,000
ブリヂストン	231,100	4,590.00	1,060,749,000

住友ゴム工業	64,100	1,750.00	112,175,000
藤倉ゴム工業	5,700	602.00	3,431,400
オカモト	21,000	971.00	20,391,000
フコク	2,500	1,051.00	2,627,500
ニッタ	7,400	3,555.00	26,307,000
住友理工	14,800	1,006.00	14,888,800
三ツ星ベルト	17,000	988.00	16,796,000
バンドー化学	25,000	525.00	13,125,000
日東紡績	46,000	376.00	17,296,000
旭硝子	361,000	730.00	263,530,000
日本板硝子	330,000	106.00	34,980,000
石塚硝子	10,000	265.00	2,650,000
日本山村硝子	28,000	186.00	5,208,000
日本電気硝子	141,000	677.00	95,457,000
オハラ	2,600	598.00	1,554,800
住友大阪セメント	136,000	514.00	69,904,000
太平洋セメント	427,000	393.00	167,811,000
デイ・シイ	7,500	364.00	2,730,000
日本ヒューム	6,600	773.00	5,101,800
日本コンクリート工業	14,900	394.00	5,870,600
三谷セキサン	3,400	1,617.00	5,497,800
アジアパイルホールディングス	8,500	660.00	5,610,000
東海カーボン	60,000	361.00	21,660,000
日本カーボン	34,000	355.00	12,070,000
東洋炭素	3,800	1,789.00	6,798,200
ノリタケカンパニーリミテド	39,000	287.00	11,193,000
TOTO	50,300	4,395.00	221,068,500
日本碍子	86,000	2,857.00	245,702,000
日本特殊陶業	59,000	3,265.00	192,635,000
MARUWA	2,500	2,990.00	7,475,000
品川リフラクトリーズ	18,000	269.00	4,842,000
黒崎播磨	17,000	261.00	4,437,000
ヨータイ	4,000	349.00	1,396,000
イソライト工業	5,500	228.00	1,254,000
東京窯業	9,000	192.00	1,728,000
ニッカトー	2,400	405.00	972,000
フジインコーポレーテッド	6,000	1,653.00	9,918,000
ニチアス	35,000	817.00	28,595,000
ニチハ	9,100	1,675.00	15,242,500
新日鐵住金	308,600	2,487.00	767,488,200
神戸製鋼所	1,258,000	147.00	184,926,000
合同製鐵	40,000	231.00	9,240,000

ジェイ エフ イー ホールディングス	187,100	1,907.00	356,799,700
日新製鋼	31,500	1,308.00	41,202,000
東京製鐵	37,800	823.00	31,109,400
共英製鋼	7,400	2,049.00	15,162,600
大和工業	15,300	3,300.00	50,490,000
東京鐵鋼	15,000	579.00	8,685,000
大阪製鐵	4,300	2,241.00	9,636,300
淀川製鋼所	10,200	2,375.00	24,225,000
東洋鋼鈹	17,100	388.00	6,634,800
丸一鋼管	22,900	3,195.00	73,165,500
モリ工業	12,000	372.00	4,464,000
大同特殊鋼	115,000	497.00	57,155,000
日本高周波鋼業	31,000	99.00	3,069,000
日本冶金工業	52,800	164.00	8,659,200
山陽特殊製鋼	41,000	515.00	21,115,000
愛知製鋼	41,000	514.00	21,074,000
日立金属	78,500	1,405.00	110,292,500
日本金属	18,000	144.00	2,592,000
大平洋金属	48,000	341.00	16,368,000
新日本電工	39,700	226.00	8,972,200
栗本鐵工所	34,000	219.00	7,446,000
虹技	10,000	187.00	1,870,000
日本鑄鉄管	9,000	196.00	1,764,000
三菱製鋼	49,000	245.00	12,005,000
日亜鋼業	11,000	257.00	2,827,000
日本精線	5,000	557.00	2,785,000
シンニッタン	6,400	610.00	3,904,000
新家工業	16,000	144.00	2,304,000
大紀アルミニウム工業所	11,000	344.00	3,784,000
日本軽金属ホールディングス	155,000	216.00	33,480,000
三井金属鋁業	175,000	235.00	41,125,000
東邦亜鉛	36,000	320.00	11,520,000
三菱マテリアル	427,000	410.00	175,070,000
住友金属鋁山	189,000	1,491.00	281,799,000
D O W A ホールディングス	88,000	906.00	79,728,000
古河機械金属	107,000	251.00	26,857,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,700	3,140.00	21,038,000
東邦チタニウム	11,600	1,502.00	17,423,200
U A C J	96,000	278.00	26,688,000
古河電気工業	215,000	246.00	52,890,000
住友電気工業	274,000	1,691.50	463,471,000
フジクラ	95,000	637.00	60,515,000

昭和電線ホールディングス	81,000	79.00	6,399,000
東京特殊電線	1,100	1,047.00	1,151,700
タツタ電線	14,600	471.00	6,876,600
沖電線	9,000	268.00	2,412,000
カナレ電気	1,200	2,005.00	2,406,000
平河ヒューテック	1,700	1,448.00	2,461,600
リョービ	42,000	421.00	17,682,000
アーレスティ	7,900	855.00	6,754,500
アサヒホールディングス	10,300	1,806.00	18,601,800
稲葉製作所	3,700	1,313.00	4,858,100
宮地エンジニアリンググループ	24,000	212.00	5,088,000
トーカロ	4,900	2,686.00	13,161,400
アルファC o	2,700	1,375.00	3,712,500
SUMCO	54,300	1,133.00	61,521,900
川田テクノロジーズ	1,500	4,500.00	6,750,000
東洋製罐グループホールディングス	48,700	2,222.00	108,211,400
ホッカンホールディングス	20,000	328.00	6,560,000
コロナ	3,600	1,157.00	4,165,200
横河ブリッジホールディングス	13,100	1,276.00	16,715,600
駒井ハルテック	15,000	249.00	3,735,000
高田機工	7,000	217.00	1,519,000
三和ホールディングス	69,600	1,001.00	69,669,600
文化シャッター	19,200	985.00	18,912,000
三協立山	9,200	1,757.00	16,164,400
アルインコ	3,900	1,154.00	4,500,600
東洋シャッター	2,300	790.00	1,817,000
LIXILグループ	95,300	2,825.00	269,222,500
日本フィルコン	5,900	544.00	3,209,600
ノーリツ	13,400	1,979.00	26,518,600
長府製作所	7,300	2,580.00	18,834,000
リンナイ	12,700	10,490.00	133,223,000
ダイニチ工業	3,500	723.00	2,530,500
日東精工	11,000	330.00	3,630,000
三洋工業	10,000	174.00	1,740,000
岡部	14,200	970.00	13,774,000
ジーテクト	7,300	1,724.00	12,585,200
東プレ	13,200	2,645.00	34,914,000
高周波熱錬	12,700	924.00	11,734,800
サンコール	3,700	579.00	2,142,300
モリテック スチール	4,300	287.00	1,234,100
パイオラックス	3,500	6,410.00	22,435,000
日本発條	64,400	1,218.00	78,439,200

中央発條	9,000	292.00	2,628,000
アドバネクス	1,700	1,824.00	3,100,800
立川ブラインド工業	3,100	855.00	2,650,500
三益半導体工業	5,100	1,223.00	6,237,300
日本ドライケミカル	900	2,232.00	2,008,800
日本製鋼所	113,000	467.00	52,771,000
三浦工業	30,500	1,527.00	46,573,500
タクマ	25,000	988.00	24,700,000
ツガミ	20,000	614.00	12,280,000
オークマ	45,000	1,075.00	48,375,000
東芝機械	37,000	450.00	16,650,000
アマダホールディングス	102,000	1,140.00	116,280,000
アイダエンジニアリング	17,900	1,237.00	22,142,300
滝澤鉄工所	21,000	183.00	3,843,000
富士機械製造	22,300	1,147.00	25,578,100
牧野フライス製作所	34,000	1,032.00	35,088,000
オーエスジー	31,200	2,364.00	73,756,800
ダイジェット工業	10,000	176.00	1,760,000
旭ダイヤモンド工業	18,700	1,355.00	25,338,500
D M G 森精機	37,800	1,862.00	70,383,600
ソディック	13,000	948.00	12,324,000
ディスコ	8,700	11,240.00	97,788,000
日東工器	4,000	2,643.00	10,572,000
パンチ工業	2,700	1,001.00	2,702,700
豊和工業	4,200	678.00	2,847,600
O K K	30,000	148.00	4,440,000
東洋機械金属	5,000	448.00	2,240,000
津田駒工業	17,000	130.00	2,210,000
島精機製作所	9,700	1,826.00	17,712,200
日阪製作所	8,600	980.00	8,428,000
やまびこ	12,500	1,123.00	14,037,500
ペガサスミシン製造	7,100	496.00	3,521,600
ナブテスコ	36,400	2,499.00	90,963,600
三井海洋開発	8,000	1,845.00	14,760,000
レオン自動機	5,800	706.00	4,094,800
S M C	20,500	32,200.00	660,100,000
新川	6,100	633.00	3,861,300
ホソカワミクロン	11,000	615.00	6,765,000
ユニオンツール	3,000	3,130.00	9,390,000
オイレス工業	8,800	1,926.00	16,948,800
日精エー・エス・ビー機械	2,500	2,508.00	6,270,000
サトーホールディングス	9,200	2,649.00	24,370,800

日本エアーテック	2,400	726.00	1,742,400
日精樹脂工業	5,000	991.00	4,955,000
ワイエイシイ	2,700	948.00	2,559,600
小松製作所	335,400	2,040.50	684,383,700
住友重機械工業	200,000	572.00	114,400,000
日立建機	30,600	1,982.00	60,649,200
日工	10,000	415.00	4,150,000
巴工業	2,800	1,545.00	4,326,000
井関農機	71,000	200.00	14,200,000
TOWA	6,600	777.00	5,128,200
丸山製作所	16,000	199.00	3,184,000
北川鉄工所	32,000	319.00	10,208,000
クボタ	329,000	1,992.00	655,368,000
荏原実業	2,200	1,501.00	3,302,200
三菱化工機	23,000	308.00	7,084,000
月島機械	13,000	1,180.00	15,340,000
帝国電機製作所	5,000	884.00	4,420,000
新東工業	15,500	1,083.00	16,786,500
澁谷工業	5,700	1,800.00	10,260,000
アイチ コーポレーション	9,700	805.00	7,808,500
小森コーポレーション	16,600	1,502.00	24,933,200
鶴見製作所	5,100	2,284.00	11,648,400
住友精密工業	11,000	463.00	5,093,000
酒井重工業	13,000	255.00	3,315,000
荏原製作所	151,000	534.00	80,634,000
石井鐵工所	12,000	204.00	2,448,000
西島製作所	7,300	952.00	6,949,600
北越工業	7,300	866.00	6,321,800
ダイキン工業	95,200	8,597.00	818,434,400
オルガノ	12,000	486.00	5,832,000
トーヨーカネツ	37,000	200.00	7,400,000
栗田工業	41,100	2,688.00	110,476,800
椿本チエイン	39,000	951.00	37,089,000
大同工業	15,000	239.00	3,585,000
日本コンベヤ	23,000	181.00	4,163,000
木村化工機	6,500	527.00	3,425,500
アネスト岩田	11,100	962.00	10,678,200
ダイフク	32,300	1,892.00	61,111,600
サムコ	1,100	933.00	1,026,300
加藤製作所	16,000	549.00	8,784,000
油研工業	14,000	252.00	3,528,000
タダノ	32,000	1,575.00	50,400,000

フジテック	19,000	1,344.00	25,536,000
C K D	18,200	1,134.00	20,638,800
キトー	8,200	978.00	8,019,600
平和	20,300	2,252.00	45,715,600
理想科学工業	7,200	2,010.00	14,472,000
S A N K Y O	18,200	4,675.00	85,085,000
日本金銭機械	6,000	1,344.00	8,064,000
マースエンジニアリング	3,700	2,141.00	7,921,700
福島工業	4,000	2,578.00	10,312,000
オーイズミ	2,700	645.00	1,741,500
ダイコク電機	2,700	1,591.00	4,295,700
竹内製作所	9,700	2,565.00	24,880,500
アマノ	20,200	1,645.00	33,229,000
J U K I	9,700	1,221.00	11,843,700
サンデンホールディングス	40,000	405.00	16,200,000
蛇の目マシン工業	6,300	855.00	5,386,500
マックス	10,000	1,261.00	12,610,000
グローリー	22,300	3,410.00	76,043,000
新晃工業	4,600	1,349.00	6,205,400
大和冷機工業	10,500	839.00	8,809,500
セガサミーホールディングス	70,200	1,311.00	92,032,200
日本ピストンリング	2,700	2,170.00	5,859,000
リケン	30,000	472.00	14,160,000
T P R	8,000	3,175.00	25,400,000
ホシザキ電機	14,300	8,240.00	117,832,000
大豊工業	5,300	1,373.00	7,276,900
日本精工	134,300	1,461.00	196,212,300
N T N	162,000	584.00	94,608,000
ジェイテクト	69,700	2,219.00	154,664,300
不二越	61,000	569.00	34,709,000
日本トムソン	22,000	536.00	11,792,000
T H K	43,500	2,375.00	103,312,500
ユーシン精機	2,500	2,400.00	6,000,000
前澤給装工業	2,700	1,603.00	4,328,100
イーグル工業	8,100	2,511.00	20,339,100
前澤工業	4,800	423.00	2,030,400
日本ピラー工業	6,600	1,013.00	6,685,800
キッツ	31,800	569.00	18,094,200
日立工機	17,500	915.00	16,012,500
マキタ	42,600	6,600.00	281,160,000
日立造船	51,600	645.00	33,282,000
三菱重工業	1,164,000	614.50	715,278,000



I H I	503,000	362.00	182,086,000
日清紡ホールディングス	36,300	1,537.00	55,793,100
イビデン	42,900	1,878.00	80,566,200
コニカミノルタ	163,300	1,275.00	208,207,500
ブラザー工業	84,500	1,500.00	126,750,000
ミネベア	105,000	1,514.00	158,970,000
日立製作所	1,668,000	726.50	1,211,802,000
東芝	1,376,000	316.50	435,504,000
三菱電機	697,000	1,323.00	922,131,000
富士電機	197,000	560.00	110,320,000
東洋電機製造	13,000	444.00	5,772,000
安川電機	81,000	1,533.00	124,173,000
シンフォニアテクノロジー	42,000	210.00	8,820,000
明電舎	60,000	413.00	24,780,000
オリジン電気	10,000	345.00	3,450,000
山洋電気	17,000	809.00	13,753,000
デンヨー	6,000	1,982.00	11,892,000
東芝テック	47,000	402.00	18,894,000
芝浦メカトロニクス	11,000	254.00	2,794,000
マブチモーター	18,700	6,590.00	123,233,000
日本電産	78,700	9,669.00	760,950,300
東光高岳	3,700	1,439.00	5,324,300
ダイヘン	39,000	584.00	22,776,000
田淵電機	7,400	891.00	6,593,400
ヤーマン	800	1,775.00	1,420,000
JVCケンウッド	48,100	297.00	14,285,700
ミマキエンジニアリング	4,500	575.00	2,587,500
第一精工	2,700	1,829.00	4,938,300
日新電機	15,300	795.00	12,163,500
大崎電気工業	12,000	656.00	7,872,000
オムロン	75,000	4,450.00	333,750,000
日東工業	10,500	2,175.00	22,837,500
I D E C	8,500	1,038.00	8,823,000
不二電機工業	600	1,482.00	889,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	126,000	458.00	57,708,000
サクサホールディングス	16,000	242.00	3,872,000
メルコホールディングス	3,600	2,156.00	7,761,600
テクノメディカ	1,500	2,625.00	3,937,500
日本電気	899,000	390.00	350,610,000
富士通	630,000	600.10	378,063,000
沖電気工業	283,000	158.00	44,714,000
岩崎通信機	31,000	79.00	2,449,000

電気興業	17,000	531.00	9,027,000
サンケン電気	36,000	536.00	19,296,000
ナカヨ	6,000	361.00	2,166,000
アイホン	3,700	1,976.00	7,311,200
ルネサスエレクトロニクス	33,900	711.00	24,102,900
セイコーエプソン	97,300	1,945.00	189,248,500
ワコム	51,500	470.00	24,205,000
アルバック	11,000	2,263.00	24,893,000
アクセル	3,300	1,431.00	4,722,300
E I Z O	6,500	2,801.00	18,206,500
ジャパンディスプレイ	122,200	434.00	53,034,800
日本信号	18,000	1,276.00	22,968,000
京三製作所	15,000	355.00	5,325,000
能美防災	7,400	1,464.00	10,833,600
ホーチキ	4,800	1,187.00	5,697,600
エレコム	5,700	1,604.00	9,142,800
日本無線	17,000	435.00	7,395,000
パナソニック	746,900	1,434.50	1,071,428,050
シャープ	552,000	130.00	71,760,000
アンリツ	39,200	791.00	31,007,200
富士通ゼネラル	20,000	1,585.00	31,700,000
日立国際電気	15,000	1,767.00	26,505,000
ソニー	461,200	3,463.00	1,597,135,600
T D K	39,500	8,650.00	341,675,000
帝国通信工業	16,000	210.00	3,360,000
ミツミ電機	24,900	633.00	15,761,700
タムラ製作所	25,000	387.00	9,675,000
アルプス電気	55,300	3,885.00	214,840,500
池上通信機	21,000	152.00	3,192,000
パイオニア	105,800	327.00	34,596,600
日本電波工業	5,900	817.00	4,820,300
鈴木	1,800	617.00	1,110,600
日本トリム	1,800	4,700.00	8,460,000
ローランド ディー . ジー .	3,200	2,922.00	9,350,400
フォスター電機	8,200	2,993.00	24,542,600
クラリオン	34,000	412.00	14,008,000
S M K	19,000	622.00	11,818,000
ヨコオ	4,700	702.00	3,299,400
東光	13,000	379.00	4,927,000
ホシデン	19,900	681.00	13,551,900
ヒロセ電機	10,600	15,110.00	160,166,000
日本航空電子工業	19,000	2,156.00	40,964,000

TOA	7,700	1,165.00	8,970,500
日立マクセル	10,800	2,103.00	22,712,400
古野電気	7,800	884.00	6,895,200
ユニデンホールディングス	21,000	195.00	4,095,000
アルパイン	15,600	1,628.00	25,396,800
スミダコーポレーション	5,400	771.00	4,163,400
アイコム	3,600	2,523.00	9,082,800
リオン	2,500	1,804.00	4,510,000
船井電機	6,600	1,137.00	7,504,200
横河電機	65,400	1,489.00	97,380,600
新電元工業	23,000	478.00	10,994,000
アズビル	21,300	3,215.00	68,479,500
東亜ディーケーケー	2,800	508.00	1,422,400
日本光電工業	27,300	2,567.00	70,079,100
チノー	2,300	1,126.00	2,589,800
共和電業	8,000	451.00	3,608,000
日本電子材料	2,600	626.00	1,627,600
堀場製作所	12,100	4,545.00	54,994,500
アドバンテスト	44,600	1,034.00	46,116,400
小野測器	3,200	950.00	3,040,000
エスベック	6,800	1,306.00	8,880,800
パナソニック デバイスSUNX	5,800	683.00	3,961,400
キーエンス	14,800	66,510.00	984,348,000
日置電機	3,400	2,277.00	7,741,800
シスメックス	50,700	7,380.00	374,166,000
メガチップス	6,900	1,152.00	7,948,800
OBARA GROUP	4,200	4,770.00	20,034,000
澤藤電機	4,000	237.00	948,000
コーセル	9,100	1,215.00	11,056,500
新日本無線	5,000	659.00	3,295,000
オブテックス	4,800	2,361.00	11,332,800
千代田インテグレ	3,500	3,005.00	10,517,500
レーザーテック	6,700	1,339.00	8,971,300
スタンレー電気	46,900	2,491.00	116,827,900
岩崎電気	22,000	245.00	5,390,000
ウシオ電機	39,700	1,817.00	72,134,900
岡谷電機産業	3,600	403.00	1,450,800
ヘリオス テクノ ホールディング	5,600	434.00	2,430,400
日本セラミック	3,800	1,854.00	7,045,200
遠藤照明	3,300	1,146.00	3,781,800
日本デジタル研究所	5,500	1,688.00	9,284,000
古河電池	5,000	778.00	3,890,000

双信電機	3,300	323.00	1,065,900
山一電機	5,700	890.00	5,073,000
図研	4,800	1,205.00	5,784,000
日本電子	26,000	737.00	19,162,000
カシオ計算機	65,500	2,496.00	163,488,000
ファナック	66,900	22,010.00	1,472,469,000
日本シイエムケイ	14,200	223.00	3,166,600
エンプラス	3,300	4,905.00	16,186,500
大真空	12,000	252.00	3,024,000
ローム	32,200	6,650.00	214,130,000
浜松ホトニクス	51,000	3,100.00	158,100,000
三井ハイテック	9,500	736.00	6,992,000
新光電気工業	24,700	808.00	19,957,600
京セラ	107,300	5,952.00	638,649,600
太陽誘電	31,800	1,900.00	60,420,000
村田製作所	68,600	19,225.00	1,318,835,000
ユーシン	8,300	764.00	6,341,200
双葉電子工業	11,200	1,606.00	17,987,200
北陸電気工業	26,000	167.00	4,342,000
ニチコン	20,600	1,052.00	21,671,200
日本ケミコン	53,000	255.00	13,515,000
K O A	9,100	1,066.00	9,700,600
市光工業	16,000	212.00	3,392,000
小糸製作所	39,200	4,760.00	186,592,000
ミツバ	11,100	2,045.00	22,699,500
スター精密	12,400	1,701.00	21,092,400
S C R E E Nホールディングス	67,000	797.00	53,399,000
キャノン電子	6,000	2,106.00	12,636,000
キャノン	351,900	3,773.00	1,327,718,700
リコー	211,700	1,362.00	288,335,400
M U T O Hホールディングス	8,000	300.00	2,400,000
東京エレクトロン	58,700	7,744.00	454,572,800
トヨタ紡織	22,900	2,696.00	61,738,400
鬼怒川ゴム工業	15,000	726.00	10,890,000
ユニプレス	13,600	2,918.00	39,684,800
豊田自動織機	59,700	6,700.00	399,990,000
モリタホールディングス	11,500	1,244.00	14,306,000
三櫻工業	9,200	788.00	7,249,600
デンソー	161,600	5,824.00	941,158,400
東海理化電機製作所	19,200	2,618.00	50,265,600
三井造船	253,000	196.00	49,588,000
川崎重工業	509,000	491.00	249,919,000

名村造船所	19,600	1,059.00	20,756,400
サノヤスホールディングス	8,100	265.00	2,146,500
日本車輛製造	27,000	298.00	8,046,000
ニチユ三菱フォークリフト	7,500	544.00	4,080,000
近畿車輛	10,000	399.00	3,990,000
日産自動車	917,600	1,284.00	1,178,198,400
いすゞ自動車	189,400	1,477.00	279,743,800
トヨタ自動車	832,500	7,629.00	6,351,142,500
日野自動車	93,300	1,478.00	137,897,400
三菱自動車工業	259,600	1,101.00	285,819,600
エフテック	4,100	1,170.00	4,797,000
レシップホールディングス	2,200	847.00	1,863,400
G M B	1,600	1,033.00	1,652,800
ファルテック	1,600	1,545.00	2,472,000
武蔵精密工業	7,000	2,631.00	18,417,000
日産車体	31,900	1,428.00	45,553,200
新明和工業	28,000	1,300.00	36,400,000
極東開発工業	13,000	1,403.00	18,239,000
日信工業	14,600	1,822.00	26,601,200
トピー工業	56,000	275.00	15,400,000
ティラド	26,000	194.00	5,044,000
曙ブレーキ工業	33,100	321.00	10,625,100
タチエス	10,400	1,757.00	18,272,800
N O K	31,600	2,977.00	94,073,200
フタバ産業	21,200	529.00	11,214,800
K Y B	73,000	379.00	27,667,000
シロキ工業	16,000	367.00	5,872,000
大同メタル工業	9,200	1,196.00	11,003,200
プレス工業	34,800	559.00	19,453,200
ミクニ	6,900	487.00	3,360,300
カルソニックカンセイ	50,000	1,053.00	52,650,000
太平洋工業	14,500	1,317.00	19,096,500
ケーヒン	15,000	1,903.00	28,545,000
河西工業	8,000	1,699.00	13,592,000
アイシン精機	65,900	5,020.00	330,818,000
富士機工	7,600	511.00	3,883,600
マツダ	207,000	2,547.00	527,229,000
ダイハツ工業	78,000	1,536.00	119,808,000
今仙電機製作所	6,000	1,205.00	7,230,000
本田技研工業	588,300	4,045.00	2,379,673,500
スズキ	136,700	3,950.00	539,965,000
富士重工業	206,600	5,036.00	1,040,437,600

安永	3,300	555.00	1,831,500
ヤマハ発動機	92,300	2,918.00	269,331,400
ショーワ	17,000	1,160.00	19,720,000
T B K	8,300	473.00	3,925,900
エクセディ	9,000	2,919.00	26,271,000
豊田合成	23,800	2,961.00	70,471,800
愛三工業	11,500	1,243.00	14,294,500
盟和産業	800	1,166.00	932,800
ヨロズ	6,200	2,540.00	15,748,000
エフ・シー・シー	10,700	2,406.00	25,744,200
シマノ	26,400	18,810.00	496,584,000
テイ・エス テック	15,200	3,355.00	50,996,000
ジャムコ	2,900	3,905.00	11,324,500
テルモ	100,200	4,000.00	400,800,000
クリエートメディック	2,200	943.00	2,074,600
日機装	24,500	963.00	23,593,500
島津製作所	84,000	1,871.00	157,164,000
J M S	12,000	299.00	3,588,000
モリテックス	1,400	221.00	309,400
長野計器	4,200	855.00	3,591,000
ブイ・テクノロジー	1,600	4,280.00	6,848,000
東京計器	21,000	250.00	5,250,000
愛知時計電機	9,000	341.00	3,069,000
オーバル	6,500	269.00	1,748,500
東京精密	12,600	2,776.00	34,977,600
マニー	6,000	2,306.00	13,836,000
ニコン	122,100	1,675.00	204,517,500
トプコン	22,000	1,923.00	42,306,000
オリンパス	97,400	4,865.00	473,851,000
理研計器	5,300	1,549.00	8,209,700
タムロン	5,300	2,322.00	12,306,600
H O Y A	152,100	5,054.00	768,713,400
ノーリツ鋼機	5,900	614.00	3,622,600
エー・アンド・デイ	6,000	477.00	2,862,000
シチズンホールディングス	80,500	958.00	77,119,000
リズム時計工業	29,000	171.00	4,959,000
大研医器	5,200	1,189.00	6,182,800
メニコン	3,300	2,683.00	8,853,900
松風	3,200	1,494.00	4,780,800
セイコーホールディングス	42,000	780.00	32,760,000
ニプロ	48,700	1,412.00	68,764,400
パラマウントベッドホールディングス	6,900	4,130.00	28,497,000

トランザクション	1,000	503.00	503,000	
S H O - B I	2,200	400.00	880,000	
ニホンフラッシュ	1,900	1,264.00	2,401,600	
前田工織	7,200	958.00	6,897,600	
永大産業	9,000	423.00	3,807,000	
アートネイチャー	5,200	1,175.00	6,110,000	
ダンロップスポーツ	4,100	1,208.00	4,952,800	
バンダイナムコホールディングス	67,600	2,852.00	192,795,200	
アイフィスジャパン	1,100	495.00	544,500	
共立印刷	10,900	312.00	3,400,800	
フランスベッドホールディングス	9,100	1,009.00	9,181,900	
パイロットコーポレーション	11,400	5,100.00	58,140,000	
萩原工業	1,400	2,100.00	2,940,000	
トッパン・フォームズ	11,700	1,582.00	18,509,400	
フジシールインターナショナル	7,900	4,160.00	32,864,000	
タカラトミー	21,500	622.00	13,373,000	
廣済堂	6,100	380.00	2,318,000	
A s - me エステール	1,700	746.00	1,268,200	
アーク	27,500	120.00	3,300,000	
タカノ	2,900	715.00	2,073,500	
プロネクサス	6,100	913.00	5,569,300	
ホクシン	5,200	128.00	665,600	
ウッドワン	12,000	243.00	2,916,000	
大建工業	26,000	365.00	9,490,000	
凸版印刷	185,000	1,075.00	198,875,000	
大日本印刷	193,000	1,266.00	244,338,000	
図書印刷	12,000	542.00	6,504,000	
共同印刷	22,000	347.00	7,634,000	
日本写真印刷	11,000	2,857.00	31,427,000	
光村印刷	6,000	249.00	1,494,000	
宝印刷	3,400	1,379.00	4,688,600	
アシックス	60,900	2,818.00	171,616,200	
ツツミ	3,300	2,544.00	8,395,200	
小松ウオール工業	2,200	2,137.00	4,701,400	
ヤマハ	48,000	3,115.00	149,520,000	
河合楽器製作所	2,400	2,398.00	5,755,200	
クリナップ	7,700	740.00	5,698,000	
ピジョン	37,000	3,300.00	122,100,000	
兼松日産農林	7,000	167.00	1,169,000	
キングジム	5,400	855.00	4,617,000	
リンテック	15,500	2,632.00	40,796,000	
T A S A K I	1,200	2,087.00	2,504,400	

イトーキ	13,800	903.00	12,461,400
任天堂	40,300	20,400.00	822,120,000
三菱鉛筆	4,900	5,640.00	27,636,000
タカスタンダード	27,000	940.00	25,380,000
コクヨ	34,000	1,370.00	46,580,000
ナカバヤシ	13,000	312.00	4,056,000
グロープライド	3,200	1,511.00	4,835,200
岡村製作所	22,800	1,144.00	26,083,200
美津濃	35,000	607.00	21,245,000
アデランス	11,300	895.00	10,113,500
東京電力	554,500	801.00	444,154,500
中部電力	200,000	1,765.50	353,100,000
関西電力	266,800	1,485.50	396,331,400
中国電力	90,400	1,689.00	152,685,600
北陸電力	64,000	1,793.00	114,752,000
東北電力	163,300	1,594.00	260,300,200
四国電力	58,900	1,926.00	113,441,400
九州電力	144,400	1,426.00	205,914,400
北海道電力	61,200	1,193.00	73,011,600
沖縄電力	6,900	2,981.00	20,568,900
電源開発	55,700	4,090.00	227,813,000
東京瓦斯	730,000	592.10	432,233,000
大阪瓦斯	677,000	452.10	306,071,700
東邦瓦斯	165,000	775.00	127,875,000
北海道瓦斯	16,000	280.00	4,480,000
広島ガス	11,400	471.00	5,369,400
西部瓦斯	74,000	273.00	20,202,000
静岡ガス	18,600	839.00	15,605,400
メタウォーター	4,200	2,815.00	11,823,000
SBSホールディングス	6,400	1,067.00	6,828,800
東武鉄道	349,000	589.00	205,561,000
相鉄ホールディングス	112,000	643.00	72,016,000
東京急行電鉄	380,000	980.00	372,400,000
京浜急行電鉄	179,000	988.00	176,852,000
小田急電鉄	209,000	1,157.00	241,813,000
京王電鉄	183,000	973.00	178,059,000
京成電鉄	98,000	1,488.00	145,824,000
富士急行	18,000	1,144.00	20,592,000
新京成電鉄	8,000	430.00	3,440,000
東日本旅客鉄道	119,500	11,795.00	1,409,502,500
西日本旅客鉄道	62,900	8,184.00	514,773,600
東海旅客鉄道	58,500	22,210.00	1,299,285,000



西武ホールディングス	52,100	2,485.00	129,468,500
鴻池運輸	9,200	1,518.00	13,965,600
西日本鉄道	85,000	623.00	52,955,000
ハマキョウレックス	5,000	2,353.00	11,765,000
サカイ引越センター	1,300	6,090.00	7,917,000
近鉄グループホールディングス	658,000	472.00	310,576,000
阪急阪神ホールディングス	439,000	768.00	337,152,000
南海電気鉄道	147,000	604.00	88,788,000
京阪電気鉄道	146,000	824.00	120,304,000
神戸電鉄	16,000	358.00	5,728,000
名古屋鉄道	238,000	481.00	114,478,000
山陽電気鉄道	24,000	472.00	11,328,000
日本通運	253,000	566.00	143,198,000
ヤマトホールディングス	120,800	2,383.50	287,926,800
山九	86,000	652.00	56,072,000
丸運	3,500	259.00	906,500
丸全昭和運輸	22,000	440.00	9,680,000
センコー	29,000	828.00	24,012,000
トナミホールディングス	13,000	354.00	4,602,000
ニッコンホールディングス	21,400	2,236.00	47,850,400
日本石油輸送	7,000	236.00	1,652,000
福山通運	40,000	634.00	25,360,000
セイノーホールディングス	46,400	1,362.00	63,196,800
神奈川中央交通	8,000	683.00	5,464,000
日立物流	13,600	2,125.00	28,900,000
丸和運輸機関	1,500	2,136.00	3,204,000
C & F ロジホールディングス	6,300	927.00	5,840,100
日本郵船	587,000	329.00	193,123,000
商船三井	319,000	330.00	105,270,000
川崎汽船	286,000	249.00	71,214,000
N S ユナイテッド海運	32,000	235.00	7,520,000
飯野海運	34,500	540.00	18,630,000
共栄タンカー	11,000	192.00	2,112,000
乾汽船	5,900	990.00	5,841,000
日本航空	125,200	4,644.00	581,428,800
A N A ホールディングス	1,213,000	376.30	456,451,900
パスコ	6,000	323.00	1,938,000
トランコム	1,900	6,150.00	11,685,000
日新	27,000	380.00	10,260,000
三菱倉庫	46,000	1,692.00	77,832,000
三井倉庫ホールディングス	38,000	370.00	14,060,000
住友倉庫	48,000	657.00	31,536,000

澁澤倉庫	17,000	316.00	5,372,000
東陽倉庫	11,000	254.00	2,794,000
日本トランスシティ	15,000	467.00	7,005,000
ケイヒン	12,000	186.00	2,232,000
中央倉庫	3,800	981.00	3,727,800
安田倉庫	5,100	936.00	4,773,600
東洋埠頭	19,000	193.00	3,667,000
宇徳	5,300	421.00	2,231,300
上組	78,000	1,061.00	82,758,000
サンリツ	1,600	551.00	881,600
キムラユニティー	1,700	1,243.00	2,113,100
キューソー流通システム	1,800	2,557.00	4,602,600
郵船ロジスティクス	6,000	1,458.00	8,748,000
近鉄エクスプレス	11,700	2,387.00	27,927,900
東海運	3,500	287.00	1,004,500
エーアイティー	3,000	1,105.00	3,315,000
内外トランスライン	1,600	1,160.00	1,856,000
NEC ネットエスアイ	8,100	2,108.00	17,074,800
システナ	6,300	1,161.00	7,314,300
デジタルアーツ	3,200	2,017.00	6,454,400
新日鉄住金ソリューションズ	5,400	5,620.00	30,348,000
キューブシステム	2,800	576.00	1,612,800
コア	2,700	834.00	2,251,800
ソフトクリエイトホールディングス	2,300	945.00	2,173,500
ITホールディングス	21,400	2,955.00	63,237,000
ネオス	1,900	555.00	1,054,500
電算システム	2,200	1,917.00	4,217,400
グリー	39,200	571.00	22,383,200
コーエーテクモホールディングス	15,300	1,826.00	27,937,800
三菱総合研究所	2,500	3,055.00	7,637,500
ボルテージ	1,200	1,446.00	1,735,200
電算	700	2,290.00	1,603,000
AGS	1,100	987.00	1,085,700
ファインデックス	4,200	750.00	3,150,000
ヒト・コミュニケーションズ	700	2,462.00	1,723,400
ブレインパッド	1,000	507.00	507,000
K L a b	10,000	944.00	9,440,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	4,300	1,049.00	4,510,700
イーブックイニシアティブジャパン	1,400	780.00	1,092,000
ネクソン	61,600	1,671.00	102,933,600
アイスタイル	5,500	1,325.00	7,287,500
エムアップ	1,700	655.00	1,113,500

エイチーム	2,400	1,826.00	4,382,400
テクノスジャパン	700	2,367.00	1,656,900
e n i s h	1,800	756.00	1,360,800
コロプラ	17,800	2,060.00	36,668,000
モバイルクリエイト	3,800	461.00	1,751,800
ブロードリーフ	6,700	1,187.00	7,952,900
ハーツユナイテッドグループ	1,900	1,923.00	3,653,700
ブイキューブ	1,600	2,246.00	3,593,600
VOYAGE GROUP	1,500	1,618.00	2,427,000
ベリサーブ	700	1,495.00	1,046,500
ティーガイア	6,400	1,897.00	12,140,800
日本アジアグループ	5,500	478.00	2,629,000
豆蔵ホールディングス	5,100	634.00	3,233,400
テクマトリックス	2,800	1,258.00	3,522,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	112,800	392.00	44,217,600
GMOペイメントゲートウェイ	5,600	4,550.00	25,480,000
ザッパラス	3,600	485.00	1,746,000
インターネットイニシアティブ	10,400	2,207.00	22,952,800
GMOクラウド	1,400	757.00	1,059,800
SRAホールディングス	3,700	2,501.00	9,253,700
朝日ネット	5,900	530.00	3,127,000
コムチュア	1,100	2,039.00	2,242,900
g u m i	6,600	1,244.00	8,210,400
パイプドHD	800	1,451.00	1,160,800
フェイス	1,700	1,425.00	2,422,500
ハイマックス	900	1,201.00	1,080,900
野村総合研究所	45,200	4,760.00	215,152,000
サイバネットシステム	5,300	413.00	2,188,900
CEホールディングス	1,000	1,098.00	1,098,000
インテージホールディングス	3,400	1,800.00	6,120,000
東邦システムサイエンス	1,900	708.00	1,345,200
ソースネクスト	3,200	541.00	1,731,200
ティー・ワイ・オー	8,900	202.00	1,797,800
クレスコ	1,500	1,996.00	2,994,000
フジ・メディア・ホールディングス	67,200	1,428.00	95,961,600
オービック	22,200	5,970.00	132,534,000
ジャストシステム	11,700	958.00	11,208,600
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,400	1,337.00	1,871,800
ヤフー	462,400	483.00	223,339,200
トレンドマイクロ	31,300	4,615.00	144,449,500
インフォメーション・ディベロプメント	1,200	911.00	1,093,200
日本オラクル	10,300	5,450.00	56,135,000

アルファシステムズ	2,100	1,871.00	3,929,100
フューチャーアーキテクト	7,800	696.00	5,428,800
CAC Holdings	4,800	988.00	4,742,400
ソフトバンク・テクノロジー	1,700	1,251.00	2,126,700
トーセ	1,700	820.00	1,394,000
オービックビジネスコンサルタント	3,300	7,250.00	23,925,000
伊藤忠テクノソリューションズ	14,600	2,527.00	36,894,200
アイティフォー	8,400	540.00	4,536,000
東計電算	1,100	2,278.00	2,505,800
エクスネット	600	1,525.00	915,000
大塚商会	17,400	5,670.00	98,658,000
サイボウズ	8,600	312.00	2,683,200
ソフトブレーン	9,500	174.00	1,653,000
電通国際情報サービス	4,000	1,819.00	7,276,000
EMシステムズ	1,100	2,125.00	2,337,500
ウェザーニューズ	1,900	4,070.00	7,733,000
C I J	5,900	495.00	2,920,500
東洋ビジネスエンジニアリング	600	1,359.00	815,400
日本エンタープライズ	5,800	258.00	1,496,400
WOWOW	3,100	3,290.00	10,199,000
フュージョンパートナー	3,700	551.00	2,038,700
日本コロムビア	2,200	517.00	1,137,400
イマジカ・ロボット ホールディングス	5,400	502.00	2,710,800
ネットワンシステムズ	27,900	720.00	20,088,000
アルゴグラフィックス	2,900	1,814.00	5,260,600
マーベラス	10,900	1,020.00	11,118,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	11,900	1,504.00	17,897,600
日本ユニシス	17,800	1,378.00	24,528,400
兼松エレクトロニクス	4,100	1,929.00	7,908,900
東京放送ホールディングス	38,700	1,771.00	68,537,700
日本テレビホールディングス	58,900	2,192.00	129,108,800
朝日放送	6,400	829.00	5,305,600
テレビ朝日ホールディングス	17,600	2,060.00	36,256,000
スカパーJ S A Tホールディングス	49,000	607.00	29,743,000
テレビ東京ホールディングス	5,800	2,244.00	13,015,200
日本BS放送	1,100	1,008.00	1,108,800
コネクシオ	5,700	1,236.00	7,045,200
日本通信	34,300	275.00	9,432,500
クロップス	1,200	515.00	618,000
日本電信電話	498,700	4,800.00	2,393,760,000
KDDI	655,400	3,032.00	1,987,172,800
光通信	7,800	9,310.00	72,618,000

NTTドコモ	497,600	2,480.00	1,234,048,000
エムティーアイ	8,300	778.00	6,457,400
GMOインターネット	23,900	1,701.00	40,653,900
カドカワ	20,200	1,547.00	31,249,400
学研ホールディングス	22,000	235.00	5,170,000
ゼンリン	8,500	1,747.00	14,849,500
昭文社	3,500	721.00	2,523,500
インプレスホールディングス	5,300	162.00	858,600
アイネット	3,600	1,172.00	4,219,200
松竹	42,000	1,102.00	46,284,000
東宝	46,000	3,170.00	145,820,000
東映	24,000	1,044.00	25,056,000
AOI Pro.	3,300	944.00	3,115,200
エヌ・ティ・ティ・データ	39,900	5,870.00	234,213,000
ピー・シー・エー	800	1,499.00	1,199,200
ビジネスブレイン太田昭和	1,000	1,040.00	1,040,000
DTS	7,200	2,883.00	20,757,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	27,300	3,065.00	83,674,500
シーイーシー	4,200	1,037.00	4,355,400
カプコン	16,500	2,600.00	42,900,000
アイ・エス・ビー	800	782.00	625,600
ジャステック	4,100	1,153.00	4,727,300
SCSK	15,300	4,595.00	70,303,500
日本システムウエア	2,400	971.00	2,330,400
アイネス	9,100	1,025.00	9,327,500
TKC	6,000	2,860.00	17,160,000
富士ソフト	9,600	2,285.00	21,936,000
NSD	13,700	1,700.00	23,290,000
コナミホールディングス	29,100	2,903.00	84,477,300
福井コンピュータホールディングス	1,400	923.00	1,292,200
JBCホールディングス	5,400	781.00	4,217,400
ミロク情報サービス	4,800	856.00	4,108,800
ソフトバンクグループ	365,600	6,863.00	2,509,112,800
ハウスイ	5,000	129.00	645,000
高千穂交易	2,500	1,029.00	2,572,500
伊藤忠食品	1,600	4,135.00	6,616,000
エレマテック	3,000	2,898.00	8,694,000
JALUX	2,100	2,572.00	5,401,200
あらた	2,900	2,671.00	7,745,900
トーメンデバイス	1,000	2,014.00	2,014,000
東京エレクトロン デバイス	2,300	1,609.00	3,700,700
フィールズ	4,200	2,000.00	8,400,000

双日	406,400	278.00	112,979,200
アルフレッサ ホールディングス	81,100	2,421.00	196,343,100
横浜冷凍	16,000	983.00	15,728,000
神栄	9,000	139.00	1,251,000
山下医科器械	500	1,767.00	883,500
ラサ商事	3,000	601.00	1,803,000
アルコニックス	3,700	1,681.00	6,219,700
神戸物産	4,200	5,040.00	21,168,000
あい ホールディングス	10,300	3,055.00	31,466,500
ディーブイエックス	1,700	1,152.00	1,958,400
ダイワボウホールディングス	59,000	254.00	14,986,000
マクニカ・富士エレホールディングス	11,600	1,495.00	17,342,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11,200	936.00	10,483,200
八洲電機	5,000	584.00	2,920,000
U K C ホールディングス	4,100	2,647.00	10,852,700
O C H I ホールディングス	1,900	1,040.00	1,976,000
T O K A I ホールディングス	31,500	539.00	16,978,500
三洋貿易	3,500	1,544.00	5,404,000
ウイン・パートナーズ	2,300	1,768.00	4,066,400
ミタチ産業	1,500	745.00	1,117,500
シップヘルスケアホールディングス	13,100	2,966.00	38,854,600
明治電機工業	2,000	1,198.00	2,396,000
デリカフーズ	1,400	1,013.00	1,418,200
スターティア	1,300	644.00	837,200
富士興産	2,500	495.00	1,237,500
協栄産業	9,000	175.00	1,575,000
小野建	5,600	1,091.00	6,109,600
佐島電機	5,100	865.00	4,411,500
エコートレーディング	1,500	641.00	961,500
伯東	4,900	1,383.00	6,776,700
コンドーテック	5,100	771.00	3,932,100
中山福	4,000	869.00	3,476,000
ナガイレーベン	9,300	2,116.00	19,678,800
三菱食品	7,100	3,055.00	21,690,500
松田産業	4,700	1,427.00	6,706,900
メディバルホールディングス	64,500	2,224.00	143,448,000
アドヴァン	6,600	1,098.00	7,246,800
S P K	1,500	2,340.00	3,510,000
萩原電気	1,700	2,007.00	3,411,900
アズワン	5,000	4,370.00	21,850,000
スズデン	2,100	994.00	2,087,400
尾家産業	2,100	901.00	1,892,100

シモジマ	4,400	1,097.00	4,826,800
ドウシシャ	7,600	2,285.00	17,366,000
小津産業	1,300	2,157.00	2,804,100
高速	3,800	952.00	3,617,600
たけびし	2,300	1,064.00	2,447,200
黒田電気	12,000	2,539.00	30,468,000
丸文	5,700	916.00	5,221,200
ハピネット	5,900	1,310.00	7,729,000
橋本総業	1,300	1,455.00	1,891,500
エクセル	3,100	1,684.00	5,220,400
マルカキカイ	2,100	1,917.00	4,025,700
ガリバーインターナショナル	17,400	1,251.00	21,767,400
日本エム・ディ・エム	5,400	690.00	3,726,000
進和	3,800	1,711.00	6,501,800
エスケイジャパン	1,600	365.00	584,000
ダイトエレクトロン	3,000	863.00	2,589,000
シークス	4,100	3,675.00	15,067,500
田中商事	2,000	710.00	1,420,000
オーハシテクニカ	3,600	1,455.00	5,238,000
白銅	1,900	1,409.00	2,677,100
伊藤忠商事	506,300	1,558.00	788,815,400
丸紅	635,000	700.60	444,881,000
高島	12,000	259.00	3,108,000
長瀬産業	38,800	1,539.00	59,713,200
蝶理	4,100	1,699.00	6,965,900
豊田通商	71,900	2,900.00	208,510,000
三共生興	9,800	481.00	4,713,800
兼松	137,000	202.00	27,674,000
ツカモトコーポレーション	12,000	135.00	1,620,000
三井物産	583,400	1,557.00	908,353,800
日本紙パルプ商事	34,000	340.00	11,560,000
日立ハイテクノロジーズ	22,400	3,245.00	72,688,000
カメイ	8,400	1,267.00	10,642,800
東都水産	11,000	194.00	2,134,000
OUGホールディングス	9,000	249.00	2,241,000
スターゼン	2,300	3,380.00	7,774,000
山善	24,800	1,099.00	27,255,200
椿本興業	7,000	334.00	2,338,000
住友商事	406,100	1,344.00	545,798,400
内田洋行	16,000	418.00	6,688,000
三菱商事	484,100	2,053.50	994,099,350
第一実業	15,000	505.00	7,575,000

キヤノンマーケティングジャパン	18,400	1,863.00	34,279,200
西華産業	21,000	293.00	6,153,000
佐藤商事	5,800	749.00	4,344,200
菱洋エレクトロ	7,500	1,542.00	11,565,000
東京産業	6,400	529.00	3,385,600
ユアサ商事	6,100	2,893.00	17,647,300
神鋼商事	14,000	256.00	3,584,000
小林産業	4,300	228.00	980,400
阪和興業	64,000	513.00	32,832,000
カナデン	6,200	974.00	6,038,800
菱電商事	10,000	826.00	8,260,000
フルサト工業	3,600	1,749.00	6,296,400
岩谷産業	77,000	675.00	51,975,000
すてきナイスグループ	28,000	165.00	4,620,000
昭光通商	23,000	88.00	2,024,000
ニチモウ	10,000	208.00	2,080,000
極東貿易	9,000	278.00	2,502,000
イワキ	10,000	226.00	2,260,000
三愛石油	17,000	952.00	16,184,000
稲畑産業	15,500	1,350.00	20,925,000
G S I クレオス	17,000	123.00	2,091,000
明和産業	6,000	439.00	2,634,000
ワキタ	13,700	987.00	13,521,900
東邦ホールディングス	20,700	3,060.00	63,342,000
サンゲツ	23,600	2,231.00	52,651,600
ミツウロコグループホールディングス	10,400	579.00	6,021,600
シナネンホールディングス	14,000	461.00	6,454,000
伊藤忠エネクス	16,600	975.00	16,185,000
サンリオ	19,900	2,947.00	58,645,300
サンワテクノス	4,100	1,061.00	4,350,100
リョーサン	10,200	3,015.00	30,753,000
新光商事	7,600	1,317.00	10,009,200
トーヨー	2,900	2,360.00	6,844,000
三信電気	8,900	1,455.00	12,949,500
東陽テクニカ	9,500	994.00	9,443,000
モスフードサービス	8,500	2,912.00	24,752,000
加賀電子	5,800	1,824.00	10,579,200
ソーダニッカ	6,700	515.00	3,450,500
立花エレテック	4,800	1,405.00	6,744,000
フォーバル	2,600	723.00	1,879,800
P A L T A C	10,300	2,219.00	22,855,700
三谷産業	6,900	392.00	2,704,800



ヤマタネ	30,000	184.00	5,520,000
丸紅建材リース	6,000	224.00	1,344,000
日鉄住金物産	42,000	422.00	17,724,000
トラスコ中山	7,400	4,260.00	31,524,000
オートバックスセブン	24,700	2,213.00	54,661,100
加藤産業	10,100	2,948.00	29,774,800
イノテック	6,000	500.00	3,000,000
イエローハット	6,100	2,723.00	16,610,300
J Kホールディングス	6,500	491.00	3,191,500
日伝	2,700	2,992.00	8,078,400
北沢産業	5,400	208.00	1,123,200
杉本商事	3,700	1,484.00	5,490,800
因幡電機産業	9,000	3,875.00	34,875,000
バイテックホールディングス	2,000	1,306.00	2,612,000
ミスミグループ本社	72,400	1,655.00	119,822,000
アルテック	5,500	186.00	1,023,000
タキヒヨー	11,000	457.00	5,027,000
蔵王産業	1,100	1,425.00	1,567,500
スズケン	29,400	4,770.00	140,238,000
ジェコス	4,500	1,090.00	4,905,000
ルネサスイーストン	4,100	470.00	1,927,000
ローソン	24,400	9,020.00	220,088,000
サンエー	4,400	5,110.00	22,484,000
ダイユーエイト	1,900	826.00	1,569,400
カワチ薬品	5,000	2,233.00	11,165,000
エービーシー・マート	8,200	6,830.00	56,006,000
ハードオフコーポレーション	3,100	1,534.00	4,755,400
アスクル	6,700	4,490.00	30,083,000
ゲオホールディングス	12,200	1,818.00	22,179,600
アダストリア	5,900	6,940.00	40,946,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	9,000	112.00	1,008,000
くらコーポレーション	3,800	3,850.00	14,630,000
キャンドゥ	3,400	1,589.00	5,402,600
パル	3,800	2,828.00	10,746,400
エディオン	27,400	935.00	25,619,000
サーラコーポレーション	5,500	624.00	3,432,000
ワッツ	2,600	885.00	2,301,000
あみやき亭	1,300	4,375.00	5,687,500
ひらまつ	9,000	670.00	6,030,000
ゲンキー	1,300	4,145.00	5,388,500
サッポロドラッグストアー	700	2,407.00	1,684,900
大黒天物産	1,500	4,340.00	6,510,000

ハニーズ	5,700	1,044.00	5,950,800
ファーマライズホールディングス	1,900	608.00	1,155,200
アルペン	5,800	2,021.00	11,721,800
クオール	6,600	1,453.00	9,589,800
ジェイアイエヌ	4,400	4,865.00	21,406,000
ビックカメラ	33,400	1,035.00	34,569,000
D C Mホールディングス	31,800	814.00	25,885,200
Monotaro	22,700	2,982.00	67,691,400
東京一番フーズ	1,100	674.00	741,400
ダイヤモンドダイニング	1,300	1,172.00	1,523,600
きちり	1,800	736.00	1,324,800
アークランドサービス	1,000	4,830.00	4,830,000
J.フロント リテイリング	81,700	1,995.00	162,991,500
ドトール・日レスホールディングス	11,300	1,802.00	20,362,600
マツモトキヨシホールディングス	13,300	5,580.00	74,214,000
ブロンコビリー	2,500	2,284.00	5,710,000
スタートトゥデイ	20,100	3,910.00	78,591,000
トレジャー・ファクトリー	1,800	1,204.00	2,167,200
物語コーポレーション	1,800	5,010.00	9,018,000
ココカラファイン	6,700	4,515.00	30,250,500
三越伊勢丹ホールディングス	128,300	1,905.00	244,411,500
ウエルシアホールディングス	5,600	6,000.00	33,600,000
クリエイティブSDホールディングス	3,200	7,400.00	23,680,000
丸善C H Iホールディングス	7,500	352.00	2,640,000
ミサワ	800	729.00	583,200
エー・ピーカンパニー	1,100	1,585.00	1,743,500
チムニー	1,600	3,165.00	5,064,000
ネクステージ	1,200	815.00	978,000
ジョイフル本田	9,400	2,275.00	21,385,000
麒麟堂ホールディングス	2,100	1,391.00	2,921,100
ホットランド	1,800	1,652.00	2,973,600
すかいらーく	19,800	1,603.00	31,739,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,400	1,058.00	22,641,200
ブックオフコーポレーション	3,800	925.00	3,515,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,400	943.00	1,320,200
あさひ	4,800	1,222.00	5,865,600
日本調剤	1,600	4,905.00	7,848,000
コスモス薬品	3,200	15,620.00	49,984,000
トーエル	3,400	636.00	2,162,400
一六堂	1,800	404.00	727,200
セブン&アイ・ホールディングス	269,900	5,733.00	1,547,336,700
薬王堂	900	3,060.00	2,754,000

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5,800	2,987.00	17,324,600
ツルハホールディングス	13,800	9,960.00	137,448,000
サンマルクホールディングス	5,100	3,720.00	18,972,000
フェリシモ	1,800	1,089.00	1,960,200
トリドール	7,900	1,876.00	14,820,400
クスリのアオキ	5,100	5,810.00	29,631,000
メディカルシステムネットワーク	7,700	743.00	5,721,100
総合メディカル	3,100	4,380.00	13,578,000
はるやま商事	2,800	741.00	2,074,800
カッパ・クリエイト	9,000	1,209.00	10,881,000
ライトオン	4,800	1,363.00	6,542,400
良品計画	7,400	25,660.00	189,884,000
三城ホールディングス	8,000	462.00	3,696,000
アルビス	1,700	2,277.00	3,870,900
コナカ	7,600	653.00	4,962,800
ハウス オブ ローゼ	900	1,444.00	1,299,600
G - 7ホールディングス	1,900	1,692.00	3,214,800
イオン北海道	4,700	551.00	2,589,700
コジマ	9,700	288.00	2,793,600
ヒマラヤ	2,100	1,113.00	2,337,300
コーナン商事	9,300	1,725.00	16,042,500
エコス	2,400	1,801.00	4,322,400
マルシェ	1,700	858.00	1,458,600
ドンキホーテホールディングス	41,700	4,630.00	193,071,000
西松屋チェーン	12,700	1,138.00	14,452,600
ゼンショーホールディングス	33,200	1,397.00	46,380,400
幸楽苑ホールディングス	4,100	1,574.00	6,453,400
ハークスレイ	1,800	1,390.00	2,502,000
サイゼリヤ	10,600	2,860.00	30,316,000
V Tホールディングス	21,800	728.00	15,870,400
魚力	2,000	1,711.00	3,422,000
ポブラ	1,600	533.00	852,800
ユナイテッドアローズ	9,200	5,410.00	49,772,000
ハイデイ日高	4,900	3,050.00	14,945,000
京都きもの友禅	4,500	977.00	4,396,500
コロワイド	21,600	1,784.00	38,534,400
壱番屋	2,900	5,880.00	17,052,000
トップカルチャー	2,800	481.00	1,346,800
P L A N T	1,600	1,308.00	2,092,800
スギホールディングス	11,600	5,920.00	68,672,000
スクロール	9,800	432.00	4,233,600
ヨンドシーホールディングス	4,900	2,679.00	13,127,100

ファミリーマート	19,800	5,180.00	102,564,000
木曽路	7,900	2,079.00	16,424,100
サトレストランシステムズ	7,600	897.00	6,817,200
千趣会	12,700	827.00	10,502,900
タカキュー	5,500	196.00	1,078,000
ケーヨー	11,000	502.00	5,522,000
上新電機	15,000	1,020.00	15,300,000
日本瓦斯	7,400	3,315.00	24,531,000
ベスト電器	20,800	136.00	2,828,800
ロイヤルホールディングス	10,800	2,244.00	24,235,200
東天紅	5,000	168.00	840,000
いなげや	7,200	1,303.00	9,381,600
島忠	16,700	2,814.00	46,993,800
チヨダ	7,600	3,790.00	28,804,000
ライフコーポレーション	4,200	3,080.00	12,936,000
リンガーハット	5,800	2,493.00	14,459,400
MrMax	6,200	357.00	2,213,400
テナアライド	5,900	394.00	2,324,600
AOKIホールディングス	14,700	1,533.00	22,535,100
オークワ	10,000	1,065.00	10,650,000
コメリ	10,000	2,685.00	26,850,000
青山商事	12,400	4,490.00	55,676,000
しまむら	7,500	13,330.00	99,975,000
はせがわ	2,500	481.00	1,202,500
高島屋	94,000	1,115.00	104,810,000
松屋	13,200	1,550.00	20,460,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,100	2,428.00	80,366,800
近鉄百貨店	25,000	337.00	8,425,000
ニッセンホールディングス	9,500	189.00	1,795,500
パルコ	6,200	1,085.00	6,727,000
丸井グループ	79,300	1,747.00	138,537,100
アクシアル リテイリング	5,000	4,600.00	23,000,000
イオン	265,600	1,818.00	482,860,800
ユニグループ・ホールディングス	62,400	704.00	43,929,600
イズミ	12,800	4,600.00	58,880,000
東武ストア	8,000	302.00	2,416,000
平和堂	13,100	2,768.00	36,260,800
フジ	7,300	2,586.00	18,877,800
ヤオコー	7,300	5,490.00	40,077,000
ゼビオホールディングス	8,800	2,189.00	19,263,200
ケーブホールディングス	13,600	4,445.00	60,452,000
Olympicグループ	4,200	617.00	2,591,400

日産東京販売ホールディングス	11,100	331.00	3,674,100
アインホールディングス	7,800	5,760.00	44,928,000
元気寿司	1,800	2,353.00	4,235,400
ヤマダ電機	196,300	572.00	112,283,600
アークランドサカモト	5,500	2,610.00	14,355,000
ニトリホールディングス	27,900	9,670.00	269,793,000
グルメ杵屋	5,000	963.00	4,815,000
愛眼	5,100	251.00	1,280,100
ケーユーホールディングス	3,400	822.00	2,794,800
吉野家ホールディングス	23,800	1,486.00	35,366,800
松屋フーズ	3,100	2,498.00	7,743,800
サガミチェーン	8,600	1,300.00	11,180,000
関西スーパーマーケット	5,400	835.00	4,509,000
王将フードサービス	4,700	4,170.00	19,599,000
プレナス	7,200	2,017.00	14,522,400
ミニストップ	4,800	2,312.00	11,097,600
アークス	12,100	2,523.00	30,528,300
パローホールディングス	13,900	2,616.00	36,362,400
藤久	500	1,765.00	882,500
ベルク	3,200	4,530.00	14,496,000
大庄	3,100	1,480.00	4,588,000
ファーストリテイリング	12,900	47,600.00	614,040,000
サンドラッグ	13,600	7,310.00	99,416,000
サクスパー ホールディングス	6,100	1,756.00	10,711,600
ヤマザワ	1,400	1,706.00	2,388,400
やまや	1,300	2,526.00	3,283,800
ベルーナ	16,100	670.00	10,787,000
島根銀行	1,400	1,437.00	2,011,800
じもとホールディングス	46,300	211.00	9,769,300
足利ホールディングス	47,300	509.00	24,075,700
東京ＴＹフィナンシャルグループ	8,900	4,025.00	35,822,500
九州フィナンシャルグループ	98,800	923.00	91,192,400
新生銀行	558,000	244.00	136,152,000
あおぞら銀行	408,000	444.00	181,152,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,176,700	829.00	4,291,484,300
りそなホールディングス	754,800	659.30	497,639,640
三井住友トラスト・ホールディングス	1,347,000	499.60	672,961,200
三井住友フィナンシャルグループ	516,600	5,152.00	2,661,523,200
第四銀行	82,000	570.00	46,740,000
北越銀行	70,000	255.00	17,850,000
西日本シティ銀行	210,000	342.00	71,820,000
千葉銀行	249,000	872.00	217,128,000

横浜銀行	433,000	774.70	335,445,100	
常陽銀行	233,000	619.00	144,227,000	
群馬銀行	143,000	773.00	110,539,000	
武蔵野銀行	10,300	4,720.00	48,616,000	
千葉興業銀行	17,700	757.00	13,398,900	
筑波銀行	26,800	429.00	11,497,200	
七十七銀行	101,000	663.00	66,963,000	
青森銀行	47,000	399.00	18,753,000	
秋田銀行	43,000	399.00	17,157,000	
山形銀行	36,000	485.00	17,460,000	
岩手銀行	4,500	5,530.00	24,885,000	
東邦銀行	58,000	458.00	26,564,000	
東北銀行	33,000	154.00	5,082,000	
みちのく銀行	32,000	207.00	6,624,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	279,000	644.00	179,676,000	
静岡銀行	189,000	1,218.00	230,202,000	
十六銀行	81,000	540.00	43,740,000	
スルガ銀行	68,100	2,407.00	163,916,700	
八十二銀行	117,000	807.00	94,419,000	
山梨中央銀行	40,000	581.00	23,240,000	
大垣共立銀行	86,000	483.00	41,538,000	
福井銀行	55,000	255.00	14,025,000	
北國銀行	72,000	425.00	30,600,000	
清水銀行	2,200	3,035.00	6,677,000	
滋賀銀行	61,000	665.00	40,565,000	
南都銀行	62,000	391.00	24,242,000	
百五銀行	58,000	614.00	35,612,000	
京都銀行	123,000	1,247.00	153,381,000	
紀陽銀行	25,300	1,854.00	46,906,200	
三重銀行	29,000	271.00	7,859,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	439,000	269.00	118,091,000	
広島銀行	190,000	732.00	139,080,000	
山陰合同銀行	39,100	1,121.00	43,831,100	
中国銀行	45,700	1,770.00	80,889,000	
鳥取銀行	21,000	214.00	4,494,000	
伊予銀行	69,000	1,274.00	87,906,000	
百十四銀行	71,000	456.00	32,376,000	
四国銀行	50,000	262.00	13,100,000	
阿波銀行	53,000	675.00	35,775,000	
大分銀行	37,000	520.00	19,240,000	
宮崎銀行	43,000	438.00	18,834,000	
佐賀銀行	39,000	279.00	10,881,000	

十八銀行	40,000	377.00	15,080,000
沖縄銀行	5,100	4,865.00	24,811,500
琉球銀行	13,300	1,743.00	23,181,900
セブン銀行	241,700	559.00	135,110,300
みずほフィナンシャルグループ	9,086,700	257.90	2,343,459,930
高知銀行	25,000	150.00	3,750,000
山口フィナンシャルグループ	60,000	1,493.00	89,580,000
長野銀行	21,000	204.00	4,284,000
名古屋銀行	54,000	458.00	24,732,000
北洋銀行	97,200	474.00	46,072,800
愛知銀行	2,200	6,870.00	15,114,000
第三銀行	36,000	182.00	6,552,000
中京銀行	26,000	241.00	6,266,000
東日本銀行	31,000	419.00	12,989,000
大光銀行	23,000	240.00	5,520,000
愛媛銀行	38,000	250.00	9,500,000
トマト銀行	25,000	174.00	4,350,000
みなと銀行	58,000	218.00	12,644,000
京葉銀行	53,000	599.00	31,747,000
関西アーバン銀行	9,000	1,373.00	12,357,000
栃木銀行	35,000	705.00	24,675,000
北日本銀行	2,000	3,340.00	6,680,000
東和銀行	91,000	110.00	10,010,000
福島銀行	79,000	96.00	7,584,000
大東銀行	39,000	196.00	7,644,000
トモニホールディングス	49,500	472.00	23,364,000
フィデアホールディングス	39,500	268.00	10,586,000
池田泉州ホールディングス	68,400	518.00	35,431,200
F P G	19,800	834.00	16,513,200
S B I ホールディングス	77,800	1,413.00	109,931,400
ジャフコ	10,900	4,805.00	52,374,500
大和証券グループ本社	604,000	870.10	525,540,400
野村ホールディングス	1,241,700	798.20	991,124,940
岡三証券グループ	55,000	735.00	40,425,000
丸三証券	19,200	1,214.00	23,308,800
東洋証券	25,000	403.00	10,075,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	74,100	766.00	56,760,600
光世証券	16,000	194.00	3,104,000
水戸証券	20,000	424.00	8,480,000
いちよし証券	14,500	1,144.00	16,588,000
松井証券	32,800	1,127.00	36,965,600
だいこう証券ビジネス	3,300	1,117.00	3,686,100

マネックスグループ	76,000	356.00	27,056,000
カブドットコム証券	57,300	405.00	23,206,500
極東証券	8,700	1,651.00	14,363,700
岩井コスモホールディングス	6,100	1,401.00	8,546,100
藍澤証券	9,100	736.00	6,697,600
マネースクウェアHD	2,200	1,620.00	3,564,000
マネーパートナーズグループ	6,100	433.00	2,641,300
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	143,300	4,042.00	579,218,600
アニコムホールディングス	4,400	2,939.00	12,931,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	192,800	3,802.00	733,025,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	61,800	2,258.00	139,544,400
第一生命保険	413,400	2,351.50	972,110,100
東京海上ホールディングス	261,400	4,945.00	1,292,623,000
T&Dホールディングス	235,100	1,782.50	419,065,750
全国保証	16,800	4,340.00	72,912,000
クレディセゾン	48,900	2,375.00	116,137,500
アクリーティブ	5,300	563.00	2,983,900
芙蓉総合リース	7,400	6,240.00	46,176,000
興銀リース	12,100	2,779.00	33,625,900
東京センチュリーリース	15,100	4,375.00	66,062,500
日本証券金融	28,400	642.00	18,232,800
アイフル	108,000	475.00	51,300,000
ポケットカード	6,400	601.00	3,846,400
リコーリース	5,100	3,760.00	19,176,000
イオンフィナンシャルサービス	42,300	2,949.00	124,742,700
アコム	129,600	622.00	80,611,200
ジャックス	36,000	494.00	17,784,000
オリエントコーポレーション	279,000	242.00	67,518,000
日立キャピタル	15,200	3,480.00	52,896,000
アプラスフィナンシャル	30,900	120.00	3,708,000
オリックス	456,900	1,839.50	840,467,550
三菱UFJリース	163,600	654.00	106,994,400
日本取引所グループ	189,500	1,951.00	369,714,500
イー・ギャランティ	2,100	2,418.00	5,077,800
アサックス	1,100	1,637.00	1,800,700
NECキャピタルソリューション	2,600	1,745.00	4,537,000
日本駐車場開発	70,700	146.00	10,322,200
ヒューリック	134,500	1,058.00	142,301,000
三栄建築設計	2,600	1,347.00	3,502,200
野村不動産ホールディングス	42,800	2,389.00	102,249,200
三重交通グループホールディングス	11,500	471.00	5,416,500
ディア・ライフ	3,300	417.00	1,376,100



日本商業開発	2,100	1,949.00	4,092,900
プレサンスコーポレーション	2,200	4,080.00	8,976,000
ユニゾホールディングス	4,000	4,850.00	19,400,000
日本管理センター	4,200	1,112.00	4,670,400
サンセイランディック	1,500	957.00	1,435,500
エストラスト	1,200	524.00	628,800
フージャースホールディングス	9,000	504.00	4,536,000
オープンハウス	9,300	2,021.00	18,795,300
東急不動産ホールディングス	156,100	810.00	126,441,000
飯田グループホールディングス	59,800	2,330.00	139,334,000
パーク24	32,500	2,488.00	80,860,000
パラカ	2,300	1,619.00	3,723,700
三井不動産	342,000	3,113.00	1,064,646,000
三菱地所	480,000	2,560.00	1,228,800,000
平和不動産	12,200	1,495.00	18,239,000
東京建物	70,500	1,480.00	104,340,000
ダイビル	16,600	1,010.00	16,766,000
京阪神ビルディング	10,700	696.00	7,447,200
住友不動産	155,000	3,779.00	585,745,000
大京	120,000	203.00	24,360,000
テーオーシー	25,000	922.00	23,050,000
東京楽天地	11,000	504.00	5,544,000
レオパレス21	76,000	667.00	50,692,000
スターツコーポレーション	7,400	1,906.00	14,104,400
フジ住宅	8,300	734.00	6,092,200
空港施設	7,900	568.00	4,487,200
明和地所	3,600	546.00	1,965,600
住友不動産販売	4,700	2,764.00	12,990,800
ゴールドクレスト	5,100	2,209.00	11,265,900
日本エスリード	2,500	1,154.00	2,885,000
日神不動産	8,700	434.00	3,775,800
タカラレーベン	28,600	607.00	17,360,200
サンヨーハウジング名古屋	3,700	1,151.00	4,258,700
イオンモール	41,600	1,959.00	81,494,400
ファースト住建	2,400	1,261.00	3,026,400
トーセイ	9,800	743.00	7,281,400
穴吹興産	6,000	247.00	1,482,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	40,100	1,194.00	47,879,400
サンフロンティア不動産	7,800	906.00	7,066,800
エフ・ジェー・ネクスト	5,700	507.00	2,889,900
ランドビジネス	4,300	365.00	1,569,500
グランディハウス	5,700	421.00	2,399,700

日本空港ビルデング	20,600	6,740.00	138,844,000
日本工営	23,000	499.00	11,477,000
ネクスト	19,500	850.00	16,575,000
ジェイエシーリクルートメント	3,200	803.00	2,569,600
日本M&Aセンター	10,600	4,780.00	50,668,000
ノバレーゼ	1,800	920.00	1,656,000
アコーディア・ゴルフ	18,900	1,092.00	20,638,800
タケエイ	6,200	993.00	6,156,600
トラスト・テック	1,200	2,371.00	2,845,200
パソナグループ	5,600	911.00	5,101,600
CDS	1,600	953.00	1,524,800
リンクアンドモチベーション	13,800	135.00	1,863,000
GCAサヴィアン	6,100	1,365.00	8,326,500
エス・エム・エス	8,500	2,074.00	17,629,000
テンプホールディングス	47,800	1,930.00	92,254,000
リニカル	2,300	1,725.00	3,967,500
クックパッド	15,200	2,246.00	34,139,200
エスクリ	3,700	931.00	3,444,700
アイ・ケイ・ケイ	3,700	551.00	2,038,700
学情	2,500	1,001.00	2,502,500
スタジオアリス	3,100	2,236.00	6,931,600
シミックホールディングス	3,100	1,706.00	5,288,600
NJS	1,400	1,450.00	2,030,000
総合警備保障	22,800	5,700.00	129,960,000
カカクコム	49,500	2,119.00	104,890,500
アイロムグループ	1,900	1,205.00	2,289,500
ルネサンス	3,800	1,319.00	5,012,200
ディップ	7,800	2,541.00	19,819,800
オプトホールディング	4,300	659.00	2,833,700
ツクイ	8,400	1,348.00	11,323,200
総合臨床ホールディングス	3,500	481.00	1,683,500
キャリアデザインセンター	2,200	1,169.00	2,571,800
エムスリー	59,100	2,396.00	141,603,600
ツカダ・グローバルホールディング	5,000	785.00	3,925,000
アウトソーシング	3,200	2,846.00	9,107,200
ウェルネット	2,400	2,600.00	6,240,000
ディー・エヌ・エー	30,600	1,946.00	59,547,600
博報堂DYホールディングス	94,600	1,305.00	123,453,000
ぐるなび	7,900	2,298.00	18,154,200
エスアールジータカミヤ	6,600	541.00	3,570,600
一休	4,700	2,293.00	10,777,100
ファンコミュニケーションズ	15,800	873.00	13,793,400

ジェイコムホールディングス	2,100	1,244.00	2,612,400
WDBホールディングス	2,500	1,240.00	3,100,000
ティア	2,900	710.00	2,059,000
バリューコマース	6,300	521.00	3,282,300
J Pホールディングス	17,800	315.00	5,607,000
E P Sホールディングス	6,200	1,245.00	7,719,000
レグス	1,000	750.00	750,000
プレステージ・インターナショナル	5,700	1,147.00	6,537,900
アミューズ	1,900	4,750.00	9,025,000
ドリームインキュベータ	2,500	2,027.00	5,067,500
クイック	3,500	999.00	3,496,500
T A C	7,200	233.00	1,677,600
ケネディクス	92,800	439.00	40,739,200
電通	76,100	6,960.00	529,656,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	692.00	2,906,400
ぴあ	2,000	2,213.00	4,426,000
イオンファンタジー	2,400	2,090.00	5,016,000
シーティーエス	1,500	825.00	1,237,500
ネクシィーズ	3,200	844.00	2,700,800
みらかホールディングス	17,400	5,270.00	91,698,000
アルプス技研	2,500	2,242.00	5,605,000
ダイオーズ	1,200	1,241.00	1,489,200
日本空調サービス	3,300	1,135.00	3,745,500
オリエンタルランド	73,800	7,491.00	552,835,800
ダスキン	19,300	2,098.00	40,491,400
明光ネットワークジャパン	7,900	1,450.00	11,455,000
ファルコホールディングス	3,000	1,468.00	4,404,000
ラウンドワン	22,100	545.00	12,044,500
リゾートトラスト	28,600	3,285.00	93,951,000
ビー・エム・エル	4,000	3,730.00	14,920,000
ワタベウェディング	2,700	490.00	1,323,000
りらいあコミュニケーションズ	11,300	1,117.00	12,622,100
早稲田アカデミー	900	840.00	756,000
ユー・エス・エス	82,700	2,063.00	170,610,100
東京個別指導学院	3,300	607.00	2,003,100
サイバーエージェント	16,700	4,570.00	76,319,000
楽天	319,300	1,564.00	499,385,200
テー・オー・ダブリュー	4,100	804.00	3,296,400
セントラルスポーツ	2,300	2,277.00	5,237,100
フルキャストホールディングス	6,700	832.00	5,574,400
リゾートソリューション	9,000	311.00	2,799,000
テクノプロ・ホールディングス	9,700	3,335.00	32,349,500

リブセンス	4,600	410.00	1,886,000
ジャパンマテリアル	2,900	1,979.00	5,739,100
ベクトル	2,100	1,844.00	3,872,400
ウチヤマホールディングス	4,100	485.00	1,988,500
サクセスホールディングス	1,200	1,304.00	1,564,800
キャリアリンク	1,300	1,678.00	2,181,400
I B J	1,500	1,296.00	1,944,000
アサンテ	2,500	1,480.00	3,700,000
N・フィールド	2,400	1,372.00	3,292,800
M&Aキャピタルパートナーズ	500	1,586.00	793,000
E R Iホールディングス	1,800	849.00	1,528,200
アビスト	700	1,641.00	1,148,700
ウィルグループ	2,000	893.00	1,786,000
日本ビューホテル	1,000	2,205.00	2,205,000
リクルートホールディングス	137,700	3,875.00	533,587,500
リロ・ホールディング	2,600	12,860.00	33,436,000
東祥	2,000	3,075.00	6,150,000
エイチ・アイ・エス	11,100	4,210.00	46,731,000
共立メンテナンス	5,100	8,600.00	43,860,000
イチネンホールディングス	7,700	1,099.00	8,462,300
建設技術研究所	4,000	1,243.00	4,972,000
スペース	3,700	1,398.00	5,172,600
燦ホールディングス	1,400	1,556.00	2,178,400
スバル興業	5,000	423.00	2,115,000
東京テアトル	26,000	134.00	3,484,000
よみうりランド	15,000	435.00	6,525,000
東京都競馬	47,000	288.00	13,536,000
カナモト	9,800	2,631.00	25,783,800
東京ドーム	56,000	569.00	31,864,000
西尾レントオール	5,700	2,929.00	16,695,300
トランス・コスモス	7,900	3,200.00	25,280,000
乃村工藝社	14,600	1,678.00	24,498,800
藤田観光	26,000	485.00	12,610,000
K N T - C Tホールディングス	33,000	257.00	8,481,000
日本管財	5,900	1,881.00	11,097,900
トーカイ	3,000	3,960.00	11,880,000
白洋舎	9,000	276.00	2,484,000
セコム	71,000	8,111.00	575,881,000
セントラル警備保障	3,000	1,606.00	4,818,000
丹青社	12,800	933.00	11,942,400
メイテック	8,500	4,220.00	35,870,000
アサツー ディ・ケイ	12,000	3,005.00	36,060,000

応用地質	7,200	1,455.00	10,476,000	
船井総研ホールディングス	7,900	1,924.00	15,199,600	
進学会	3,300	739.00	2,438,700	
オオバ	4,500	491.00	2,209,500	
ベネッセホールディングス	22,900	3,270.00	74,883,000	
イオンディライト	6,600	3,575.00	23,595,000	
ナック	4,200	907.00	3,809,400	
ニチイ学館	12,300	917.00	11,279,100	
ダイセキ	12,800	1,995.00	25,536,000	
ステップ	2,300	1,063.00	2,444,900	
合 計	107,106,900		152,998,708,780	

## (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

注記事項(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

	平成27年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	100,757,649
コール・ローン	2,704,782,923
国債証券	220,373,107,568
派生商品評価勘定	29,882,442
未収入金	5,865,410
未収利息	1,821,819,322
前払金	20,063,760
前払費用	141,876,055
差入委託証拠金	62,074,723
流動資産合計	225,260,229,852
資産合計	225,260,229,852
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,183,567
未払金	13,810,722
未払解約金	102,042,593

平成27年11月10日現在	
項目	金額（円）
流動負債合計	145,036,882
負債合計	145,036,882
純資産の部	
元本等	
元本	79,946,604,543
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	145,168,588,427
元本等合計	225,115,192,970
純資産合計	225,115,192,970
負債純資産合計	225,260,229,852

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成27年11月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	平成27年11月10日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	平成27年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,946,604,543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 2.8158円 (1万口当たり純資産額) (28,158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

	平成27年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

平成27年11月10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	平成27年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	87,009,647,233円
期中追加設定元本額	42,569,353,528円
期中一部解約元本額	49,632,396,218円



区分	平成27年11月10日現在
期末元本額	79,946,604,543円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	3,048,697,538円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	167,328,947円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,162,581,929円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	777,129,217円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,420,434,648円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,749,913円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,022,322,770円
世界経済インデックスファンド	1,628,330,875円
マイセレクション25	6,019,195円
マイセレクション50	4,480,468円
マイセレクション75	3,365,006円
DCマイセレクション25	1,139,082,433円
DCマイセレクション50	960,322,769円
DCマイセレクション75	683,223,519円
DC外国債券インデックス・オープン	1,400,911,895円
DCマイセレクションS25	444,930,486円
DCマイセレクションS50	363,269,506円
DCマイセレクションS75	178,312,539円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	48,709,668円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	36,139,098円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	14,251,917円
DC世界経済インデックスファンド	1,623,715,085円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	430,948,908円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	166,678,297円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,443,233円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,829,473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）	121,274,070円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	355,243,369円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	517,438,904円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	1,472,621,607円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	846,696,168円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,297,340,503円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	929,442,206円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,256,479,819円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,346,191,632円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,654,703,795円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	996,491,193円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,185,137,334円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	341,448,515円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	485,168,341円

区分	平成27年11月10日現在
F O F s用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,802,707,969円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,473,034,000円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	597,859,418円
外国債券ファンド・シリーズ1	281,350,847円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,959,396,168円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,608,047,316円
分散投資コア戦略ファンドA	467,256,112円
分散投資コア戦略ファンドS	1,006,541,003円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	37,628,328円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	550,127,646円
コア投資戦略ファンド（切替型）	551,137,186円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	129,919,067円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	81,785,237円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	299,819,990円
S M T インデックスバランス・オープン	146,371,578円
外国債券S M T Bセレクション（S M A専用）	21,602,038,742円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	786,697,148円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,894,349,854
合計		2,894,349,854

(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

（平成27年11月10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	2,193,325,461	-	2,173,261,701	20,063,760
	合計	2,193,325,461	-	2,173,261,701	20,063,760

## (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。

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

（平成27年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,008,906,565	-	3,029,669,200	20,762,635
	アメリカドル	1,366,591,710	-	1,392,047,000	25,455,290
	カナダドル	111,986,940	-	113,203,800	1,216,860
	ユーロ	1,271,699,470	-	1,263,668,400	8,031,070
	イギリスポンド	258,628,445	-	260,750,000	2,121,555
	合計		3,008,906,565	-	3,029,669,200

### (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 03/31/17	1,000,000.00	997,187.50	
		T 0.5% 07/31/17	2,000,000.00	1,989,414.06	
		T 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,882,421.90	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	6,971,699.21	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	995,390.63	
		T 0.625% 11/15/16	5,600,000.00	5,600,218.73	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,968,261.70	
		T 0.625% 12/15/16	10,000,000.00	9,997,656.30	
		T 0.75% 01/15/17	12,000,000.00	12,012,656.28	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,371,039.06	

T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	2,974,980.48	
T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	5,995,429.68	
T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,886,972.64	
T 0.875% 01/31/17	10,000,000.00	10,024,804.70	
T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,484,746.08	
T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,009,570.30	
T 0.875% 04/30/17	11,600,000.00	11,621,976.54	
T 0.875% 06/15/17	5,000,000.00	5,007,714.85	
T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	4,004,531.24	
T 0.875% 08/15/17	8,800,000.00	8,805,156.27	
T 0.875% 10/15/17	6,200,000.00	6,198,789.07	
T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	3,958,281.24	
T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,951,992.18	
T 1.125% 06/15/18	3,000,000.00	2,997,070.32	
T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	2,990,012.69	
T 1.25% 01/31/19	900,000.00	897,240.23	
T 1.25% 01/31/20	8,520,000.00	8,382,548.45	
T 1.25% 02/29/20	7,000,000.00	6,878,730.46	
T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,498,476.59	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,435,761.70	
T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,541,940.42	
T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,945,117.20	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,099,425.77	
T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,816,521.88	
T 1.375% 04/30/20	10,000,000.00	9,859,179.70	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,526,719.72	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,211,945.31	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,915,234.37	
T 1.375% 09/30/20	1,500,000.00	1,472,812.50	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,005,390.64	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,009,179.68	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,358,496.10	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,007,890.62	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,415,554.70	
T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,013,125.04	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,845,199.22	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,540,015.62	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,981,152.35	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,021,855.48	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,032,128.90	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,971,679.70	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,366,845.72	

T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,529,296.87
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,921,814.47
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,455,615.22
T 1.75% 03/31/22	7,000,000.00	6,869,023.42
T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,637,246.12
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,724,296.89
T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	6,786,855.45
T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	1,953,789.06
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,991,796.88
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,233,718.77
T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,045,193.38
T 1.875% 09/30/17	850,000.00	866,037.11
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,547,851.57
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,360,027.36
T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,795,953.13
T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,405,523.43
T 1% 05/15/18	5,550,000.00	5,532,547.85
T 1% 05/31/18	5,000,000.00	4,981,542.95
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,853,398.46
T 1% 09/15/18	5,200,000.00	5,165,875.00
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,917,265.64
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,152,220.71
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,040,488.27
T 2.125% 05/15/25	9,450,000.00	9,270,966.82
T 2.125% 06/30/21	1,000,000.00	1,010,644.53
T 2.125% 06/30/22	3,500,000.00	3,507,929.70
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,157,783.22
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,604,355.48
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,526,718.75
T 2.25% 03/31/21	6,600,000.00	6,724,652.35
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,565,009.77
T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,453,927.73
T 2.25% 11/15/24	8,150,000.00	8,100,335.93
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,126,406.24
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,546,982.39
T 2.5% 02/15/45	10,580,000.00	9,298,828.12
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,544,703.10
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,649,975.60
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,188,281.25
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,715,058.58
T 2.625% 11/15/20	2,000,000.00	2,076,406.26
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,807,808.58
T 2.75% 02/15/24	9,100,000.00	9,449,070.35

T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,947,695.32	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,245,000.00	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,174,248.01	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,921,832.02	
T 2.75% 11/30/16	6,250,000.00	6,389,648.43	
T 2.75% 12/31/17	9,100,000.00	9,444,449.19	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,066,435.54	
T 2.875% 05/15/43	9,300,000.00	8,885,314.48	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,497,265.62	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,576,742.18	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,162,601.55	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,028,046.88	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,817,367.17	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,258,703.11	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,981,718.75	
T 2% 08/15/25	1,300,000.00	1,260,085.94	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,815,140.60	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,052,343.75	
T 2% 10/31/21	6,200,000.00	6,202,785.16	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,400,843.74	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,549,843.75	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,604,453.12	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,005,195.31	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,727,373.05	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,287,402.35	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,634,769.51	
T 3.125% 08/15/44	6,500,000.00	6,515,869.16	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,658,564.44	
T 3.125% 11/15/41	4,800,000.00	4,863,468.76	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,603,222.66	
T 3.375% 05/15/44	7,500,000.00	7,893,896.47	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,015,169.92	
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,173,828.12	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,568,940.44	
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	5,985,332.04	
T 3.625% 02/15/44	6,500,000.00	7,175,517.57	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,907,931.64	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,210,156.26	
T 3.75% 08/15/41	3,200,000.00	3,608,375.00	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,371,484.40	
T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,599,539.07	
T 3.875% 08/15/40	2,700,000.00	3,093,398.45	

T 3% 02/28/17	9,500,000.00	9,785,742.23	
T 3% 05/15/42	3,950,000.00	3,894,916.02	
T 3% 11/15/44	8,200,000.00	8,013,578.16	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,557,619.15	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,092,322.26	
T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,719,435.54	
T 4.25% 11/15/40	1,000,000.00	1,212,714.84	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,240,175.78	
T 4.375% 05/15/40	3,000,000.00	3,706,054.67	
T 4.375% 05/15/41	2,800,000.00	3,470,960.94	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,336,082.03	
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,320,592.19	
T 4.5% 05/15/17	4,800,000.00	5,070,093.74	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,261,796.88	
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	314,453.12	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,247,167.95	
T 4.625% 02/15/40	1,650,000.00	2,111,967.77	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,389,044.91	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	673,632.81	
T 5.25% 02/15/29	400,000.00	519,835.93	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,685,251.95	
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,148,187.50	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,585,546.87	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,264,087.89	
T 6.125% 11/15/27	350,000.00	482,425.78	
T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,580,927.73	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,132,882.81	
T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,208,886.73	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,282,382.82	
T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,611,095.71	
アメリカドル 小計	759,870,000.00	773,943,226.12 (95,349,805,457)	
カナダドル			
CAN 0.75% 09/01/20	1,400,000.00	1,381,835.00	
CAN 1.25% 02/01/18	1,350,000.00	1,366,976.25	
CAN 1.25% 03/01/18	1,990,000.00	2,015,919.75	
CAN 1.25% 08/01/17	2,250,000.00	2,272,410.00	
CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	507,442.50	
CAN 1.5% 02/01/17	3,100,000.00	3,133,061.50	
CAN 1.5% 03/01/17	2,900,000.00	2,932,683.00	
CAN 1.5% 03/01/20	1,450,000.00	1,486,351.50	
CAN 1.5% 06/01/23	1,650,000.00	1,648,482.00	
CAN 1.5% 06/01/26	480,000.00	463,332.00	
CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,674,651.00	

	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,444,324.00
	CAN 1.75% 09/01/19	850,000.00	878,394.25
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,621,540.25
	CAN 2.5% 06/01/24	1,700,000.00	1,818,005.50
	CAN 2.75% 06/01/22	1,550,000.00	1,687,353.25
	CAN 2.75% 12/01/48	950,000.00	1,014,856.50
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	462,210.00
	CAN 3.25% 06/01/21	1,780,000.00	1,980,374.60
	CAN 3.5% 06/01/20	1,350,000.00	1,502,995.50
	CAN 3.5% 12/01/45	1,740,000.00	2,138,451.30
	CAN 3.75% 06/01/19	2,300,000.00	2,537,647.50
	CAN 4.0% 06/01/41	1,970,000.00	2,552,115.30
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,907,158.75
	CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,472,261.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,550,000.00	2,212,446.75
	CAN 5.75% 06/01/33	1,480,000.00	2,218,127.80
	CAN 5% 06/01/37	1,690,000.00	2,423,738.85
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	585,295.20
	カナダドル 小計	44,510,000.00	49,340,440.80 (4,578,792,906)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	12,000,000.00	16,393,500.00
	MBONO 10% 12/05/24	15,500,000.00	19,725,687.50
	MBONO 4.75% 06/14/18	21,150,000.00	21,230,898.75
	MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,138,772.00
	MBONO 5% 12/11/19	12,300,000.00	12,215,745.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	12,215,773.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	24,000,000.00	25,052,400.00
	MBONO 7.25% 12/15/16	27,300,000.00	28,343,406.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	16,065,042.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,550,000.00	25,064,099.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	9,300,000.00	10,264,363.50
	MBONO 7.75% 12/14/17	9,700,000.00	10,404,123.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	18,356,442.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	19,680,375.00
	MBONO 8.5% 12/13/18	5,750,000.00	6,351,047.50
	MBONO 8% 06/11/20	14,500,000.00	16,049,687.50
MBONO 8% 12/07/23	26,450,000.00	29,823,697.50	
	メキシコペソ 小計	280,900,000.00	309,375,059.75 (2,270,812,938)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,520,000.00	1,500,498.40
	BGB 1.25% 06/22/18	780,000.00	810,876.30
	BGB 1.9% 06/22/38	420,000.00	418,091.10



BGB 1% 06/22/31	580,000.00	532,875.00
BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,690,395.00
BGB 2.6% 06/22/24	2,290,000.00	2,643,404.25
BGB 3.5% 06/28/17	1,520,000.00	1,614,118.40
BGB 3.75% 06/22/45	1,010,000.00	1,393,426.30
BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,951,487.50
BGB 3% 06/22/34	920,000.00	1,107,574.20
BGB 3% 09/28/19	1,230,000.00	1,378,270.35
BGB 4.0% 03/28/17	450,000.00	476,725.50
BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,941,009.00
BGB 4.25% 03/28/41	1,890,000.00	2,772,951.30
BGB 4.25% 09/28/21	2,300,000.00	2,843,490.00
BGB 4.25% 09/28/22	2,400,000.00	3,027,864.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,550,000.00	2,084,277.25
BGB 4% 03/28/18	1,660,000.00	1,829,842.90
BGB 4% 03/28/22	1,110,000.00	1,369,340.40
BGB 4% 03/28/32	1,100,000.00	1,481,452.50
BGB 5.5% 03/28/28	1,850,000.00	2,746,796.75
BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,107,964.50
BGB 5% 03/28/35	2,020,000.00	3,103,497.70
BTNS 1.75% 02/25/17	2,500,000.00	2,565,400.00
BTNS 1% 07/25/17	3,600,000.00	3,679,128.00
BTPS 0.25% 05/15/18	2,500,000.00	2,505,012.50
BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,002,140.00
BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,635,880.00
BTPS 1.05% 12/01/19	500,000.00	511,137.50
BTPS 1.15% 05/15/17	800,000.00	813,440.00
BTPS 1.35% 04/15/22	3,250,000.00	3,300,716.25
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,496,132.00
BTPS 1.5% 12/15/16	1,200,000.00	1,219,866.00
BTPS 1.65% 03/01/32	800,000.00	736,592.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,666,750.00
BTPS 2.5% 05/01/19	2,000,000.00	2,148,340.00
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,629,817.75
BTPS 2.75% 11/15/16	500,000.00	513,985.00
BTPS 3.25% 09/01/46	1,650,000.00	1,766,028.00
BTPS 3.5% 03/01/30	2,460,000.00	2,840,549.70
BTPS 3.5% 06/01/18	1,600,000.00	1,735,288.00
BTPS 3.5% 11/01/17	2,000,000.00	2,134,890.00
BTPS 3.5% 12/01/18	3,200,000.00	3,516,816.00
BTPS 3.75% 03/01/21	4,700,000.00	5,419,546.50
BTPS 3.75% 05/01/21	750,000.00	866,231.25
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,628,240.00

BTPS 3.75% 09/01/24	3,300,000.00	3,883,374.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,281,593.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	5,800,000.00	6,716,168.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	3,032,077.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,632,896.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,923,751.50	
BTPS 4.5% 03/01/19	1,600,000.00	1,820,328.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,450,000.00	4,255,937.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,800,000.00	3,519,656.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,512,357.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	1,800,000.00	2,010,384.00	
BTPS 4.75% 05/01/17	3,770,000.00	4,031,543.75	
BTPS 4.75% 06/01/17	1,700,000.00	1,824,049.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,556,787.75	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,915,028.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,559,393.75	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	2,320,321.50	
BTPS 4% 02/01/17	3,900,000.00	4,091,119.50	
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	3,464,702.25	
BTPS 4% 09/01/20	3,550,000.00	4,112,089.25	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,450,000.00	3,403,932.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,322,365.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,300,000.00	4,508,245.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,050,000.00	2,629,811.75	
BTPS 5.5% 11/01/22	1,950,000.00	2,504,843.25	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,050,000.00	3,005,986.75	
BTPS 5% 03/01/22	2,250,000.00	2,789,662.50	
BTPS 5% 03/01/25	4,100,000.00	5,284,264.50	
BTPS 5% 08/01/34	2,500,000.00	3,421,112.50	
BTPS 5% 09/01/40	2,650,000.00	3,671,124.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	2,800,000.00	4,119,262.00	
BTPS 6% 05/01/31	4,200,000.00	6,199,809.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,146,718.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,257,472.00	
DBR 0.5% 02/15/25	1,200,000.00	1,189,518.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	2,998,902.50	
DBR 1.5% 05/15/23	1,950,000.00	2,125,548.75	
DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,686,964.00	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,581,101.75	
DBR 1.75% 02/15/24	2,970,000.00	3,292,868.70	
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	2,987,199.00	
DBR 1% 08/15/24	1,150,000.00	1,198,800.25	

DBR 1% 08/15/25	3,000,000.00	3,096,075.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,783,462.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,257,440.00
DBR 2.5% 01/04/21	2,100,000.00	2,375,740.50
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	2,216,421.00
DBR 2.5% 08/15/46	1,550,000.00	1,907,003.75
DBR 2% 01/04/22	3,150,000.00	3,521,274.75
DBR 2% 08/15/23	1,100,000.00	1,240,767.00
DBR 3.25% 01/04/20	4,700,000.00	5,369,491.50
DBR 3.25% 07/04/21	2,900,000.00	3,429,960.50
DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	2,636,763.00
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,977,750.00
DBR 3.75% 01/04/17	3,600,000.00	3,771,036.00
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,678,710.00
DBR 3% 07/04/20	2,300,000.00	2,633,074.50
DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,898,888.00
DBR 4.0% 01/04/37	2,850,000.00	4,206,186.75
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,443,104.00
DBR 4.25% 07/04/18	2,400,000.00	2,691,408.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,573,727.75
DBR 4.75% 07/04/28	1,550,000.00	2,267,262.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,270,000.00	3,572,957.30
DBR 4.75% 07/04/40	1,850,000.00	3,107,611.50
DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,545,564.00
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,408,529.50
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,355,704.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,050,000.00	1,778,836.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,550,000.00	2,538,814.75
FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,045,545.00
FRTR 0.5% 11/25/19	4,300,000.00	4,397,201.50
FRTR 1.5% 05/25/31	530,000.00	526,380.10
FRTR 1.75% 05/25/23	3,760,000.00	4,095,222.80
FRTR 1.75% 11/25/24	3,200,000.00	3,462,384.00
FRTR 1% 05/25/18	4,750,000.00	4,899,530.00
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,379,577.50
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,590,725.00
FRTR 1% 11/25/25	2,000,000.00	2,002,800.00
FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	4,961,836.00
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,613,791.50
FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	3,976,332.50
FRTR 2.5% 10/25/20	4,650,000.00	5,204,210.25
FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	4,796,467.00
FRTR 3.25% 05/25/45	2,050,000.00	2,601,942.00

FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,123,702.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,050,000.00	5,836,790.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	3,850,000.00	4,799,102.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	5,800,000.00	6,140,721.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	4,050,000.00	4,839,264.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	3,750,000.00	4,317,993.75	
FRTR 3% 04/25/22	4,400,000.00	5,149,452.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	4,700,000.00	5,415,575.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	3,250,000.00	3,539,038.75	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,415,814.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,615,793.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,900,000.00	4,408,493.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,950,000.00	4,434,882.50	
FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,948,137.60	
FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	2,587,873.75	
FRTR 4% 04/25/60	1,430,000.00	2,136,069.65	
FRTR 4% 10/25/38	2,780,000.00	3,892,834.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,490,000.00	5,281,434.45	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,420,000.00	5,551,993.80	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,568,092.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,588,320.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,501,528.00	
IRISH 0.8% 03/15/22	1,450,000.00	1,472,330.00	
IRISH 2.4% 05/15/30	800,000.00	861,780.00	
IRISH 2% 02/18/45	670,000.00	622,966.00	
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,067,643.00	
IRISH 3.9% 03/20/23	550,000.00	670,139.25	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,272,122.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	1,950,000.00	2,320,636.50	
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	1,009,700.55	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,910,496.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	920,000.00	1,021,614.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	920,752.50	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,400,000.00	1,420,041.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,270,000.00	1,203,115.45	
NETHER 0.5% 04/15/17	500,000.00	505,875.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	2,350,000.00	2,429,418.25	
NETHER 1.25% 01/15/19	2,100,000.00	2,197,440.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	2,192,910.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,900,000.00	2,148,453.50	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,250,000.00	2,324,913.75	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,200,000.00	1,407,060.00	

NETHER 2.75% 01/15/47	1,140,000.00	1,427,342.70
NETHER 2% 07/15/24	1,700,000.00	1,893,596.00
NETHER 3.25% 07/15/21	1,850,000.00	2,178,560.00
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,272,023.00
NETHER 3.75% 01/15/23	2,030,000.00	2,517,443.60
NETHER 3.75% 01/15/42	1,950,000.00	2,857,968.75
NETHER 4.0% 07/15/18	2,050,000.00	2,284,274.00
NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,648,915.50
NETHER 4% 01/15/37	1,680,000.00	2,445,508.80
NETHER 4% 07/15/19	1,800,000.00	2,076,273.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,396,925.00
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	301,570.00
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,130,030.00
OBL 0.25% 10/11/19	1,450,000.00	1,475,918.75
OBL 0.25% 10/16/20	2,000,000.00	2,030,520.00
OBL 0.5% 02/23/18	2,900,000.00	2,955,622.00
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,428,560.00
OBL 0.5% 04/12/19	1,990,000.00	2,041,600.70
OBL 0.5% 10/13/17	2,750,000.00	2,795,155.00
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,042,150.00
OBL 1% 10/12/18	2,150,000.00	2,231,732.25
RAGB 0.25% 10/18/19	950,000.00	963,741.75
RAGB 1.2% 10/20/25	470,000.00	482,485.55
RAGB 1.65% 10/21/24	1,080,000.00	1,164,780.00
RAGB 1.75% 10/20/23	2,050,000.00	2,240,568.00
RAGB 1.95% 06/18/19	800,000.00	860,888.00
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	566,980.00
RAGB 3.15% 06/20/44	720,000.00	935,564.40
RAGB 3.2% 02/20/17	700,000.00	731,356.50
RAGB 3.4% 11/22/22	850,000.00	1,027,735.00
RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,112,450.75
RAGB 3.65% 04/20/22	1,000,000.00	1,214,760.00
RAGB 3.8% 01/26/62	430,000.00	677,559.60
RAGB 3.9% 07/15/20	1,450,000.00	1,716,075.00
RAGB 4.15% 03/15/37	1,450,000.00	2,095,532.75
RAGB 4.3% 09/15/17	1,400,000.00	1,518,902.00
RAGB 4.35% 03/15/19	2,400,000.00	2,766,000.00
RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,496,137.50
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,315,693.00
RAGB 6.25% 07/15/27	1,060,000.00	1,661,131.30
RFGB 0.375% 09/15/20	550,000.00	559,388.50
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	456,135.00
RFGB 0.875% 09/15/25	320,000.00	319,036.80

RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	571,309.75
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	697,901.75
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	640,533.50
RFGB 2.625% 07/04/42	440,000.00	534,857.40
RFGB 2.75% 07/04/28	640,000.00	760,300.80
RFGB 2% 04/15/24	480,000.00	532,077.60
RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	690,801.00
RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	828,569.00
RFGB 3.875% 09/15/17	1,170,000.00	1,260,961.65
RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,223,486.25
RFGB 4% 07/04/25	750,000.00	970,050.00
SPGB 0.5% 10/31/17	2,230,000.00	2,247,494.35
SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,886,044.00
SPGB 1.6% 04/30/25	2,300,000.00	2,247,387.50
SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,252,131.75
SPGB 2.1% 04/30/17	3,000,000.00	3,091,155.00
SPGB 2.15% 10/31/25	1,950,000.00	1,984,446.75
SPGB 2.75% 04/30/19	3,050,000.00	3,289,440.25
SPGB 2.75% 10/31/24	2,750,000.00	2,957,666.25
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,542,373.00
SPGB 3.8% 01/31/17	2,550,000.00	2,668,077.75
SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,246,964.00
SPGB 4.1% 07/30/18	2,800,000.00	3,089,352.00
SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,322,654.75
SPGB 4.25% 10/31/16	1,850,000.00	1,926,784.25
SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,380,832.75
SPGB 4.4% 10/31/23	1,000,000.00	1,207,070.00
SPGB 4.5% 01/31/18	2,830,000.00	3,099,854.65
SPGB 4.6% 07/30/19	2,850,000.00	3,277,599.75
SPGB 4.65% 07/30/25	2,450,000.00	3,039,310.75
SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,166,990.00
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,776,571.00
SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,568,207.25
SPGB 4.9% 07/30/40	1,600,000.00	2,097,600.00
SPGB 4% 04/30/20	3,700,000.00	4,227,305.50
SPGB 5.15% 10/31/28	2,880,000.00	3,756,499.20
SPGB 5.15% 10/31/44	1,220,000.00	1,665,306.10
SPGB 5.4% 01/31/23	2,330,000.00	2,958,168.00
SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,717,900.00
SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,498,816.00
SPGB 5.75% 07/30/32	2,100,000.00	2,968,444.50
SPGB 5.85% 01/31/22	2,800,000.00	3,584,322.00

	SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,291,604.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,500,000.00	2,106,802.50
	ユーロ 小計	564,190,000.00	666,023,659.65 (88,221,493,957)
イギリスポ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	3,480,000.00	3,510,397.80
	UKT 1.5% 01/22/21	250,000.00	249,950.00
	UKT 1.75% 01/22/17	2,000,000.00	2,028,210.00
	UKT 1.75% 07/22/19	3,550,000.00	3,622,242.50
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,857,210.50
	UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	3,015,645.00
	UKT 2.25% 09/07/23	3,000,000.00	3,088,845.00
	UKT 2.5% 07/22/65	700,000.00	679,021.00
	UKT 2.75% 09/07/24	2,900,000.00	3,086,832.50
	UKT 2% 07/22/20	3,300,000.00	3,391,096.50
	UKT 2% 09/07/25	1,650,000.00	1,643,383.50
	UKT 3.25% 01/22/44	3,100,000.00	3,425,283.00
	UKT 3.5% 01/22/45	2,470,000.00	2,856,690.85
	UKT 3.5% 07/22/68	2,220,000.00	2,789,674.20
	UKT 3.75% 07/22/52	1,970,000.00	2,485,164.85
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	603,438.00
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,946,561.50
	UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,528,808.75
	UKT 4.25% 03/07/36	2,550,000.00	3,197,840.25
	UKT 4.25% 06/07/32	2,430,000.00	3,018,631.05
	UKT 4.25% 09/07/39	1,670,000.00	2,127,346.20
	UKT 4.25% 12/07/27	1,690,000.00	2,063,050.60
	UKT 4.25% 12/07/40	2,000,000.00	2,566,460.00
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	2,791,813.50
	UKT 4.25% 12/07/49	1,600,000.00	2,175,448.00
	UKT 4.25% 12/07/55	1,800,000.00	2,536,371.00
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,563,775.50
	UKT 4.5% 09/07/34	2,600,000.00	3,346,200.00
	UKT 4.5% 12/07/42	2,100,000.00	2,826,432.00
	UKT 4.75% 03/07/20	3,300,000.00	3,786,387.00
	UKT 4.75% 12/07/30	2,500,000.00	3,253,700.00
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,581,501.50
	UKT 4% 01/22/60	1,550,000.00	2,120,066.75
	UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,348,726.00
UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,251,863.50	
UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,397,135.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,793,500.00	
UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,719,360.00	
UKT 8% 06/07/21	2,050,000.00	2,763,717.75	

	イギリスポンド 小計	84,780,000.00	99,037,781.05 (18,448,757,853)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	320,000.00	368,803.20
	SWISS 2% 04/28/21	490,000.00	568,164.80
	SWISS 3% 01/08/18	1,970,000.00	2,148,954.80
	SWISS 4% 02/11/23	1,140,000.00	1,528,854.00
	SWISS 4% 04/08/28	490,000.00	741,485.15
	スイスフラン 小計	4,410,000.00	5,356,261.95 (658,123,905)
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,800,000.00	10,442,439.00
	SGB 2.5% 05/12/25	6,900,000.00	7,942,072.50
	SGB 3.5% 03/30/39	5,350,000.00	6,811,914.25
	SGB 3.5% 06/01/22	10,210,000.00	12,242,402.60
	SGB 3.75% 08/12/17	8,650,000.00	9,290,446.00
	SGB 4.25% 03/12/19	9,700,000.00	11,153,496.50
	SGB 5% 12/01/20	10,150,000.00	12,637,460.50
	スウェーデンクローナ 小計	60,760,000.00	70,520,231.35 (999,976,880)
ノルウェークローネ	NGB 1.75% 03/13/25	2,850,000.00	2,865,618.00
	NGB 2% 05/24/23	6,140,000.00	6,362,513.60
	NGB 3.75% 05/25/21	9,350,000.00	10,632,866.75
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,155,949.00
	NGB 4.25% 05/19/17	7,400,000.00	7,800,266.00
	NGB 4.5% 05/22/19	8,300,000.00	9,351,610.00
	ノルウェークローネ 小計	39,590,000.00	43,168,823.35 (613,860,668)
デンマーククローネ	DGB 1.5% 11/15/23	5,200,000.00	5,556,642.00
	DGB 1.75% 11/15/25	6,850,000.00	7,371,730.25
	DGB 2.5% 11/15/16	6,550,000.00	6,755,375.25
	DGB 3% 11/15/21	10,950,000.00	12,713,771.25
	DGB 4.5% 11/15/39	14,800,000.00	23,410,122.00
	DGB 4% 11/15/17	6,500,000.00	7,085,910.00
	DGB 4% 11/15/19	11,650,000.00	13,551,687.75
	DGB 7% 11/10/24	4,650,000.00	7,225,123.50
	デンマーククローネ 小計	67,150,000.00	83,670,362.00 (1,485,985,629)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,750,000.00	2,663,608.75
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,100,000.00	3,155,738.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,919,140.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,260,000.00	3,348,117.80
	POLGB 3.75% 04/25/18	1,800,000.00	1,885,050.00
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,720,000.00	2,841,053.60



	POLGB 4% 10/25/23	3,150,000.00	3,414,174.75	
	POLGB 5.25% 10/25/17	4,100,000.00	4,380,911.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,180,000.00	2,478,725.40	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,934,880.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,793,246.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,445,154.55	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,500,000.00	1,766,820.00	
	ポーランドズロチ 小計	34,250,000.00	37,026,620.35 (1,152,638,691)	
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	900,000.00	875,506.50	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	2,925,696.90	
	ACGB 2.75% 06/21/35	650,000.00	580,989.50	
	ACGB 2.75% 10/21/19	1,090,000.00	1,114,454.15	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,450,000.00	2,521,442.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,688,257.20	
	ACGB 3.25% 06/21/39	610,000.00	577,929.25	
	ACGB 3.25% 10/21/18	2,050,000.00	2,119,495.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	900,000.00	930,204.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,300,000.00	2,564,925.50	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,800,000.00	1,868,067.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,600,000.00	2,850,679.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,100,000.00	1,262,035.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,210,000.00	2,574,727.35	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,890,000.00	4,286,935.60	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,140,000.00	2,299,611.90	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,900,000.00	3,448,767.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,500,000.00	2,931,425.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,400,000.00	2,865,540.00	
	ACGB 6% 02/15/17	3,050,000.00	3,203,460.75	
	オーストラリアドル 小計	40,160,000.00	43,490,149.10 (3,775,814,744)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	586,707.00	
	SIGB 1.375% 10/01/17	280,000.00	280,428.40	
	SIGB 1.625% 10/01/19	110,000.00	109,238.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	410,000.00	408,370.25	
	SIGB 2.375% 04/01/17	650,000.00	660,562.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	270,000.00	262,872.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	923,404.50	
	SIGB 2.75% 04/01/42	590,000.00	558,030.85	
	SIGB 2.75% 07/01/23	250,000.00	253,268.75	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	199,280.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	297,046.50	
	SIGB 2% 07/01/20	150,000.00	149,362.50	

	SIGB 3.125% 09/01/22	800,000.00	832,784.00
	SIGB 3.25% 09/01/20	930,000.00	978,490.20
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	420,670.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	756,767.70
	SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	792,095.15
	SIGB 4% 09/01/18	630,000.00	672,714.00
	シンガポールドル 小計	8,950,000.00	9,142,092.55 (792,070,898)
マレーシア リンギット	MGS 3.26% 03/01/18	1,450,000.00	1,446,186.50
	MGS 3.314% 10/31/17	1,000,000.00	1,006,135.00
	MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,102,914.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	1,964,935.25
	MGS 3.492% 03/31/20	1,550,000.00	1,529,788.00
	MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	734,836.00
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,158,600.00
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,596,072.00
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,214,648.50
	MGS 3.814% 02/15/17	2,050,000.00	2,073,154.75
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,504,147.50
	MGS 3.892% 03/15/27	750,000.00	720,735.00
	MGS 3.955% 09/15/25	540,000.00	528,230.70
	MGS 4.012% 09/15/17	1,000,000.00	1,019,225.00
	MGS 4.048% 09/30/21	1,400,000.00	1,401,176.00
	MGS 4.127% 04/15/32	1,400,000.00	1,338,001.00
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,659,355.50
	MGS 4.181% 07/15/24	2,100,000.00	2,104,494.00
	MGS 4.24% 02/07/18	2,700,000.00	2,753,325.00
	MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,663,570.00
MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,111,341.00	
MGS 4.935% 09/30/43	650,000.00	676,825.50	
MGS 5.248% 09/15/28	1,350,000.00	1,462,563.00	
	マレーシアリンギット 小計	34,890,000.00	34,770,259.20 (978,435,093)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	28,831,159.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	7,060,406.60
	SAGB 6.5% 02/28/41	7,300,000.00	5,358,419.00
	SAGB 6.75% 03/31/21	8,020,000.00	7,549,787.40
	SAGB 7.25% 01/15/20	6,500,000.00	6,341,140.00
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,000,000.00	5,802,360.00
	SAGB 7% 02/28/31	16,300,000.00	13,586,865.00
	SAGB 8.25% 03/31/32	4,800,000.00	4,464,384.00
	SAGB 8.25% 09/15/17	6,200,000.00	6,298,580.00
	SAGB 8.5% 01/31/37	10,450,000.00	9,717,716.25

	SAGB 8.75% 01/31/44	5,050,000.00	4,761,645.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,200,000.00	12,451,956.00	
	SAGB 8% 01/31/30	2,300,000.00	2,122,796.50	
	SAGB 8% 12/21/18	7,000,000.00	7,060,900.00	
	南アフリカランド 小計	128,140,000.00	121,408,114.75 (1,046,537,949)	
	合計		220,373,107,568 (220,373,107,568)	

## 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 167銘柄	100.0%	43.3%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 260銘柄	100.0%	40.0%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	8.4%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 23銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 14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

注記事項(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

	平成27年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,029,982,377
コール・ローン	224,518,707
株式	255,636,705,697
投資信託受益証券	192,438,882
投資証券	6,188,515,866
派生商品評価勘定	671,887,992
未収入金	2,249,947
未収配当金	359,981,097
未収利息	361
差入委託証拠金	1,901,964,835
流動資産合計	275,208,245,761
資産合計	275,208,245,761
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,309,947
前受金	659,594,251
未払金	25,380,716
未払解約金	419,661,693
流動負債合計	1,116,946,607
負債合計	1,116,946,607
純資産の部	
元本等	
元本	131,670,490,440
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	142,420,808,714
元本等合計	274,091,299,154
純資産合計	274,091,299,154
負債純資産合計	275,208,245,761

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	平成27年11月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落日において、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>

	平成27年11月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	平成27年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	131,670,490,440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 2.0816円 (1万口当たり純資産額) (20,816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

	平成27年11月10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コンプライアンス・リスク統括部が、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

平成27年11月10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	平成27年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	112,298,706,875円
期中追加設定元本額	67,298,047,094円
期中一部解約元本額	47,926,263,529円

区分	平成27年11月10日現在
期末元本額	131,670,490,440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）	2,082,477,527円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,805,823円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,285,531,092円
世界経済インデックスファンド	2,288,060,496円
マイセレクション25	4,044,886円
マイセレクション50	20,420,705円
マイセレクション75	23,174,846円
外国株式インデックス・オープン	1,044,872,189円
D C マイセレクション25	888,644,019円
D C マイセレクション50	4,368,276,096円
D C マイセレクション75	4,656,600,598円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,322,846,216円
D C マイセレクションS25	316,161,613円
D C マイセレクションS50	1,651,639,020円
D C マイセレクションS75	1,221,665,201円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	141,121,840円
D C ターゲット・イヤー ファンド2035	157,070,286円
D C ターゲット・イヤー ファンド2045	82,605,818円
D C 世界経済インデックスファンド	2,328,348,505円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,920,520,883円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	42,980,235円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	28,010,126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）	139,599,166円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	214,646,082円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	727,201,587円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	420,105,083円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	724,367,051円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,746,706,243円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	701,458,775円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,543,272,946円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,677,323,060円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,937,164,873円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	690,302,935円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	655,284,345円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	222,323,174円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,643,832,030円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	3,700,148,118円
外国株式ファンド・シリーズ1	690,533,515円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,751,547,238円
コア投資戦略ファンド（成長型）	12,334,704,765円



区分	平成27年11月10日現在
分散投資コア戦略ファンドA	784,869,365円
分散投資コア戦略ファンドS	1,664,937,310円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	165,643,441円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	262,212,251円
コア投資戦略ファンド（切替型）	918,851,021円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	548,072,595円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	38,898,695円
S M T インデックスバランス・オープン	202,467,453円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	4,074,600,164円
外国株式S M T Bセレクション（S M A専用）	27,299,923,109円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,294,616,030円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,079,686,495
投資信託受益証券	18,454,499
投資証券	112,082,169
合計	10,210,223,163

(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

（平成27年11月10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	11,674,164,324	-	12,333,758,575	659,594,251
合計		11,674,164,324	-	12,333,758,575	659,594,251

## (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。

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

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	342,149,896	-	342,151,540	1,644
	アメリカドル	224,082,610	-	224,082,610	-
	カナダドル	27,000,435	-	27,001,890	1,455
	ユーロ	51,794,597	-	51,791,860	2,737
	イギリスポンド	28,682,654	-	28,685,580	2,926
	オーストラリアドル	10,589,600	-	10,589,600	-
	売建	207,230,650	-	207,248,500	17,850
	アメリカドル	135,641,000	-	135,509,000	132,000
	イギリスポンド	46,429,250	-	46,567,500	138,250
	オーストラリアドル	25,160,400	-	25,172,000	11,600
合計		549,380,546	-	549,400,040	16,206

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	36,549	67.90	2,481,677.10	
	ANTERO RESOURCES CORP	6,631	24.58	162,989.98	
	APACHE CORP	26,227	53.94	1,414,684.38	
	BAKER HUGHES	31,466	51.66	1,625,533.56	
	CABOT OIL & GAS CORP	29,004	22.57	654,620.28	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,037	67.92	953,393.04	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	46.19	724,767.29	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	41,770	7.27	303,667.90	
	CHEVRON CORP	134,308	92.32	12,399,314.56	
	CIMAREX ENERGY CO	6,569	117.35	770,872.15	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	19,979	8.94	178,612.26	

COLUMBIA PIPELINE GROUP	21,371	20.18	431,266.78
CONCHO RESOURCES INC	8,359	111.53	932,279.27
CONOCOPHILLIPS	88,345	54.64	4,827,170.80
CONSOL ENERGY INC	14,731	8.23	121,236.13
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,265	35.66	223,409.90
CORE LABORATORIES N.V.	2,702	120.28	324,996.56
DEVON ENERGY CORPORATION	27,140	46.98	1,275,037.20
ENERGEN CORP	4,802	59.12	283,894.24
ENSCO PLC-CL A	14,882	18.29	272,191.78
EOG RESOURCES INC	39,428	85.37	3,365,968.36
EQT CORPORATION	10,652	66.70	710,488.40
EXXON MOBIL	298,277	81.95	24,443,800.15
FMC TECHNOLOGIES INC	15,287	34.62	529,235.94
HALLIBURTON CO	61,292	39.10	2,396,517.20
HELMERICH & PAYNE	6,883	58.49	402,586.67
HESS CORP	17,961	61.98	1,113,222.78
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	49.17	612,068.16
KINDER MORGAN INC	132,085	25.56	3,376,092.60
MARATHON OIL CORP	47,335	18.36	869,070.60
MARATHON PETROLEUM CORP	39,252	54.32	2,132,168.64
MURPHY OIL CORP	11,085	31.03	343,967.55
NABORS INDUSTRIES LTD	18,529	10.15	188,069.35
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,272	38.93	1,100,628.96
NOBLE ENERGY INC	29,710	37.22	1,105,806.20
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,076	75.21	4,142,265.96
OCEANEERING INTL INC	7,126	43.77	311,905.02
ONEOK INC	15,568	30.80	479,494.40
PHILLIPS 66	38,948	92.01	3,583,605.48
PIONEER NATURAL RESOURCES	10,365	145.86	1,511,838.90
RANGE RESOURCES CORP	12,769	33.29	425,080.01
SCHLUMBERGER	90,789	77.91	7,073,370.99
SOUTHWESTERN ENERGY CO	29,105	11.80	343,439.00
SPECTRA ENERGY CORP	46,574	27.75	1,292,428.50
TESORO CORP	9,230	112.68	1,040,036.40
VALERO ENERGY CORP	36,660	70.49	2,584,163.40
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	52,887	10.92	577,526.04
WHITING PETROLEUM CORP	14,018	18.31	256,669.58
WILLIAMS COS	51,233	36.95	1,893,059.35
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,784	136.33	2,015,502.72
AIRGAS INC	5,138	95.90	492,734.20
ALBEMARLE CORP	7,098	49.92	354,332.16
ALCOA	92,840	8.61	799,352.40

ASHLAND INC	4,845	111.81	541,719.45
AVERY DENNISON CORP	6,084	65.35	397,589.40
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	11,076	28.51	315,776.76
BALL CORP	9,343	66.34	619,814.62
CELANESE CORP-SERIES A	11,407	70.81	807,729.67
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,307	48.17	833,678.19
CROWN HOLDINGS INC	10,494	52.09	546,632.46
DOW CHEMICAL CO	83,043	51.70	4,293,323.10
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	65,265	66.77	4,357,744.05
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,546	69.26	730,415.96
ECOLAB INC	19,413	115.96	2,251,131.48
FMC CORP	8,555	40.60	347,333.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	76,807	10.49	805,705.43
INT'L PAPER CO	27,907	42.11	1,175,163.77
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,028	114.11	687,855.08
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,091	94.49	2,748,808.59
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,255	152.15	647,398.25
MONSANTO CO	34,323	94.27	3,235,629.21
MOSAIC CO/THE	23,240	32.64	758,553.60
NEWMONT MINING CORP	39,440	17.86	704,398.40
NUCOR CORP	22,283	41.78	930,983.74
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	66.48	457,847.76
PPG INDUSTRIES INC	19,788	101.73	2,013,033.24
PRAXAIR INC	20,875	112.50	2,348,437.50
SEALED AIR CORP	14,781	46.91	693,376.71
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,525	266.56	1,472,744.00
SIGMA-ALDRICH	8,333	139.53	1,162,703.49
VULCAN MATERIALS CO	9,287	100.63	934,550.81
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,260	60.61	197,588.60
WESTROCK CO	18,286	51.90	949,043.40
3 M COMPANY	45,347	157.47	7,140,792.09
ACUITY BRANDS INC	3,065	211.83	649,258.95
AGCO CORP	5,969	47.87	285,736.03
AMETEK INC	16,903	56.02	946,906.06
B/E AEROSPACE INC	6,965	46.87	326,449.55
BOEING CO	46,968	145.98	6,856,388.64
CATERPILLAR	41,174	71.89	2,959,998.86
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,538	44.39	290,221.82
CUMMINS INC	11,934	105.20	1,255,456.80
DANAHER CORP	43,959	95.39	4,193,249.01
DEERE&CO	22,921	76.24	1,747,497.04
DOVER CORP	11,832	63.90	756,064.80

EATON CORP	33,730	56.36	1,901,022.80
EMERSON ELECTRIC CO	48,150	48.32	2,326,608.00
FASTENAL CO	19,679	40.58	798,573.82
FLOWSERVE CORP	8,985	46.43	417,173.55
FLUOR CORP	10,027	49.12	492,526.24
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,074	52.00	575,848.00
GENERAL DYNAMICS CORP	20,072	144.29	2,896,188.88
GENERAL ELECTRIC CO	718,680	29.75	21,380,730.00
GRAINGER (WW) INC	4,203	208.75	877,376.25
HONEYWELL INTL INC	53,131	102.71	5,457,085.01
ILLINOIS TOOL WORKS	23,885	91.39	2,182,850.15
INGERSOLL-RAND PLC	18,349	59.15	1,085,343.35
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,917	41.10	325,388.70
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,117	120.68	738,199.56
LOCKHEED MARTIN CORP	19,263	214.70	4,135,766.10
MASCO CORP	23,242	28.41	660,305.22
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,265	181.66	2,409,719.90
PACCAR INC	24,562	52.07	1,278,943.34
PARKER HANNIFIN CORP	10,107	102.60	1,036,978.20
PENTAIR PLC	12,104	56.31	681,576.24
PRECISION CASTPARTS CORP	9,957	230.61	2,296,183.77
QUANTA SERVICES INC	14,015	21.24	297,678.60
RAYTHEON COMPANY	21,971	117.21	2,575,220.91
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,353	107.79	1,008,159.87
ROCKWELL COLLIN	9,269	86.75	804,085.75
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,964	185.66	1,292,936.24
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,018	47.83	574,820.94
SNAP-ON INC	4,317	169.33	730,997.61
STANLEY BLACK&DECKER	10,775	106.56	1,148,184.00
TEXTRON	19,521	41.21	804,460.41
TRANSDIGM GROUP INC	3,709	222.97	826,995.73
UNITED RENTALS INC	7,302	77.50	565,905.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,490	99.66	6,028,433.40
WABCO HOLDINGS INC	3,875	110.64	428,730.00
WABTEC CORP	7,158	75.93	543,506.94
XYLEM INC	11,717	36.45	427,084.65
ADT CORPORATION	11,437	33.29	380,737.73
CINTAS CORP	6,449	90.75	585,246.75
DUN & BRADSTREET CORP	2,440	111.20	271,328.00
EQUIFAX INC	8,759	104.91	918,906.69
IHS INC-CLASS A	5,122	119.74	613,308.28
MANPOWER GROUP	5,272	92.10	485,551.20

NIELSEN HOLDINGS PLC	24,369	47.87	1,166,544.03
REPUBLIC SERVICES INC	18,168	43.58	791,761.44
ROBERT HALF INTL INC	9,340	52.60	491,284.00
STERICYCLE INC	5,973	123.94	740,293.62
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,146	129.65	667,178.90
TYCO INTERNATIONAL PLC	29,209	36.77	1,074,014.93
VERISK ANALYTICS INC	11,168	70.12	783,100.16
WASTE MANAGEMENT INC	33,137	53.69	1,779,125.53
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,336	44.65	550,802.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,328	67.82	700,444.96
CSX CORP	71,296	27.78	1,980,602.88
DELTA AIR LINES INC	15,095	50.63	764,259.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,154	48.95	692,838.30
FEDEX CORP	19,359	160.55	3,108,087.45
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	25,586	16.44	420,633.84
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,122	74.91	458,599.02
KANSAS CITY SOUTHERN	7,756	89.82	696,643.92
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,053	88.62	1,954,336.86
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,137	46.37	516,422.69
UNION PACIFIC CORP	62,862	86.17	5,416,818.54
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,125	60.15	368,418.75
UNITED PARCEL SERVICE B	50,208	104.01	5,222,134.08
AUTOLIV INC	6,037	125.45	757,341.65
BORGWARNER INC	15,914	42.27	672,684.78
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,004	82.31	1,646,529.24
FORD MOTOR COMPANY	265,953	14.33	3,811,106.49
GENERAL MOTORS CO	103,843	35.67	3,704,079.81
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,642	32.55	606,797.10
HARLEY-DAVIDSON	14,677	49.03	719,613.31
JOHNSON CONTROLS INC	47,274	44.65	2,110,784.10
LEAR CORP	5,323	123.54	657,603.42
TESLA MOTORS INC	6,859	225.33	1,545,538.47
COACH INC	19,687	30.88	607,934.56
DR HORTON INC	24,329	28.77	699,945.33
GARMIN LTD	7,608	37.31	283,854.48
HANESBRANDS INC	28,237	31.93	901,607.41
HARMAN INTL INDS INC	4,743	107.54	510,062.22
HASBRO INC	7,972	78.39	624,925.08
JARDEN CORP	13,882	48.65	675,359.30
LEGGETT & PLATT INC	9,020	45.65	411,763.00
LENNAR CORP-CL A	12,360	47.80	590,808.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	50.17	425,040.24

MATTEL INC	25,250	24.70	623,675.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	42.84	596,332.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,358	186.39	812,287.62
NEWELL RUBBERMAID	19,732	43.80	864,261.60
NIKE B	48,802	130.48	6,367,684.96
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	113.21	531,068.11
PULTE GROUP INC	24,602	17.56	432,011.12
PVH CORP	5,867	91.24	535,305.08
RALPH LAUREN CORPORATION	3,958	134.34	531,717.72
TOLL BROTHERS INC	11,131	34.44	383,351.64
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12,439	93.51	1,163,170.89
VF CORP	24,586	67.41	1,657,342.26
WHIRLPOOL CORP	5,470	155.50	850,585.00
ARAMARK	17,044	30.31	516,603.64
BLOCK H & R INC	19,500	36.74	716,430.00
CARNIVAL CORPORATION	28,759	52.57	1,511,860.63
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,247	609.29	1,369,074.63
DARDEN RESTAURANTS INC	8,439	61.36	517,817.04
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,483	25.44	877,247.52
LAS VEGAS SANDS CORP	27,583	46.61	1,285,643.63
MARRIOTT INTL A	15,364	75.76	1,163,976.64
MCDONALD'S CORP	68,516	112.93	7,737,511.88
MGM RESORTS INTERNATIONAL	31,282	23.32	729,496.24
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11,086	58.75	651,302.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,264	97.77	1,199,051.28
STARBUCKS CORP	107,240	61.34	6,578,101.60
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,530	76.93	963,932.90
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,080	80.56	650,924.80
WYNN RESORTS LTD	5,532	68.15	377,005.80
YUM BRANDS INC	31,103	69.00	2,146,107.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,178	31.15	410,494.70
CBS CORP-CL B	31,516	48.54	1,529,786.64
CHARTER COMMUNICATION-A	5,860	190.16	1,114,337.60
COMCAST CORP-CL A	151,626	61.35	9,302,255.10
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,986	61.51	1,782,928.86
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,803	29.00	284,287.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,203	27.57	501,856.71
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,581	63.09	983,005.29
INTERPUBLIC GROUP OF COS	30,771	22.67	697,578.57
LIBERTY GLOBAL PLC-A	17,571	45.65	802,116.15
LIBERTY GLOBAL PLC-C	44,688	43.82	1,958,228.16
LIBERTY MEDIA CORP	6,384	40.43	258,105.12

LIBERTY MEDIA CORP-C	15,233	39.09	595,457.97
NEWS CORP-CLASS A	27,721	14.42	399,736.82
OMNICOM GROUP	16,939	72.52	1,228,416.28
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	58.38	287,287.98
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	4.11	682,329.87
TEGNA INC	15,014	27.07	406,428.98
THE WALT DISNEY CO	115,045	116.42	13,393,538.90
TIME WARNER CABLE-A	20,265	187.83	3,806,374.95
TIME WARNER INC	59,065	68.49	4,045,361.85
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	90,566	29.49	2,670,791.34
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	30,649	29.70	910,275.30
VIACOM INC-CLASS B	25,254	47.78	1,206,636.12
ADVANCE AUTO PARTS	5,123	194.90	998,472.70
AMAZON.COM	28,241	655.49	18,511,693.09
AUTONATION INC	5,015	63.66	319,254.90
AUTOZONE INC	2,296	783.48	1,798,870.08
BED BATH & BEYOND INC	12,615	60.11	758,287.65
BEST BUY COMPANY INC	22,277	35.36	787,714.72
CARMAX INC	14,601	56.45	824,226.45
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	44.21	280,468.24
DOLLAR GENERAL CORP	22,000	66.97	1,473,340.00
DOLLAR TREE INC	15,514	67.61	1,048,901.54
EXPEDIA INC	7,575	129.48	980,811.00
FOOT LOCKER INC	9,388	67.22	631,061.36
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	45.50	340,840.50
GAP	17,852	27.69	494,321.88
GENUINE PARTS CO	10,617	88.91	943,957.47
HOME DEPOT	92,729	124.50	11,544,760.50
KOHL'S CORP	14,309	43.98	629,309.82
L BRANDS INC	17,992	93.69	1,685,670.48
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	31,128	26.41	822,090.48
LKQ CORP	22,518	30.11	678,016.98
LOWES COMPANIES	67,794	72.02	4,882,523.88
MACY'S INC	23,441	46.24	1,083,911.84
NETFLIX INC	28,992	109.86	3,185,061.12
NORDSTROM INC	10,094	62.70	632,893.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,304	269.59	1,969,085.36
PRICELINE GROUP INC/THE	3,710	1,311.15	4,864,366.50
ROSS STORES INC	30,013	49.12	1,474,238.56
SIGNET JEWELERS LTD	5,419	146.85	795,780.15
STAPLES INC	47,470	12.83	609,040.10
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,511	76.23	3,316,843.53



TIFFANY & CO	9,101	80.22	730,082.22
TJX COMPANIES INC	48,793	71.07	3,467,718.51
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,011	92.03	921,312.33
TRIPADVISOR INC	8,771	77.12	676,419.52
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,504	171.56	772,706.24
URBAN OUTFITTERS INC	7,303	28.31	206,747.93
COSTCO WHOLESALE CORP	31,505	155.16	4,888,315.80
CVS HEALTH CORP	80,600	97.99	7,897,994.00
KROGER CO	67,058	37.20	2,494,557.60
RITE AID CORP	69,829	7.83	546,761.07
SYSCO CORP	42,954	40.47	1,738,348.38
WAL-MART STORES	115,229	58.49	6,739,744.21
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,415	83.48	5,210,404.20
WHOLE FOODS MKT INC	25,128	30.48	765,901.44
ALTRIA GROUP INC	140,516	57.08	8,020,653.28
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,789	41.52	1,859,639.28
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,415	103.84	873,813.60
BUNGE LIMITED	10,583	71.61	757,848.63
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,202	48.67	642,541.34
COCA-COLA CO	295,556	41.54	12,277,396.24
COCA-COLA ENTERPRISES	15,090	50.12	756,310.80
CONAGRA	29,521	41.32	1,219,807.72
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,414	132.27	1,641,999.78
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,320	85.90	1,144,188.00
GENERAL MILLS INC	42,898	56.43	2,420,734.14
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,504	85.12	894,100.48
HORMEL FOODS CORP	10,754	66.59	716,108.86
JM SMUCKER CO	7,181	114.91	825,168.71
KELLOGG CO	18,340	67.47	1,237,399.80
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,222	52.38	430,668.36
KRAFT HEINZ CO/THE	42,751	71.24	3,045,581.24
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,566	83.55	715,689.30
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,100	82.49	1,163,109.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,738	87.36	938,071.68
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	116,411	44.39	5,167,484.29
MONSTER BEVERAGE CORP	9,868	149.05	1,470,825.40
PEPSICO INC	105,394	98.88	10,421,358.72
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	110,640	85.25	9,432,060.00
REYNOLDS AMERICAN INC	61,705	44.57	2,750,191.85
TYSON FOODS INC	21,224	45.05	956,141.20
WHITELAVE FOODS CO	12,395	43.38	537,695.10
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,620	81.32	782,298.40

CLOROX COMPANY	9,110	121.88	1,110,326.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,584	65.77	4,050,379.68
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	81.60	367,526.40
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,024	84.65	1,356,431.60
KIMBERLY-CLARK CORP	26,166	118.02	3,088,111.32
PROCTER & GAMBLE CO	193,587	75.40	14,596,459.80
ABBOTT LABORATORIES	106,578	45.05	4,801,338.90
AETNA INC	25,079	108.00	2,708,532.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,456	97.40	1,408,014.40
ANTHEM INC	19,010	133.77	2,542,967.70
BARD C R INC	5,186	185.20	960,447.20
BAXTER INTERNATIONAL	37,616	37.66	1,416,618.56
BECTON DICKINSON & CO	15,099	152.41	2,301,238.59
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,069	18.59	1,804,512.71
CARDINAL HEALTH	23,879	87.67	2,093,471.93
CENTENE CORP	7,820	61.08	477,645.60
CERNER CORP	21,475	59.38	1,275,185.50
CIGNA CORP	18,507	132.94	2,460,320.58
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	11,984	75.59	905,870.56
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,467	60.49	633,148.83
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,475	157.18	1,174,920.50
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	30.12	386,891.40
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	52,190	88.17	4,601,592.30
HCA HOLDINGS INC	23,905	69.98	1,672,871.90
HENRY SCHEIN INC	5,885	152.98	900,287.30
HOLOGIC INC	16,762	39.64	664,445.68
HUMANA INC	10,808	177.65	1,920,041.20
INTUITIVE SURGICAL INC	2,554	498.04	1,271,994.16
LABORATORY CRP OF AMER	7,053	122.86	866,531.58
MCKESSON CORP	16,616	183.13	3,042,888.08
MEDTRONIC PLC	101,217	75.87	7,679,333.79
PATTERSON COMPANIES INC	5,552	47.92	266,051.84
QUEST DIAGNOSTICS	10,170	67.74	688,915.80
RESMED INC	10,525	57.97	610,134.25
ST JUDE MEDICAL INC	19,447	63.63	1,237,412.61
STRYKER CORP	24,512	96.81	2,373,006.72
THE COOPER COS INC	3,161	152.02	480,535.22
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,006	114.26	7,770,365.56
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,432	124.44	800,398.08
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,730	80.69	543,043.70
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,989	106.92	1,281,863.88
ABBVIE INC	122,912	63.23	7,771,725.76

AGILENT TECHNOLOGIES	23,439	37.92	888,806.88
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,101	172.64	2,779,676.64
ALKERMES PLC	10,522	72.12	758,846.64
ALLERGAN PLC	28,032	296.82	8,320,458.24
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,369	108.84	584,361.96
AMGEN	54,309	159.63	8,669,345.67
BAXALTA INC	37,546	34.35	1,289,705.10
BIOGEN INC	16,831	293.40	4,938,215.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,088	111.36	1,234,759.68
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	119,135	64.99	7,742,583.65
CELGENE CORP	56,686	114.08	6,466,738.88
ENDO INTERNATIONAL PLC	14,108	54.50	768,886.00
GILEAD SCIENCES INC	104,905	108.11	11,341,279.55
ILLUMINA INC	10,393	154.61	1,606,861.73
INCYTE CORP	11,132	105.86	1,178,433.52
ISIS PHARMACEUTICALS INC	9,019	62.77	566,122.63
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,302	139.99	602,236.98
JOHNSON & JOHNSON	197,782	100.84	19,944,336.88
LILLY (ELI) & CO	71,505	79.36	5,674,636.80
MALLINCKRODT PLC	8,200	58.01	475,682.00
MEDIVATION INC	11,768	41.95	493,667.60
MERCK & CO	201,689	54.24	10,939,611.36
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,879	328.09	616,481.11
MYLAN NV	28,817	45.14	1,300,799.38
PERRIGO CO PLC	10,560	159.72	1,686,643.20
PFIZER	439,346	33.65	14,783,992.90
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,028	90.94	184,426.32
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,593	67.06	442,126.58
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,456	558.52	3,047,285.12
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,546	134.30	3,833,727.80
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	157.16	506,998.16
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,550	118.85	2,085,817.50
WATERS CORP	5,852	132.16	773,400.32
ZOETIS INC	32,871	45.80	1,505,491.80
BANK OF AMERICA CORP	749,534	17.68	13,251,761.12
BB&T CORP	56,217	38.65	2,172,787.05
CIT GROUP INC	12,099	42.53	514,570.47
CITIGROUP	216,580	55.71	12,065,671.80
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,664	25.87	767,407.68
COMERICA INC	11,868	46.34	549,963.12
FIFTH THIRD BANCORP	56,599	20.41	1,155,185.59
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,126	67.98	688,365.48

HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,051	11.57	694,790.07
JPMORGAN CHASE & CO	264,723	67.39	17,839,682.97
KEY CORP	62,338	13.17	820,991.46
M & T BANK CORP	8,310	123.63	1,027,365.30
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,048	15.82	522,819.36
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	16.71	364,896.27
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,154	94.63	3,515,883.02
REGIONS FINL CORP	93,833	9.99	937,391.67
SUNTRUST BANKS	35,813	43.23	1,548,195.99
US BANCORP	126,859	43.34	5,498,069.06
WELLS FARGO & CO	348,898	55.47	19,353,372.06
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,839	177.87	682,842.93
ALLY FINANCIAL INC	30,804	19.80	609,919.20
AMERICAN EXPRESS	65,430	73.42	4,803,870.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,569	117.39	1,475,474.91
BANK NEW YORK CO	80,497	43.67	3,515,303.99
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	83,237	134.00	11,153,758.00
BLACKROCK INC	8,875	349.57	3,102,433.75
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,238	80.45	3,156,697.10
CME GROUP INC	23,109	97.22	2,246,656.98
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32,027	57.12	1,829,382.24
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,026	30.24	605,586.24
EATON VANCE CORP	7,881	36.91	290,887.71
FRANKLIN RESOURCES INC	27,900	40.65	1,134,135.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,821	196.76	5,474,059.96
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,040	261.30	2,100,852.00
INVESCO LTD	29,872	33.44	998,919.68
LEGG MASON INC	7,716	45.07	347,760.12
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,648	18.90	409,147.20
MCGRAW-HILL FINANCIAL	19,765	96.27	1,902,776.55
MOODY'S CORP	12,621	100.38	1,266,895.98
MORGAN STANLEY	105,938	35.11	3,719,483.18
NASDAQ INC	7,604	57.68	438,598.72
NAVIENT CORP	29,884	12.95	386,997.80
NORTHERN TRUST CORP	15,365	74.04	1,137,624.60
PRICE T ROWE GROUP INC	18,086	75.53	1,366,035.58
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,630	57.68	497,778.40
SCHWAB (CHARLES) CORP	84,997	33.49	2,846,549.53
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,417	53.31	502,020.27
STATE STREET CORP	29,676	72.42	2,149,135.92
SYNCHRONY FINANCIAL	11,555	32.52	375,768.60
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,139	36.95	744,136.05

VOYA FINANCIAL INC	16,094	41.52	668,222.88
ACE LTD	23,508	112.52	2,645,120.16
AFLAC	31,363	63.56	1,993,432.28
ALLEGHANY CORP	1,109	504.22	559,179.98
ALLSTATE CORP	29,595	63.52	1,879,874.40
AMERICAN INT'L GROUP	95,373	61.21	5,837,781.33
AON PLC	20,347	92.43	1,880,673.21
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,789	74.10	651,264.90
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,411	43.65	498,090.15
ASSURANT INC	4,769	84.07	400,929.83
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	55.31	403,873.62
CHUBB CORPORATION	16,578	128.82	2,135,577.96
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,121	60.21	669,595.41
EVEREST RE GROUP LTD	2,941	180.41	530,585.81
FNF GROUP	18,683	34.85	651,102.55
HARTFORD FINANCIAL SVCS	29,014	46.88	1,360,176.32
LINCOLN NATIONAL CORP	17,658	55.82	985,669.56
LOEWS CORP	21,888	37.63	823,645.44
MARSH & MCLENNAN COS	38,821	55.63	2,159,612.23
METLIFE INC	68,046	50.80	3,456,736.80
PARTNERRE LTD	3,587	138.30	496,082.10
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,417	50.46	1,030,241.82
PROGRESSIVE CORP	40,801	31.47	1,284,007.47
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,576	86.02	2,802,187.52
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	110.92	360,379.08
TORCHMARK CORP	8,367	59.35	496,581.45
TRAVELERS COS INC/THE	22,954	112.83	2,589,899.82
UNUM GROUP	18,574	35.95	667,735.30
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	10,983	44.05	483,801.15
WR BERKLEY CORP	7,065	54.98	388,433.70
XL GROUP PLC	21,398	37.36	799,429.28
CBRE GROUP INC-A	21,139	35.96	760,158.44
JONES LANG LASALLE INC	3,112	159.92	497,671.04
REALOGY HOLDINGS CORP	9,422	41.89	394,687.58
WEYERHAEUSER CO	36,213	29.50	1,068,283.50
ACCENTURE PLC-CL A	44,937	104.88	4,712,992.56
ACTIVISION BLIZZARD INC	35,536	34.05	1,210,000.80
ADOBE SYSTEMS INC	36,009	89.80	3,233,608.20
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	12,545	61.83	775,657.35
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,344	296.73	1,288,995.12
ALPHABET INC-CL A	20,610	754.77	15,555,809.70
ALPHABET INC-CL C	22,046	724.89	15,980,924.94

ANSYS INC	5,989	92.20	552,185.80
AUTODESK INC	16,007	63.51	1,016,604.57
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,826	86.76	2,934,743.76
CA INC	24,426	27.07	661,211.82
CDK GLOBAL INC	9,538	49.25	469,746.50
CITRIX SYSTEMS INC	11,275	80.41	906,622.75
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,959	67.97	2,987,893.23
COMPUTER SCIENCES CORP	10,337	67.43	697,023.91
EBAY	78,992	29.18	2,304,986.56
ELECTRONIC ARTS INC	22,844	70.94	1,620,553.36
FACEBOOK INC-A	152,743	106.49	16,265,602.07
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	19,633	66.35	1,302,649.55
FIREEYE INC	7,918	23.76	188,131.68
FISERV INC	16,464	95.31	1,569,183.84
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,487	153.47	842,089.89
GARTNER INC	6,094	86.48	527,009.12
INTL BUSINESS MACHINES CORP	66,925	135.31	9,055,621.75
INTUIT INC	18,993	97.51	1,852,007.43
LINKEDIN CORP - A	7,652	254.52	1,947,587.04
MASTERCARD INC-CLASS A	71,942	100.47	7,228,012.74
MICROSOFT CORP	549,044	54.16	29,736,223.04
NETSUITE INC	2,264	85.38	193,300.32
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	17.34	303,866.16
ORACLE CORP	249,963	40.10	10,023,516.30
PAYCHEX INC	22,738	52.73	1,198,974.74
PAYPAL HOLDINGS INC	78,428	36.60	2,870,464.80
RACKSPACE HOSTING INC	8,040	27.09	217,803.60
RED HAT INC	12,854	80.29	1,032,047.66
SALESFORCE.COM INC	44,787	78.22	3,503,239.14
SERVICENOW INC	10,271	84.60	868,926.60
SPLUNK INC	8,873	59.07	524,128.11
SYMANTEC CORP	47,460	20.12	954,895.20
SYNOPSYS INC	11,010	51.19	563,601.90
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,378	100.05	337,968.90
TERADATA CORP	9,511	27.67	263,169.37
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,950	52.07	570,166.50
TWITTER INC	34,394	27.09	931,733.46
VANTIV INC - CL A	9,716	50.98	495,321.68
VERISIGN INC	7,494	81.24	608,812.56
VISA INC-CLASS A SHARES	140,034	78.04	10,928,253.36
VMWARE INC-CLASS A	5,459	59.46	324,592.14
WESTERN UNION CO	34,620	19.43	672,666.60

WORKDAY INC-CLASS A	7,992	81.54	651,667.68
XEROX CORP	73,995	9.68	716,271.60
YAHOO	64,457	33.68	2,170,911.76
ZILLOW GROUP INC-A	3,100	27.74	85,994.00
ZILLOW GROUP INC-C	6,200	25.30	156,860.00
AMPHENOL CORPORATION	21,467	54.90	1,178,538.30
APPLE INC	411,408	120.57	49,603,462.56
ARROW ELECTRONICS INC	6,579	59.49	391,384.71
AVNET INC	9,057	46.29	419,248.53
CISCO SYSTEMS	363,870	28.18	10,253,856.60
CORNING	87,462	18.77	1,641,661.74
EMC CORP	139,592	25.83	3,605,661.36
F5 NETWORKS INC	5,350	109.50	585,825.00
FLEXTRONICS INTL LTD	38,641	11.61	448,622.01
FLIR SYSTEMS INC	9,284	26.71	247,975.64
HARRIS CORP	8,769	79.49	697,047.81
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	130,581	14.20	1,854,250.20
HP INC	130,581	13.87	1,811,158.47
JUNIPER NETWORKS INC	24,324	29.24	711,233.76
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,616	68.20	928,611.20
NETAPP INC	23,085	34.14	788,121.90
PALO ALTO NETWORKS INC	4,973	161.21	801,697.33
QUALCOMM	116,767	52.94	6,181,644.98
SANDISK CORP	15,286	76.91	1,175,646.26
SEAGATE TECHNOLOGY	23,147	38.28	886,067.16
TE CONNECTIVITY LTD	29,455	65.95	1,942,557.25
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,032	22.09	376,236.88
WESTERN DIGITAL CORP	16,063	66.61	1,069,956.43
AT&T INC	438,612	32.84	14,404,018.08
CENTURYLINK INC	39,157	28.81	1,128,113.17
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	82,647	4.84	400,011.48
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	20,961	50.57	1,059,997.77
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,972	106.80	958,209.60
SPRINT CORP	53,367	4.28	228,410.76
T-MOBILE US INC	19,816	38.56	764,104.96
VERIZON COMMUNICATIONS	291,030	45.30	13,183,659.00
AES CORP	44,856	9.90	444,074.40
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,521	56.81	484,078.01
AMEREN CORPORATION	17,147	43.14	739,721.58
AMERICAN ELECTRIC POWER	35,378	54.43	1,925,624.54
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,314	55.79	742,788.06
CALPINE CORP	25,284	14.70	371,674.80

CENTERPOINT ENERGY INC	30,517	17.50	534,047.50
CMS ENERGY CORP	18,893	34.40	649,919.20
CONSOLIDATED EDISON INC	20,321	61.93	1,258,479.53
DOMINION RESOURCES	42,626	67.73	2,887,058.98
DTE ENERGY COMPANY	12,439	79.30	986,412.70
DUKE ENERGY CORP	49,603	67.97	3,371,515.91
EDISON INTL	22,596	59.25	1,338,813.00
ENERGY CORP	12,548	65.14	817,376.72
EVERSOURCE ENERGY	22,121	49.35	1,091,671.35
EXELON CORP	62,204	28.81	1,792,097.24
FIRSTENERGY CORP	29,330	29.12	854,089.60
MDU RESOURCES GROUP INC	12,385	18.58	230,113.30
NEXTERA ENERGY INC	31,883	98.91	3,153,547.53
NRG ENERGY INC	25,186	13.30	334,973.80
OGE ENERGY CORP	12,751	26.13	333,183.63
PEPCO HOLDINGS INC	16,437	26.59	437,059.83
PG&E CORP	34,729	52.50	1,823,272.50
PINNACLE WEST CAPITAL	8,330	62.00	516,460.00
PPL CORPORATION	46,162	33.05	1,525,654.10
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	34,913	38.77	1,353,577.01
SCANA CORP	10,178	57.62	586,456.36
SEMPRA ENERGY	17,041	100.35	1,710,064.35
SOUTHERN CO	65,269	44.02	2,873,141.38
WEC ENERGY GROUP INC	22,005	49.19	1,082,425.95
XCEL ENERGY INC	35,219	35.01	1,233,017.19
ALTERA CORPORATION	21,988	52.60	1,156,568.80
ANALOG DEVICES	21,812	60.96	1,329,659.52
APPLIED MATERIALS	85,527	16.81	1,437,708.87
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	18,714	126.50	2,367,321.00
BROADCOM CORP-CL A	39,952	53.19	2,125,046.88
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	7,708	34.45	265,540.60
INTEL CORP	339,374	33.35	11,318,122.90
KLA-TENCOR CORP	10,702	66.92	716,177.84
LAM RESEARCH CORP	11,195	77.00	862,015.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,891	44.74	755,703.34
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,286	8.90	269,545.40
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,025	40.02	841,420.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,894	47.81	712,156.61
MICRON TECHNOLOGY	75,291	15.84	1,192,609.44
NVIDIA CORP	37,929	31.41	1,191,349.89
QORVO INC	10,609	54.09	573,840.81
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,268	84.89	1,126,320.52



	TEXAS INSTRUMENTS	74,739	57.21	4,275,818.19
	XILINX INC	18,324	47.36	867,824.64
	アメリカドル 小計	22,624,628		1,341,752,032.91 (165,303,850,454)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,790	33.18	291,652.20
	ARC RESOURCES LTD	21,371	18.15	387,883.65
	BAYTEX ENERGY CORP	17,204	6.24	107,352.96
	CAMECO CORP	28,709	16.63	477,430.67
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	77,135	32.93	2,540,055.55
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,980	9.76	282,844.80
	CENOVUS ENERGY INC	59,243	20.87	1,236,401.41
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	38,454	18.10	696,017.40
	ENBRIDGE	60,169	50.44	3,034,924.36
	ENCANA CORP	57,917	10.67	617,974.39
	ENERPLUS CORP	14,969	7.18	107,477.42
	HUSKY ENERGY INC	22,657	18.67	423,006.19
	IMPERIAL OIL	21,387	42.77	914,721.99
	INTER PIPELINE LTD	25,744	24.41	628,411.04
	KEYERA CORP	11,240	42.01	472,192.40
	MEG ENERGY CORP	11,150	11.47	127,890.50
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,731	31.30	805,380.30
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,172	28.23	258,925.56
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,235	26.12	241,218.20
	SUNCOR ENERGY	104,463	38.97	4,070,923.11
	TOURMALINE OIL CORP	11,584	27.02	312,999.68
	TRANSCANADA CORP	49,707	43.18	2,146,348.26
	VERESEN INC	23,263	10.61	246,820.43
	VERMILION ENERGY INC	7,138	43.73	312,144.74
	AGNICO EAGLE MINES	13,800	34.31	473,478.00
	AGRIUM INC	9,859	129.81	1,279,796.79
	BARRICK GOLD CORP	89,275	9.77	872,216.75
	ELDORADO GOLD CORP	45,613	4.46	203,433.98
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,991	6.65	372,340.15
	FRANCO-NEVADA CORP	10,197	62.65	638,842.05
	GOLDCORP INC	59,518	15.83	942,169.94
	KINROSS GOLD CORP	81,986	2.41	197,586.26
	METHANEX CORP	6,468	54.52	352,635.36
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	58,698	27.68	1,624,760.64
	SILVER WHEATON CORP	28,647	16.87	483,274.89
	TECK RESOURCES LTD-CL B	37,266	6.98	260,116.68
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.77	267,670.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	46.49	201,162.23

YAMANA GOLD INC	59,651	2.45	146,144.95
BOMBARDIER B	157,835	1.50	236,752.50
CAE INC	18,429	15.11	278,462.19
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	21.07	247,867.48
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	40.75	494,379.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,934	79.29	4,593,586.86
CP RAILWAY LIMITED	10,996	188.79	2,075,934.84
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,782	62.89	1,810,099.98
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	37.11	655,325.49
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,433	47.33	730,443.89
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,558	26.98	824,454.84
THOMSON REUTERS CORP	25,460	52.91	1,347,088.60
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	111.25	601,751.25
DOLLARAMA INC	8,315	91.28	758,993.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,496	59.90	1,766,810.40
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	27.18	312,542.82
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	19.72	108,736.08
LOBLAW COMPANIES LTD	16,203	67.46	1,093,054.38
METRO INC	19,179	37.43	717,869.97
WESTON (GEORGE) LTD	3,518	108.60	382,054.80
SAPUTO INC	16,769	31.42	526,881.98
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	23,471	113.24	2,657,856.04
BANK MONTREAL	46,810	76.41	3,576,752.10
BANK NOVA SCOTIA	87,726	60.99	5,350,408.74
CANADIAN IMPERIAL BANK	28,004	99.50	2,786,398.00
NATIONAL BANK OF CANADA	23,678	43.72	1,035,202.16
ROYAL BANK OF CANADA	103,729	76.06	7,889,627.74
TORONTO-DOMINION BANK	133,315	54.44	7,257,668.60
CI FINANCIAL CORP	18,671	31.38	585,895.98
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.82	298,331.70
ONEX CORP	5,970	81.66	487,510.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,554	649.73	1,009,680.42
GREAT-WEST LIFECO INC	22,628	36.00	814,608.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	44.17	305,700.57
INTACT FINANCIAL CORP	9,906	89.08	882,426.48
MANULIFE FINANCIAL CORP	142,781	22.11	3,156,887.91
POWER CORP OF CANADA	28,343	30.30	858,792.90
POWER FINANCIAL CORP	16,605	33.51	556,433.55
SUN LIFE FINANCIAL INC	42,970	44.87	1,928,063.90
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	60,418	43.25	2,613,078.50
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,916	19.51	134,931.16
CGI GROUP INC - CL A	17,086	52.63	899,236.18

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,448	560.27	811,270.96
	OPEN TEXT CORP	8,064	60.02	484,001.28
	BCE INC	10,313	57.04	588,253.52
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	25,886	51.87	1,342,706.82
	TELUS CORP	16,454	41.24	678,562.96
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	37.72	197,690.52
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,267	34.59	251,365.53
	FORTIS INC	21,187	37.92	803,411.04
	TRANSALTA CORP	15,621	6.10	95,288.10
	カナダドル 小計	2,827,260		98,957,757.99 (9,183,279,941)
ユーロ	ENI	182,966	14.70	2,689,600.20
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	9.92	256,344.92
	NESTE OIL OYJ	9,335	24.02	224,226.70
	OMV AG	9,889	25.67	253,900.07
	REPSOL SA	74,777	12.17	910,409.97
	SAIPEM	22,904	8.44	193,309.76
	TECHNIP S.A.	7,230	49.99	361,427.70
	TENARIS SA	34,866	11.78	410,721.48
	TOTAL SA	154,199	45.92	7,080,818.08
	VOPAK	4,507	38.82	174,984.27
	AIR LIQUIDE	24,736	121.35	3,001,713.60
	AKZO NOBEL	17,228	64.90	1,118,097.20
	ARCELORMITTAL	75,111	5.03	378,183.88
	ARKEMA	4,293	67.26	288,747.18
	BASF SE	65,779	76.46	5,029,462.34
	CRH	58,420	25.53	1,491,462.60
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,337	33.20	343,240.08
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	41.60	175,905.94
	HEIDELBERGCEMENT AG	10,108	70.08	708,368.64
	IMERYS SA	3,000	61.98	185,940.00
	K+S AG	14,355	24.37	349,903.12
	KONINKLIJKE DSM NV	13,482	48.62	655,562.25
	LANXESS	5,814	48.78	283,635.99
	LINDE AG	13,402	162.45	2,177,154.90
	OCI NV	5,400	25.07	135,378.00
	SOLVAY SA	4,469	103.40	462,094.60
	STORA ENSO OYJ R	36,014	9.08	327,187.19
	SYMRISE AG	8,131	60.07	488,429.17
	THYSSEN KRUPP	26,520	18.97	503,084.40
	UMICORE	6,892	39.77	274,094.84
	UPM KYMMENE CORP	38,348	17.54	672,623.92

VOESTALPINE AG	7,829	33.44	261,840.90
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,261	31.11	443,731.01
AIRBUS GROUP SE	42,522	65.40	2,780,938.80
ALSTOM RGPT	16,356	29.30	479,230.80
ANDRITZ AG	5,242	48.43	253,870.06
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	43.84	256,624.78
BOUYGUES ORD	13,925	34.79	484,520.37
BRENTAG AG	11,535	48.75	562,331.25
CNH INDUSTRIAL NV	65,726	6.37	418,674.62
FERROVIAL SA	31,764	21.86	694,519.86
FERROVIAL SA-RTS	31,764	0.38	12,197.37
FINMECCANICA SPA	28,941	12.08	349,607.28
GEA GROUP AG	13,801	36.78	507,669.78
KONE OYJ-B	23,752	39.82	945,804.64
KONINKLIJKE PHILIPS	65,209	24.85	1,620,769.69
LEGRAND SA	18,733	52.92	991,350.36
MAN SE	2,329	93.82	218,506.78
METSO OYJ	6,575	22.94	150,830.50
OSRAM LICHT AG	5,675	52.63	298,675.25
PRYSMIAN SPA	14,715	19.26	283,410.90
REXEL SA	18,266	12.65	231,156.23
SAFRAN SA	20,383	69.42	1,414,987.86
SAINT-GOBAIN	33,361	39.83	1,328,768.63
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,019	56.80	2,273,079.20
SIEMENS	56,767	92.35	5,242,432.45
THALES SA	7,875	66.51	523,766.25
VINCI S.A.	34,479	61.83	2,131,836.57
WARTSILA OYJ	9,741	40.49	394,413.09
ZARDOYA OTIS SA	13,496	11.10	149,805.60
ZODIAC AEROSPACE	13,148	25.04	329,225.92
BUREAU VERITAS SA	19,558	19.30	377,469.40
EDENRED	13,303	16.88	224,554.64
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	53.38	511,807.44
SOCIETE BIC SA	1,899	145.85	276,969.15
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	34,142	14.07	480,548.65
ADP	2,382	112.75	268,570.50
AENA SA	4,899	99.55	487,695.45
ATLANTIA SPA	29,543	24.03	709,918.29
BOLLORE	61,805	4.51	278,740.55
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,731	13.51	199,089.46
DEUTSCHE POST AG-REG	67,417	27.01	1,821,270.25
FRAPORT AG	2,319	57.71	133,829.49

GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	30,159	12.44	375,328.75
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	8.37	504,491.63
TNT EXPRESS	38,784	7.66	297,279.36
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,900	94.96	2,269,544.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	74.46	266,641.26
CONTINENTAL AG	7,670	212.25	1,627,957.50
DAIMLER AG	68,927	78.00	5,376,306.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	66,864	13.16	879,930.24
MICHELIN	13,073	92.20	1,205,330.60
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,697	33.81	260,235.57
PEUGEOT SA	31,342	16.16	506,486.72
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,908	39.76	433,702.08
RENAULT SA	13,521	89.72	1,213,104.12
VALEO SA	5,679	138.80	788,245.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,739	96.00	1,126,944.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	120.10	311,539.40
ADIDAS AG	14,723	86.75	1,277,220.25
CHRISTIAN DIOR	4,038	179.60	725,224.80
HERMES INTERNATIONAL	1,961	343.35	673,309.35
HUGO BOSS AG	4,852	91.60	444,443.20
KERING	5,366	169.20	907,927.20
LUXOTTICA GROUP SPA	12,039	61.90	745,214.10
LVMH	20,068	167.30	3,357,376.40
ACCOR	14,931	43.14	644,197.99
SODEXO	7,055	77.21	544,716.55
ALTICE NV -A	17,433	15.99	278,753.67
ALTICE NV -B	5,811	16.46	95,649.06
AXEL SPRINGER SE	2,489	50.86	126,590.54
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	30.05	359,878.80
JC DECAUX SA	4,674	35.88	167,703.12
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	110.65	146,389.95
LAGADERE S.C.A	9,057	26.65	241,369.05
NUMERICABLE-SFR	7,526	40.16	302,244.16
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,172	48.10	777,954.06
PUBLICIS GROUPE	13,383	59.37	794,548.71
RELX NV	71,956	15.55	1,118,915.80
RTL GROUP	2,486	78.54	195,270.32
SES	22,954	25.89	594,393.83
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	49.99	160,983.90
VIVENDI	83,735	21.61	1,809,932.02
WOLTERS KLUWER	22,399	31.95	715,648.05
INDITEX	78,610	32.93	2,589,020.35

CARREFOUR	38,705	29.91	1,157,666.55
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	54.69	201,642.03
COLRUYT SA	4,415	44.33	195,716.95
DELHAIZE GROUP	7,450	88.29	657,760.50
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.85	270,721.61
JERONIMO MARTINS	20,234	12.96	262,232.64
KONINKLIJKE AHOLD NV	62,997	19.06	1,200,722.82
METRO STAMM	13,712	27.97	383,593.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV	57,541	110.95	6,384,173.95
DANONE (GROUPE)	41,751	63.46	2,649,518.46
HEINEKEN HOLDING NV	7,613	71.78	546,461.14
HEINEKEN NV	16,177	82.17	1,329,264.09
KERRY GROUP PLC-A	11,778	71.36	840,478.08
PERNOD-RICARD	14,803	106.10	1,570,598.30
REMY COINTREAU	1,575	62.01	97,665.75
BEIERSDORF AG	7,534	86.56	652,143.04
HENKEL AG & CO KGAA	7,463	82.61	616,518.43
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,471	95.75	1,194,098.25
LOREAL	18,113	164.70	2,983,211.10
UNILEVER NV-CVA	116,743	40.60	4,740,349.51
ESSILOR INTERNATIONAL	14,283	120.00	1,713,960.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,305	79.60	1,218,278.00
FRESENIUS SE&CO KGAA	26,443	66.73	1,764,541.39
BAYER	59,112	120.75	7,137,774.00
GRIFOLS SA	11,364	43.50	494,390.82
MERCK KGAA	9,216	89.09	821,053.44
ORION OYJ-CLASS B	7,975	32.42	258,549.50
QIAGEN N.V.	14,956	23.07	345,034.92
SANOFI	84,117	84.14	7,077,604.38
UCB (GROUPE)	9,374	80.77	757,137.98
BANCO BILBAO VIZCAYA	463,581	7.87	3,650,700.37
BANCO DE SABADELL SA	352,757	1.78	630,024.00
BANCO SANTANDER SA	1,044,045	5.19	5,421,725.68
BANKINTER SA	46,530	6.73	313,426.08
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.04	116,389.47
BNP PARIBAS	77,319	57.05	4,411,048.95
CAIXABANK	184,750	3.51	649,581.00
COMMERZBANK AG	77,118	10.59	816,679.62
CREDIT AGRICOLE SA	74,240	11.00	816,640.00
ERSTE GROUP BANK AG	20,524	28.06	575,903.44
ING GROEP NV-CVA	282,592	13.56	3,831,947.52
INTESA SANPAOLO	928,149	3.11	2,893,968.58

INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.85	185,770.00
KBC GROEP NV	17,988	55.53	998,873.64
NATIXIS	69,996	5.81	406,816.75
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	14.29	131,425.13
SOCIETE GENERALE	53,264	44.95	2,394,216.80
UNICREDIT SPA	351,961	5.83	2,053,692.43
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,534	6.56	429,903.04
DEUTSCHE BANK NAMEN	101,094	25.33	2,561,216.49
DEUTSCHE BOERSE	13,777	81.96	1,129,162.92
EURAZEO	2,763	64.28	177,605.64
EXOR SPA	7,381	44.46	328,159.26
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	74.78	467,150.66
MEDIOBANCA	41,923	9.13	382,756.99
WENDEL	1,898	109.15	207,166.70
AEGON	131,858	5.82	767,413.56
AGEAS	13,863	39.63	549,390.69
ALLIANZ SE-REG	33,348	156.65	5,223,964.20
ASSICURAZIONI GENERALI	86,452	17.31	1,496,484.12
AXA	143,565	24.48	3,514,471.20
CNP ASSURANCES	11,830	12.76	151,009.95
DELTA LLOYD NV	13,360	7.45	99,652.24
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,957	102.35	404,998.95
MAPFRE SA	90,939	2.48	226,074.35
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,261	178.60	2,189,814.60
NN GROUP NV	15,034	29.82	448,389.05
SAMPO OYJ-A SHS	31,815	44.30	1,409,404.50
SCOR SE	10,368	35.45	367,597.44
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	2.29	217,733.20
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	25,500	23.90	609,450.00
VONOVIA SE	33,154	28.68	951,022.49
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	32,922	37.43	1,232,270.46
ATOS SE	6,536	75.44	493,075.84
CAP GEMINI SA	11,005	80.98	891,184.90
DASSAULT SYSTEMES SA	9,516	73.02	694,858.32
GEMALTO	6,158	60.37	371,758.46
SAP SE	70,432	72.93	5,136,605.76
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,947	46.77	371,720.92
ALCATEL-LUCENT	209,497	3.78	791,898.66
INGENICO GROUP	3,848	110.15	423,857.20
NOKIA OYJ	256,784	6.90	1,773,093.52
DEUTSCHE TELEKOM	227,738	16.37	3,728,071.06
ELISA A	10,064	34.17	343,886.88

	ILIAD SA	1,701	191.85	326,336.85
	KPN (KON.)	228,559	3.18	726,817.62
	ORANGE	143,323	16.10	2,308,216.91
	PROXIMUS	10,096	30.30	305,959.28
	TELECOM ITALIA ORD	744,942	1.14	855,938.35
	TELECOM ITALIA RNC	412,771	1.01	418,962.56
	TELEFONICA	318,679	11.94	3,805,027.26
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	5.53	207,962.18
	E.ON SE	139,487	9.46	1,319,547.02
	ELECTRICITE DE FRANCE	15,766	15.74	248,235.67
	ENAGAS	15,285	26.91	411,395.77
	ENDESA	24,774	19.94	494,117.43
	ENEL	508,928	4.07	2,074,390.52
	ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.92	237,333.27
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	159,451	3.25	518,215.75
	ENGIE	101,605	15.90	1,616,027.52
	FORTUM OYJ	33,469	13.74	459,864.06
	GAS NATURAL SDG SA	26,546	19.82	526,141.72
	IBERDROLA SA	389,295	6.45	2,510,952.75
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,102	79.93	647,592.86
	RWE STAMM	36,844	12.86	473,998.06
	SNAM SPA	150,885	4.76	718,212.60
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	17.31	359,632.55
	TERNA SPA	113,720	4.56	519,018.08
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,358	21.72	724,702.55
	ASML HOLDING NV	25,001	88.70	2,217,588.70
	INFINEON TECHNOLOGIES	80,647	11.30	911,714.33
	STMICROELECTRONICS	42,509	6.65	282,769.86
	ユーロ 小計	15,880,040		247,259,631.31 (32,752,010,763)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	26,190	5.14	134,616.60
	BG GROUP	244,857	10.10	2,473,055.70
	BP PLC	1,305,121	3.82	4,993,392.94
	PETROFAC LTD	16,711	7.74	129,343.14
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	278,357	17.00	4,733,460.78
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	174,787	17.07	2,983,614.09
	TULLOW OIL PLC	67,219	2.28	153,326.53
	ANGLO AMERICAN PLC	98,685	5.16	509,214.60
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	5.09	129,504.71
	BHP BILLITTON PLC	151,979	9.52	1,447,447.99
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	28.01	242,706.65
	FRESNILLO PLC	17,743	7.01	124,467.14



GLENCORE PLC	772,635	1.09	847,580.59
JOHNSON MATTHEY PLC	15,209	25.78	392,088.02
MONDI PLC	27,264	14.83	404,325.12
RANDGOLD RESOURCES LTD	5,987	39.33	235,468.71
REXAM PLC	44,988	5.48	246,534.24
RIO TINTO PLC REG	90,790	22.91	2,079,998.90
ASHTED GROUP PLC	32,745	10.16	332,689.20
BAE SYSTEMS PLC	220,702	4.41	973,737.22
BUNZL PLC	24,824	18.63	462,471.12
COBHAM PLC	72,398	2.73	198,298.12
IMI PLC	17,506	9.98	174,709.88
MEGGITT PLC	50,990	3.84	195,852.59
MELROSE INDUSTRIES PLC	64,431	2.71	175,123.45
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	128,458	6.98	897,279.13
SMITHS GROUP PLC	29,684	9.94	295,207.38
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	19.91	369,430.05
WEIR GROUP PLC/THE	13,390	11.53	154,386.70
WOLSELEY LTD	18,291	38.05	695,972.55
AGGREKO PLC	19,830	9.65	191,359.50
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	9.63	189,742.05
CAPITA GROUP PLC	47,099	12.65	595,802.35
EXPERIAN PLC	69,123	11.04	763,117.92
G4S PLC	100,693	2.42	244,482.60
INTERTEK GROUP PLC	10,210	25.61	261,478.10
EASYJET PLC	11,633	17.84	207,532.72
ROYAL MAIL PLC	60,548	4.43	268,772.57
NEW GKN	123,433	2.91	359,807.19
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,214	5.71	418,051.94
BURBERRY GROUP PLC	32,866	13.74	451,578.84
PERSIMMON PLC	22,640	18.59	420,877.60
TAYLOR WIMPAY PLC	233,248	1.78	416,580.92
CARNIVAL PLC	13,621	35.29	480,685.09
COMPASS GROUP PLC	115,480	10.58	1,221,778.40
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,502	26.40	462,052.80
MERLIN ENTERTAINME	48,554	4.07	197,760.44
TUI AG-DI	35,476	11.51	408,328.76
WHITBREAD PLC	12,809	46.78	599,205.02
WILLIAM HILL	55,917	3.33	186,706.86
ITV PLC	269,479	2.56	692,022.07
PEARSON	57,783	8.21	474,687.34
RELX PLC	78,856	11.55	910,786.80
SKY PLC	72,378	10.74	777,339.72

WPP PLC	90,562	14.90	1,349,373.80
DIXONS CARPHONE PLC	66,738	4.64	309,664.32
KINGFISHER PLC	165,161	3.54	584,669.94
MARKS & SPENCER GROUP PLC	116,812	5.37	627,280.44
NEXT PLC	10,193	78.70	802,189.10
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,094	6.91	125,120.01
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	1.63	275,388.75
SAINSBURY (J) PLC	86,863	2.73	237,396.57
TESCO	566,424	1.78	1,011,350.05
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,939	34.09	850,170.51
BRITISH AMERICAN TOBACCO	133,236	37.73	5,026,994.28
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	15.14	211,944.86
DIAGEO	180,026	18.65	3,358,385.03
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	68,673	34.54	2,371,965.42
SABMILLER PLC	69,637	39.65	2,761,107.05
TATE & LYLE	29,189	6.16	179,804.24
RECKITT BENCKISER PLC	46,035	61.86	2,847,725.10
UNILEVER PLC	92,030	28.17	2,592,485.10
SMITH & NEPHEW PLC	62,775	10.92	685,503.00
ASTRAZENECA	90,369	41.58	3,757,994.86
GLAXOSMITHKLINE	347,785	13.67	4,755,959.87
SHIRE PLC	42,481	46.90	1,992,358.90
BARCLAYS	1,221,961	2.34	2,859,999.72
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,419,653	5.27	7,490,089.22
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,165,025	0.73	3,040,468.25
ROYAL BANK OF SCOTLAND	229,139	3.19	732,328.24
STANDARD CHARTERED PLC	187,165	6.11	1,144,888.30
3I GROUP PLC	74,066	4.94	365,960.10
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	58,338	3.53	206,458.18
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	14.38	294,344.22
ICAP PLC	43,892	4.74	208,091.97
INVESTEC PLC	36,474	5.32	194,041.68
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	23,357	25.83	603,311.31
SCHRODERS PLC	7,932	30.16	239,229.12
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	16.40	266,582.00
AVIVA PIC	297,285	4.86	1,445,399.67
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	94,822	3.94	373,977.96
LEGAL & GENERAL GROUP	421,591	2.66	1,125,226.37
OLD MUTUAL PLC	352,004	2.01	709,640.06
PRUDENTIAL	187,754	15.50	2,910,187.00
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	70,206	4.30	301,956.00
ST JAMES'S PLACE PLC	37,294	9.54	355,784.76

	STANDARD LIFE PLC	141,626	4.14	587,039.77
	SAGE GROUP PLC	80,156	5.42	434,445.52
	BT GROUP PLC	599,623	4.60	2,761,263.91
	INMARSAT PLC	33,632	10.14	341,028.48
	VODAFONE GROUP PLC	1,895,378	2.14	4,064,638.12
	CENTRICA PLC	347,128	2.16	751,532.12
	NATIONAL GRID PLC	268,349	8.96	2,404,407.04
	SEVERN TRENT PLC	15,457	21.28	328,924.96
	SSE PLC	69,212	14.69	1,016,724.28
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,451	9.36	472,221.36
	ARM HOLDINGS PLC	98,798	10.58	1,045,282.84
	イギリスポンド 小計	20,721,302		114,176,145.17 (21,268,732,322)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	22,796	15.17	345,815.32
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	409.00	195,093.00
	GIVAUDAN-REG	651	1,794.00	1,167,894.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	28,448	57.30	1,630,070.40
	SIKA AG-BR	138	3,316.00	457,608.00
	SYNGENTA AG	6,705	346.10	2,320,600.50
	ABB LTD	158,155	19.04	3,011,271.20
	GEBERIT AG-REG	2,683	327.00	877,341.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	163.50	221,052.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,860	164.00	469,040.00
	SULZER AG-REG	1,607	103.10	165,681.70
	ADECCO	12,082	67.25	812,514.50
	SGS SA	406	1,911.00	775,866.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,072	136.20	554,606.40
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	37,577	80.15	3,011,796.55
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,199	375.60	825,944.40
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	70.70	278,416.60
	DUFREY AG-REG	2,999	129.50	388,370.50
	ARYZTA AG	5,619	46.35	260,440.65
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,036.00	136,752.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	62	5,965.00	369,830.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	72,655.00	508,585.00
	NESTLE SA - REGISTERED	230,102	74.80	17,211,629.60
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,452	134.40	463,948.80
	ACTELION LTD-REG	7,281	137.00	997,497.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,988	146.10	582,646.80
	NOVARTIS	162,383	88.70	14,403,372.10
	ROCHE HOLDING GENUSS	50,151	266.70	13,375,271.70
	CREDIT SUISSE GROUP AG	114,059	24.27	2,768,211.93

	JULIUS BAER GROUP LTD	16,269	47.50	772,777.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	63.45	120,301.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,221	363.25	443,528.25	
	UBS GROUP AG	266,462	19.69	5,246,636.78	
	BALOISE HOLDING AG	3,877	118.50	459,424.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,458	238.30	585,741.40	
	SWISS RE LTD	25,911	93.65	2,426,565.15	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,018	263.20	2,899,937.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,038	73.65	371,048.70	
	SWISSCOM	1,834	507.00	929,838.00	
	スイスフラン 小計	1,202,365		82,842,966.73 (10,178,915,322)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	125.50	1,780,970.50	
	BOLIDEN AB	18,196	162.30	2,953,210.80	
	ALFA LAVAL AB	19,284	155.60	3,000,590.40	
	ASSA ABLOY AB-B	70,136	172.50	12,098,460.00	
	ATLAS COPCO A	47,043	227.70	10,711,691.10	
	ATLAS COPCO B	29,087	208.50	6,064,639.50	
	SANDVIK AB	79,113	82.60	6,534,733.80	
	SKANSKA B	28,530	167.70	4,784,481.00	
	SKF AB-B	27,040	154.30	4,172,272.00	
	VOLVO B	107,905	91.95	9,921,864.75	
	SECURITAS B	22,844	123.30	2,816,665.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	242.10	4,398,957.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	56.75	1,575,266.50	
	HENNES & MAURITZ B	68,398	329.60	22,543,980.80	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	297.60	1,705,248.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,410	279.50	3,468,595.00	
	SCA SV CELLULOSA B	41,445	249.40	10,336,383.00	
	GETINGE AB-B SHS	12,725	216.00	2,748,600.00	
	NORDEA BANK AB	222,952	95.00	21,180,440.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	108,437	91.20	9,889,454.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	106,324	118.80	12,631,291.20	
	SWEDBANK AB-A	64,426	192.50	12,402,005.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	154.90	1,981,480.80	
	INVESTOR AB-B SHS	32,558	322.00	10,483,676.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	18,104	266.80	4,830,147.20	
	ERICSSON (LM) B	219,832	86.90	19,103,400.80	
	HEXAGON AB-B SHS	18,602	306.90	5,708,953.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	470.00	2,034,630.00	
	TELE2 AB-B SHS	21,310	85.95	1,831,594.50	
	TELIASONERA AB	182,966	41.98	7,680,912.68	

	スウェーデンクローナ 小計	1,662,637		221,374,595.73 (3,139,091,767)
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	23,438	58.80	1,378,154.40
	STATOIL ASA	78,540	141.20	11,089,848.00
	SUBSEA 7 SA	18,360	71.60	1,314,576.00
	NORSK HYDRO	83,896	32.26	2,706,484.96
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	389.40	5,245,218.00
	ORKLA	60,218	69.70	4,197,194.60
	DNB ASA	70,441	114.60	8,072,538.60
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	131.50	1,772,751.50
	TELENOR ASA	53,105	154.80	8,220,654.00
	ノルウェークローネ 小計	414,949		43,997,420.06 (625,643,313)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	17,281	322.10	5,566,210.10
	VESTAS WIND SYSEMS	15,987	419.70	6,709,743.90
	ISS A/S	9,103	245.50	2,234,786.50
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	245	10,090.00	2,472,050.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	10,360.00	5,262,880.00
	DSV A/S	11,156	281.70	3,142,645.20
	PANDORA A/S	8,093	795.00	6,433,935.00
	CARLSBERG AS-B	8,005	551.00	4,410,755.00
	COLOPLAST-B	8,335	536.50	4,471,727.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	628.50	932,694.00
	NOVO NORDISK A/S-B	140,075	375.10	52,542,132.50
	DANSKE BANK A/S	50,272	187.10	9,405,891.20
	TRYG A/S	9,828	127.50	1,253,070.00
	TDC A/S	52,498	37.65	1,976,549.70
	デンマーククローネ 小計	332,870		106,815,070.60 (1,897,035,653)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	31.63	652,495.27
	ORIGIN ENERGY LIMITED	84,565	5.11	432,127.15
	SANTOS	60,506	5.91	357,590.46
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	53,718	29.23	1,570,177.14
	WORLEYPARSONS LTD	15,026	6.28	94,363.28
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.19	202,845.02
	AMCOR	88,019	13.48	1,186,496.12
	BHP BILLITON LTD	230,444	21.42	4,936,110.48
	BORAL LIMITED	46,867	5.51	258,237.17
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,478	2.20	199,051.60
	ILUKA RESOURCES LTD	28,555	6.33	180,753.15
	INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.79	417,612.52
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	17.60	518,284.80

NEWCREST MINING LIMITED	58,258	11.29	657,732.82
ORICA LTD	29,211	16.52	482,565.72
RIO TINTO LTD	31,029	49.00	1,520,421.00
SOUTH32 LTD	354,855	1.43	507,442.65
CIMIC GROUP LIMITED	5,336	27.27	145,512.72
BRAMBLES LTD	116,593	10.74	1,252,208.82
SEEK LTD	21,328	13.36	284,942.08
ASCIANO GROUP	64,054	8.73	559,191.42
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.10	813,383.70
QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	3.71	126,715.05
TRANSURBAN GROUP	140,834	10.18	1,433,690.12
ARISTOCRAT LEISURE LTD	32,069	9.33	299,203.77
CROWN RESORTS LTD	21,269	11.75	249,910.75
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	37.44	122,166.72
TABCORP HOLDINGS	62,731	4.57	286,680.67
TATTS GROUP LTD	93,361	3.85	359,439.85
REA GROUP LTD	3,593	48.88	175,625.84
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.91	120,474.92
WESFARMERS LTD	79,463	38.72	3,076,807.36
WOOLWORTHS LTD	90,378	23.50	2,123,883.00
COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	9.15	347,736.60
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	7.14	275,261.28
COCHLEAR LIMITED	3,856	88.30	340,484.80
HEALTHSCOPE LTD	88,599	2.73	241,875.27
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,773	63.25	681,392.25
SONIC HEALTHCARE LTD	24,730	19.79	489,406.70
CSL LIMITED	33,087	95.50	3,159,808.50
AUST AND NZ BANKING GROUP	198,527	25.36	5,034,644.72
BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	13.01	317,144.77
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	10.56	329,524.80
COMMONWEALTH BANK OF AUST	121,510	75.58	9,183,725.80
NATIONAL AUSTRALIA BANK	187,643	28.08	5,269,015.44
WESTPAC BANKING	223,581	31.29	6,995,849.49
ASX LTD	12,620	40.63	512,750.60
MACQUARIE GROUP LIMITED	21,772	80.30	1,748,291.60
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	7.52	152,107.04
AMP LTD	217,702	5.84	1,271,379.68
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	175,295	5.52	967,628.40
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.35	504,103.20
QBE INSURANCE GROUP	100,546	13.50	1,357,371.00
SUNCORP GROUP LIMITED	95,154	12.87	1,224,631.98
COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	10.81	333,131.77

	TELSTRA CORP	308,815	5.22	1,612,014.30	
	TPG TELECOM LTD	20,000	10.95	219,000.00	
	AGL ENERGY LTD	50,606	16.59	839,553.54	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.45	174,333.50	
	オーストラリアドル 小計	4,873,720		69,186,310.17 (6,006,755,448)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	7.63	355,176.50	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,160	5.33	325,982.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	7.79	171,504.64	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.30	480,708.94	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	5.11	301,300.93	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.22	245,407.68	
	MIGHTY RIVER POWER	61,741	2.77	171,331.27	
	ニュージーランドドル 小計	506,423		2,051,412.76 (164,974,614)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	194,496	103.30	20,091,436.80	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	11.50	1,138,500.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	15.22	1,308,920.00	
	MTR CORP	94,000	35.75	3,360,500.00	
	LI & FUNG	378,800	6.11	2,314,468.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	30.60	2,861,100.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	29.00	1,348,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	26.45	4,655,200.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.06	810,432.00	
	SANDS CHINA LTD	174,000	28.55	4,967,700.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	7.55	739,900.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.38	842,160.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	11.36	1,167,808.00	
	WH GROUP LTD	476,500	4.16	1,982,240.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	29.00	2,458,040.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	262,500	25.15	6,601,875.00	
	HANG SENG BANK	54,100	142.60	7,714,660.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.30	678,400.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,300	212.60	17,284,380.00	
	AIA GROUP LTD	863,200	48.30	41,692,560.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	188,996	51.30	9,695,494.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.64	3,224,720.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	86,360	48.40	4,179,824.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	33.20	1,328,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	38,500	22.55	868,175.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	399,500	8.03	3,207,985.00		
SINO LAND CO	235,400	11.50	2,707,100.00		

	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,000	98.20	11,784,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	88.15	3,570,075.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,200	22.50	1,557,000.00	
	WHARF HOLDINGS	99,000	45.75	4,529,250.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	35.45	2,304,250.00	
	PCCW LTD	232,000	4.27	990,640.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	70.25	2,880,250.00	
	CLP HOLDINGS	133,000	66.15	8,797,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	491,679	15.72	7,729,193.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	98,500	74.90	7,377,650.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	59.50	821,100.00	
	香港ドル 小計	6,258,091		201,571,437.48 (3,202,970,141)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	7.07	793,961.00	
	NOBLE GROUP LTD	297,563	0.52	154,732.76	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.51	200,070.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	2.30	140,070.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.15	343,350.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.20	159,600.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	3.08	446,600.00	
	SINGAPORE AIRLINES	32,833	10.88	357,223.04	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.85	361,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	97,700	4.02	392,754.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	33.70	202,200.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.38	159,220.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	116,700	3.07	358,269.00	
	DBS GROUP	128,600	17.46	2,245,356.00	
	OCBC BANK	220,100	9.11	2,005,111.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	90,900	20.51	1,864,359.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	7.64	420,200.00	
	CAPITALAND LTD	205,500	3.14	645,270.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	7.90	189,600.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	2.20	547,800.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	6.51	211,575.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	582,643	3.87	2,254,828.41	
	STARHUB LTD	38,000	3.63	137,940.00	
	シンガポールドル 小計	3,638,239		14,591,339.21 (1,264,193,629)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	435	934.50	406,507.50	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	20.22	662,326.32	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	953.30	153,481.30	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	59,539	235.60	14,027,388.40	



BANK HAPOALIM BM	80,056	20.23	1,619,532.88
BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,989	14.55	1,382,089.95
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	47.00	385,400.00
AZRIELI GROUP	1,780	146.90	261,482.00
NICE SYSTEMS LTD	3,358	244.40	820,695.20
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	8.16	911,929.97
イスラエルシェケル 小計	392,907		20,630,833.52 (649,252,330)
合 計	81,335,431		255,636,705,697 (255,636,705,697)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	329,000	180,950.00	
		アメリカドル 小計	329,000	180,950.00 (22,293,040)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	74,495	664,495.40	
		LEND LEASE GROUP	44,009	538,670.16	
		SYDNEY AIRPORT	70,759	436,583.03	
	オーストラリアドル 小計	189,263	1,639,748.59 (142,362,972)		
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,748,450.00	
香港ドル 小計	187,000	1,748,450.00 (27,782,870)			
投資信託受益証券合計			705,263	192,438,882 (192,438,882)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,115	409,828.95	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	30,408	2,952,920.88	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70,023	665,918.73	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,140	1,555,719.40	
		BOSTON PROPERTIES	10,612	1,301,880.16	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,835	316,254.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,979	439,815.24	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	7,973	161,373.52	
		CROWN CASTLE INTL CORP	24,087	2,021,862.78	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,665	694,623.55	
		DUKE REALTY CORP	26,052	515,829.60	
		EQUINIX INC	3,960	1,157,904.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	26,298	2,003,907.60	

	ESSEX PROPERTY TRUST	4,774	1,032,091.06	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,671	584,990.46	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,879	696,721.20	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	40,144	1,069,034.72	
	HCP INC	31,928	1,055,539.68	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	52,693	903,158.02	
	IRON MOUNTAIN INC	14,074	421,657.04	
	KIMCO REALTY CORP	29,179	744,648.08	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	9,708	317,839.92	
	MACERICH CO/THE	9,059	703,703.12	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,594	547,932.44	
	PROLOGIS INC	36,172	1,477,987.92	
	PUBLIC STORAGE	10,592	2,405,549.12	
	REALTY INCOME CORP	16,219	752,399.41	
	REGENCY CENTERS CORP	6,051	392,467.86	
	SIMON PROPERTY GROUP	22,304	4,271,439.04	
	SL GREEN REALTY CORP	7,346	842,953.50	
	UDR INC	18,412	621,773.24	
	VENTAS INC	22,897	1,139,583.69	
	VEREIT INC	67,784	545,661.20	
	VORNADO REALTY TRUST	11,805	1,121,475.00	
	WELLTOWER INC	25,401	1,498,913.01	
	アメリカドル 小計	720,833	37,345,357.54 (4,600,948,048)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	198,460.45	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	261,865.34	
	カナダドル 小計	19,938	460,325.79 (42,718,233)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	186,324.60	
	GECINA SA	2,522	286,373.10	
	ICADE	2,845	180,657.50	
	KLEPIERRE	13,726	566,540.65	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,974	1,681,431.40	
	ユーロ 小計	28,377	2,901,327.25 (384,309,807)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	66,079	543,499.77	
	HAMMERSON PLC	51,215	304,473.17	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	238,545.29	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,520	722,325.60	
	SEGRO PLC	48,938	207,986.50	
	イギリスポンド 小計	296,241	2,016,830.33 (375,695,153)	

オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	561,602.20	
	GOODMAN GROUP	119,536	717,216.00	
	GPT GROUP	136,015	622,948.70	
	MIRVAC GROUP	241,410	429,709.80	
	SCENTRE GROUP	389,348	1,565,178.96	
	STOCKLAND	150,322	587,759.02	
	VICINITY CENTERS	254,887	723,879.08	
	WESTFIELD CORP	144,920	1,426,012.80	
オーストラリアドル 小計		1,510,528	6,634,306.56	(575,990,495)
香港ドル	LINK REIT	163,000	7,392,050.00	
香港ドル 小計		163,000	7,392,050.00	(117,459,674)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,300	313,941.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	191,620.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	141,000	274,245.00	
	SUNTEC REIT	173,000	275,070.00	
シンガポールドル 小計		595,300	1,054,876.00	(91,394,456)
投資証券合計		3,334,217	6,188,515,866	(6,188,515,866)
合計			6,380,954,748	(6,380,954,748)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 601銘柄	97.3%			63.1%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			2.7%	1.8%
カナダドル	株式 89銘柄	99.5%			3.5%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	98.8%			12.5%
	投資証券 5銘柄			1.2%	0.1%
イギリスポンド	株式 107銘柄	98.3%			8.1%
	投資証券 5銘柄			1.7%	0.1%

スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%			3.9%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式	14銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式	59銘柄	89.3%			2.3%
	投資信託受益証券	3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券	8銘柄			8.6%	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	38銘柄	95.7%			1.2%
	投資信託受益証券	1銘柄		0.8%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	23銘柄	93.3%			0.5%
	投資証券	4銘柄			6.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	100.0%			0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成27年11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	383,645,809
投資証券	61,495,622,600
派生商品評価勘定	58,221,200
未収入金	32,848,588
未収配当金	440,442,273
未収利息	618
差入委託証拠金	29,755,200
流動資産合計	62,440,536,288
資産合計	62,440,536,288
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	58,221,200

	平成27年11月10日現在
項目	金額（円）
未払金	61,712,845
未払解約金	40,225,864
流動負債合計	160,159,909
負債合計	160,159,909
純資産の部	
元本等	
元本	43,171,789,610
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,108,586,769
元本等合計	62,280,376,379
純資産合計	62,280,376,379
負債純資産合計	62,440,536,288

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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>不動産投信指数先物取引</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>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 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）

	平成27年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,171,789,610口

		平成27年11月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,4426円 (14,426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

		平成27年11月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。		
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コンプライアンス・リスク統括部が、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

		平成27年11月10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		

	平成27年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	28,149,357,979円
期中追加設定元本額	20,011,593,369円
期中一部解約元本額	4,989,161,738円
期末元本額	43,171,789,610円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,435,621,009円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,015,801円
SMT J-REITインデックス・オープン	8,558,259,462円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,819,219,332円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,307,456,030円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,105,317,371円
分散投資コア戦略ファンドA	352,829,475円
分散投資コア戦略ファンドS	920,547,629円

区分	平成27年11月10日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	440,958,423円
J-REITインデックス・オープン	361,941,701円
SMT インデックスバランス・オープン	25,871,645円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,158,097,361円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	671,654,371円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		1,332,194,666
合計		1,332,194,666

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（平成27年11月10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	不動産投信指数先物取引 買建	711,184,800	-	769,406,000	58,221,200
	合計	711,184,800	-	769,406,000	58,221,200

## (注)1.時価の算定方法

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

## 2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

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



投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,897	1,218,188,500	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	1,590	561,270,000	
	森ヒルズリート投資法人	9,387	1,393,969,500	
	産業ファンド投資法人	2,108	1,157,292,000	
	大和ハウスリート投資法人	2,097	1,030,675,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	7,772	2,075,124,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	2,087	625,682,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,314	1,648,715,000	
	G L P 投資法人	15,507	1,840,680,900	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,833	651,306,700	
	日本プロロジスリート投資法人	10,347	2,267,027,700	
	星野リゾート・リート投資法人	458	544,562,000	
	S I A 不動産投資法人	449	210,805,500	
	イオンリート投資法人	6,518	934,681,200	
	ヒューリックリート投資法人	4,669	755,911,100	
	日本リート投資法人	2,342	673,325,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	3,241	315,673,400	
	日本ヘルスケア投資法人	363	73,943,100	
	積水ハウス・リート投資法人	4,747	598,122,000	
	トーセイ・リート投資法人	574	65,321,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	2,124	493,192,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	720	80,208,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	977	84,803,600	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	507	77,216,100	
	野村不動産マスターファンド投資法人	22,252	3,435,708,800	
	日本ビルファンド投資法人	8,442	4,668,426,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	7,828	4,211,464,000	
	日本リテールファンド投資法人	15,258	3,510,865,800	
	オリックス不動産投資法人	13,874	2,214,290,400	
	日本プライムリアルティ投資法人	5,219	2,043,238,500	
	プレミア投資法人	7,874	912,596,600	
	東急リアル・エステート投資法人	5,845	855,123,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,159	460,123,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	16,449	2,704,215,600	
	森トラスト総合リート投資法人	7,892	1,676,260,800	
	インヴィンシブル投資法人	19,094	1,336,580,000	
	フロンティア不動産投資法人	2,965	1,438,025,000	
	平和不動産リート投資法人	5,686	504,348,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,261	1,198,981,900	
	福岡リート投資法人	4,466	870,423,400	
	ケネディクス・オフィス投資法人	2,421	1,290,393,000	
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	6,087	679,917,900	

いちごオフィスリート投資法人	8,468	709,618,400	
大和証券オフィス投資法人	2,894	1,750,870,000	
阪急リート投資法人	3,572	463,288,400	
スタートプロシード投資法人	1,039	174,344,200	
トップリート投資法人	1,052	481,816,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4,470	1,102,749,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	18,797	1,642,857,800	
日本賃貸住宅投資法人	9,805	790,283,000	
ジャパンエクセレント投資法人	7,560	991,116,000	
合計	303,357	61,495,622,600	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成27年11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	220,727,115
コール・ローン	31,753,229
投資証券	58,432,657,617
派生商品評価勘定	10,170
未収入金	1,838,664
未収配当金	141,282,002
未収利息	51
流動資産合計	58,828,268,848
資産合計	58,828,268,848
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,280
未払金	4,408,868
未払解約金	64,531,975
流動負債合計	68,975,123
負債合計	68,975,123
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	35,750,137,723
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	23,009,156,002
元本等合計	58,759,293,725

	平成27年11月10日現在
項目	金額（円）
純資産合計	58,759,293,725
負債純資産合計	58,828,268,848

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成27年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,750,137,723口

		平成27年11月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6436円 (16,436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

		平成27年11月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

		平成27年11月10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。		

	平成27年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	25,420,341,407円
期中追加設定元本額	13,467,952,934円
期中一部解約元本額	3,138,156,618円
期末元本額	35,750,137,723円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	253,451,692円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,346,301,836円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,529,698円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,004,991,752円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	17,779,893,968円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,306,113,497円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,098,084,473円

区分	平成27年11月10日現在
分散投資コア戦略ファンドA	206,310,872円
分散投資コア戦略ファンドS	533,957,537円
コア投資戦略ファンド（切替型）	249,996,411円
グローバルREITインデックス・オープン	43,846,976円
SMT インデックスバランス・オープン	125,099,469円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,244,375,359円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	143,881,124円
F O F s 用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	401,303,059円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	617,717,874	
合計	617,717,874	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成27年11月10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	5,587,530	-	5,588,100	570
	イギリスポンド	5,587,530	-	5,588,100	570
	売建	34,822,120	-	34,846,800	24,680
	アメリカドル	9,864,800	-	9,855,200	9,600
	ユーロ	10,587,840	-	10,596,800	8,960
	イギリスポンド	7,428,680	-	7,450,800	22,120
	オーストラリアドル	6,940,800	-	6,944,000	3,200
合計		40,409,650	-	40,434,900	24,110

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	33,170	1,059,449.80	
		AGREE REALTY CORP	8,660	278,419.00	
		ALEXANDER'S INC	1,860	734,718.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	35,410	3,101,916.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,810	697,617.70	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	56,070	2,183,365.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	78,610	1,282,129.10	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	15,190	225,875.30	
		APARTMENT INVEST & MGMT	77,680	2,813,569.60	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	76,000	1,556,480.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	8,370	88,387.20	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	9,433	137,910.46	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	298,734.70	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	65,190	11,095,989.90	
		BIOMED REALTY TRUST INC	98,230	2,289,741.30	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	104,220.00	
		BOSTON PROPERTIES	74,910	9,189,958.80	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	85,540	1,092,345.80	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	85,000	2,094,400.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	42,910	3,156,459.60	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	41,690	275,154.00	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	42,195	1,279,774.35	
		CARETRUST REIT INC	21,746	230,942.52	
		CBL & ASSOCIATES PRYS	74,960	1,009,711.20	
		CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	222,372.00	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	123,160	869,509.60	
CHATHAM LODGING TRUST	18,110	403,853.00			
CHESAPEAKE LODGING TRUST	28,200	777,474.00			

CITY OFFICE REIT INC	8,000	88,080.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	63,210	1,512,615.30	
CORESITE REALTY CORP	13,020	720,657.00	
CORPORATE OFFICE PPTYS	47,640	1,033,311.60	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	59,430	1,602,827.10	
COUSINS PROPERTIES INC	96,810	943,897.50	
CUBESMART	80,200	2,164,598.00	
CYRUSONE INC	33,840	1,156,989.60	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	42,147	1,532,043.45	
DDR CORPORATION	148,160	2,407,600.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	95,700	1,093,851.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	66,730	4,795,885.10	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	67,580	2,042,943.40	
DUKE REALTY CORP	166,070	3,288,186.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	31,220	1,009,967.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5,000	84,350.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	16,180	872,749.20	
EDUCATION REALTY TRUST INC	24,756	852,101.52	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	52,570	919,975.00	
EPR PROPERTIES	27,700	1,513,805.00	
EQUITY COMMONWEALTH	63,470	1,722,575.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	39,830	2,335,631.20	
EQUITY ONE INC	37,750	967,532.50	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	177,200	13,502,640.00	
ESSEX PROPERTY TRUST	31,860	6,887,813.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	59,730	4,555,009.80	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,160	4,878,048.00	
FELCOR LODGING TRUST INC	64,920	525,202.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	53,470	1,150,139.70	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	26,460	302,967.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	44,030	445,583.60	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	44,080	1,267,300.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	287,480	7,655,592.40	
GEO GROUP INC/THE	38,400	1,162,368.00	
GETTY REALTY CORP	13,060	213,531.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,150	156,513.00	
GLOBAL NET LEASE INC	81,000	707,130.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	33,380	523,732.20	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	29,350	663,310.00	
HCP INC	225,670	7,460,650.20	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	47,360	1,199,155.20	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	64,290	1,558,389.60	



HERSHA HOSPITALITY TRUST	23,920	581,973.60	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	47,360	1,976,806.40	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	74,100	1,992,549.00	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	369,970	6,341,285.80	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	34,600	970,184.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	10,525	83,252.75	
INLAND REAL ESTATE CORP	37,640	325,586.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	504,731.00	
IRON MOUNTAIN INC	95,550	2,862,678.00	
KILROY REALTY CORPORATION	44,710	2,809,129.30	
KIMCO REALTY CORP	202,640	5,171,372.80	
KITE REALTY GROUP TRUST	39,340	1,011,431.40	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	55,810	1,654,766.50	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	100,610	851,160.60	
LIBERTY PROPERTY TRUST	73,920	2,420,140.80	
LTC PROPERTIES INC	16,890	690,463.20	
MACERICH CO/THE	65,020	5,050,753.60	
MACK-CALI REALTY CORP	44,340	957,744.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	114,010	1,223,327.30	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,610	3,028,379.20	
MONMOUTH REIT -CL A	26,640	270,662.40	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	83,560	800,504.80	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	64,390	2,314,820.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,000	145,800.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	16,120	920,452.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	380,800.00	
NEW YORK REIT INC	77,160	858,019.20	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	127,900.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	343,480.62	
NORTHSTAR REALTY FINANCE	89,840	1,682,703.20	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	79,406	2,547,344.48	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,700	106,972.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	43,110	691,484.40	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	34,020	1,181,854.80	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	34,470	744,552.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,870	487,292.30	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	73,440	1,406,376.00	
POST PROPERTIES	27,480	1,545,475.20	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,500	81,975.00	
PROLOGIS INC	255,470	10,438,504.20	
PS BUSINESS PARKS INC	9,310	779,805.60	
PUBLIC STORAGE	72,160	16,388,257.60	

QTS REALTY TRUST INC	17,590	738,780.00	
RAMCO-GERSHENSON PRYS	39,850	652,743.00	
REALTY INCOME CORP	123,350	5,722,206.50	
REGENCY CENTERS CORP	45,570	2,955,670.20	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	51,200	893,952.00	
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	119,800	1,739,496.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	26,000	391,820.00	
RLJ LODGING TRUST	64,470	1,630,446.30	
ROUSE PROPERTIES INC	16,050	281,517.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25,470	1,415,877.30	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	30,810	606,340.80	
SAUL CENTERS INC	5,300	285,458.00	
SELECT INCOME REIT	29,920	588,825.60	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	117,760	1,685,145.60	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	17,380	269,042.40	
SIMON PROPERTY GROUP	151,270	28,969,717.70	
SL GREEN REALTY CORP	48,800	5,599,800.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	18,070	1,718,276.30	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	214,720	2,067,753.60	
STAG INDUSTRIAL INC	31,380	613,165.20	
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	16,610	404,121.30	
STORE CAPITAL CORP	24,470	521,700.40	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	133,320	1,879,812.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	40,380	541,092.00	
SUN COMMUNITIES INC	26,000	1,623,700.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	102,500	1,462,675.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	46,710	1,585,337.40	
TAUBMAN CENTERS INC	29,420	2,123,535.60	
TERRENO REALTY CORP	19,010	407,764.50	
UDR INC	127,670	4,311,415.90	
UMH PROPERTIES INC	7,500	72,375.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	276,472.50	
URBAN EDGE PROPERTIES	45,685	1,058,978.30	
URSTADT BIDDLE - CL A	12,770	249,525.80	
VENTAS INC	163,300	8,127,441.00	
VEREIT INC	438,030	3,526,141.50	
VORNADO REALTY TRUST	87,270	8,290,650.00	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	35,280	920,808.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	55,350	1,852,564.50	
WELLTOWER INC	171,360	10,111,953.60	
WHITESTONE REIT	13,600	162,384.00	

	WINTHROP REALTY TRUST	18,000	257,940.00	
	WP CAREY INC	48,280	2,938,320.80	
	WP GLIMCHER INC	88,540	998,731.20	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,380	936,475.80	
	アメリカドル 小計	9,639,179	336,248,428.65 (41,425,806,409)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	18,690	602,191.80	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	34,460	456,250.40	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,110	548,722.90	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	7,307	200,577.15	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	31,990	818,304.20	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	18,630	785,627.10	
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,030	283,589.90	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	40,590	603,573.30	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,050	229,596.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	184,544.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	24,400	219,112.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	13,650	107,562.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	25,290	511,869.60	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,010	415,737.60	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	68,620	1,440,333.80	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	24,590	124,671.30	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	69,960.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	17,470	272,532.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	84,738.60	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	192,021.20	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	7,403	141,841.48	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	13,390	112,208.20	
	ONEREIT	25,000	83,500.00	
	PLAZA RETAIL REIT	15,650	69,799.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	44,240	194,213.60	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	75,190	1,878,246.20	
	SLATE RETAIL REIT	7,000	93,100.00	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	29,110	924,533.60	
	カナダドル 小計	654,940	11,648,956.93 (1,081,023,203)	

ユーロ	AEDIFICA	6,350	380,111.00
	AFFINE	3,000	49,260.00
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	39,000	467,610.00
	ALTAREA	1,000	177,100.00
	ANF IMMOBILIER	3,270	69,356.70
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	29,010	375,679.50
	BEFIMMO S.C.A.	10,220	602,980.00
	BENI STABILI SPA	547,000	396,028.00
	COFINIMMO	9,510	925,608.30
	EUROCOMMERCIAL	22,600	904,000.00
	FONCIERE DES MURS	4,000	104,080.00
	FONCIERE DES REGIONS	20,760	1,674,501.60
	GECINA SA	17,380	1,973,499.00
	GREEN REIT PLC	337,170	522,613.50
	HAMBORNER REIT AG	32,440	298,772.40
	HIBERNIA REIT PLC	318,290	421,734.25
	ICADE	17,970	1,141,095.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	157,540	142,022.31
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	3,900	91,065.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	160,000	176,480.00
	KLEPIERRE	93,350	3,853,021.25
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	27,510	263,325.72
	MERCIALYS	9,620	191,678.50
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	148,000	1,664,260.00
	NSI NV	65,000	245,960.00
	RETAIL ESTATES	2,600	199,108.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	48,130	11,604,143.00
	VASTNED RETAIL	9,340	391,019.10
WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,020	533,169.00	
WERELDHAVE BELGIUM	1,000	107,850.00	
WERELDHAVE NV	20,400	1,075,488.00	
	ユーロ 小計	2,172,380	31,022,619.13 (4,109,256,129)
イギリスポ ンド	ASSURA PLC	814,900	462,455.75
	BIG YELLOW GROUP PLC	72,640	535,720.00
	BRITISH LAND CO PLC	500,540	4,116,941.50
	DERWENT LONDON PLC	53,400	1,967,256.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	135,000	148,837.50
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	171,520	1,447,628.80
	HAMMERSON PLC	380,170	2,260,110.65
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	353,580	405,909.84
	INTU PROPERTIES PLC	391,110	1,269,543.06

	LAND SECURITIES GROUP PLC	391,270	5,000,430.60	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	326,380	536,242.34	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	39,967	105,912.55	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	51,510	222,523.20	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	492,000	271,092.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	101,990	321,370.49	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	148,750.00	
	SEGRO PLC	356,440	1,514,870.00	
	SHAFTESBURY PLC	137,850	1,248,231.75	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	318,110	401,454.82	
	WORKSPACE GROUP PLC	59,490	561,288.15	
	イギリスボンド 小計	5,397,867	22,946,569.00 (4,274,486,873)	
オーストラ リアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	110,000	112,750.00	
	360 CAPITAL OFFICE FUND	22,000	44,000.00	
	ABACUS PROPERTY GROUP	122,010	377,010.90	
	ALE PROPERTY GROUP	77,000	298,760.00	
	ARENA REIT	114,000	194,370.00	
	ASPEN GROUP	70,000	102,900.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	21,820	113,245.80	
	BWP TRUST	232,960	743,142.40	
	CHARTER HALL GROUP	164,920	725,648.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	151,280	611,171.20	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	591,940	586,020.60	
	DEXUS PROPERTY GROUP	468,270	3,549,486.60	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	227,322.00	
	GALILEO JAPAN TRUST	40,590	72,250.20	
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	192,674.32	
	GOODMAN GROUP	768,450	4,610,700.00	
	GPT GROUP	871,070	3,989,500.60	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	85,200	257,304.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	198,900.00	
	INDUSTRIA REIT	36,000	73,800.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	400,000	182,000.00	
	INVESTA OFFICE FUND	297,190	1,144,181.50	
	MIRVAC GROUP	1,760,190	3,133,138.20	
	NATIONAL STORAGE REIT	163,217	251,354.18	
	SCENTRE GROUP	2,598,400	10,445,568.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	385,170	774,191.70	
STOCKLAND	1,151,500	4,502,365.00		
VICINITY CENTERS	1,621,280	4,604,435.20		
WESTFIELD CORP	942,430	9,273,511.20		

オーストラリアドル 小計		13,665,175	51,391,701.60 (4,461,827,532)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	471,025.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	480,000	578,400.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	662,000	897,010.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	460,000	568,100.00
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	220,000	341,000.00
	STRIDE PROPERTY LTD	174,000	361,050.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	127,460	234,526.40
ニュージーランドドル 小計		2,538,460	3,451,111.40 (277,538,378)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,101,000	4,359,960.00
	FORTUNE REIT	637,000	4,994,080.00
	LINK REIT	1,111,500	50,406,525.00
	NEW CENTURY REIT	215,000	629,950.00
	PROSPERITY REIT	592,000	1,675,360.00
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	447,000	885,060.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	393,000	1,214,370.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	562,000	2,186,180.00
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	459,000	1,858,950.00
香港ドル 小計		5,517,500	68,210,435.00 (1,083,863,812)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	229,000	310,295.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	450,000	288,000.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	966,266	2,193,423.82
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	421,000	511,515.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	402,000	387,930.00
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	521,000	325,625.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	989,400	1,325,796.00
	CAPITALAND MALL TRUST	1,296,200	2,521,109.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	286,560	429,840.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	339,000	469,515.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	250,905.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	288,000	349,920.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	264,000	509,520.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	305,600	411,032.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	280,000	214,200.00
	KEPPEL DC REIT	450,000	472,500.00
	KEPPEL REIT	827,000	798,055.00
		884,000	287,300.00

	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST			
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	629,000	839,715.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	911,000	874,560.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	574,160	872,723.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	673,920	680,659.20	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	240,000	165,600.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	332,000	275,560.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	461,340.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	337,000	251,065.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	292,000	233,600.00	
	SPH REIT	375,000	356,250.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	700,000	556,500.00	
	SUNTEC REIT	1,218,000	1,936,620.00	
	シンガポールドル 小計	16,068,106	19,560,673.22 (1,694,736,727)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	72,370	766,398.30	
	イスラエルシェケル 小計	72,370	766,398.30 (24,118,554)	
	合計	55,725,977	58,432,657,617 (58,432,657,617)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 157銘柄	100.0%	70.9%
カナダドル	投資証券 28銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	7.0%
イギリスポンド	投資証券 20銘柄	100.0%	7.3%
オーストラリアドル	投資証券 29銘柄	100.0%	7.6%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 9銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	2.9%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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9期中間計算期間(平成27年11月11日から平成28年 5月10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。

## 【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （平成27年11月10日現在）	第9期中間計算期間 （平成28年 5月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	103,170,891
コール・ローン	397,591,221	342,612,059
親投資信託受益証券	20,401,900,039	21,913,903,602
未収利息	640	-
流動資産合計	20,799,491,900	22,359,686,552
資産合計	20,799,491,900	22,359,686,552
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,234,887	19,098,574
未払受託者報酬	4,086,196	4,564,163
未払委託者報酬	65,379,102	73,026,661
未払利息	-	973
その他未払費用	909,295	582,948
流動負債合計	81,609,480	97,273,319
負債合計	81,609,480	97,273,319
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,848,925,687	16,809,700,646
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,868,956,733	5,452,712,587
（分配準備積立金）	2,915,232,454	2,720,356,976
元本等合計	20,717,882,420	22,262,413,233
純資産合計	20,717,882,420	22,262,413,233
負債純資産合計	20,799,491,900	22,359,686,552

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 自 平成26年11月11日 至 平成27年 5月10日	第9期中間計算期間 自 平成27年11月11日 至 平成28年 5月10日
営業収益		
受取利息	75,114	59,488
有価証券売買等損益	1,047,398,624	1,009,666,437
営業収益合計	1,047,473,738	1,009,606,949
営業費用		
支払利息	-	15,485
受託者報酬	3,189,202	4,564,163
委託者報酬	51,027,196	73,026,661
その他費用	398,586	582,948
営業費用合計	54,614,984	78,189,257
営業利益又は営業損失（ ）	992,858,754	1,087,796,206
経常利益又は経常損失（ ）	992,858,754	1,087,796,206
中間純利益又は中間純損失（ ）	992,858,754	1,087,796,206
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（ ）	76,488,711	63,098,940
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,935,836,965	5,868,956,733
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,389,966,974	1,038,615,089
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,389,966,974	1,038,615,089
剰余金減少額又は欠損金増加額	389,934,380	430,161,969
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	389,934,380	430,161,969
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,852,239,602	5,452,712,587

## ( 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8期 (平成27年11月10日現在)	第9期中間計算期間 (平成28年 5月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,848,925,687口	16,809,700,646口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3952円 (13,952円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3244円 (13,244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9期中間計算期間 (平成28年 5月10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9期中間計算期間 (平成28年 5月10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8期 自 平成26年11月11日 至 平成27年11月10日	第9期中間計算期間 自 平成27年11月11日 至 平成28年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,593,062,711円	14,848,925,687円
期中追加設定元本額	7,846,529,569円	3,064,491,026円
期中一部解約元本額	2,590,666,593円	1,103,716,067円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成28年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	838,336,947
コール・ローン	2,783,966,903

	平成28年 5月10日現在
項目	金額（円）
国債証券	263,965,359,050
地方債証券	18,393,297,719
特殊債券	24,558,844,452
社債券	14,132,753,650
派生商品評価勘定	2,088,380
未収入金	4,997,639,564
未収利息	761,558,446
前払費用	14,993,544
流動資産合計	330,448,838,655
資産合計	330,448,838,655
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,648
前受金	2,020,000
未払金	1,863,888
未払解約金	7,217,302,088
未払利息	7,906
その他未払費用	125,965
流動負債合計	7,221,390,495
負債合計	7,221,390,495
純資産の部	
元本等	
元本	229,276,380,407
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	93,951,067,753
元本等合計	323,227,448,160
純資産合計	323,227,448,160
負債純資産合計	330,448,838,655

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 5月10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>

	平成28年 5月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	平成28年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	229,276,380,407口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 106,685,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4098円 (1万口当たり純資産額) (14,098円)

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 5月10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	平成28年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年11月11日
期首元本額	247,692,658,058円
期中追加設定元本額	20,160,656,489円
期中一部解約元本額	38,576,934,140円
期末元本額	229,276,380,407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）	2,827,692,431円
S B I 資産設計オープン（分配型）	24,315,319円
S M T 国内債券インデックス・オープン	7,893,883,392円
世界経済インデックスファンド	584,022,012円
マイセクション25	71,514,370円
マイセクション50	70,325,160円
マイセクション75	20,528,750円
D C マイセクション25	13,988,977,672円
D C マイセクション50	15,982,935,610円
D C マイセクション75	4,417,571,342円
D C 日本債券インデックス・オープン	421,315,346円
D C 日本債券インデックス・オープンS	62,833,580,235円
D C 日本債券インデックス・オープンP	26,546,246,059円
D C マイセクションS25	5,662,151,186円
D C マイセクションS50	6,221,627,262円
D C マイセクションS75	1,167,419,087円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	1,231,104,943円
D C ターゲット・イヤー ファンド2035	719,170,623円
D C ターゲット・イヤー ファンド2045	189,301,852円
D C 世界経済インデックスファンド	700,803,253円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,058,861,378円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	12,251,462円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	131,765,371円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	22,130,096円



区分	平成28年 5月10日現在
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	857,124円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	501,049,380円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	720,557,172円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	145,819,176円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	258,160,975円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	7,256,874,416円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,357,923,782円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,972,608,302円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,177,304,603円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,841,801,550円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,871,106,037円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,580,141,003円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,007,308,594円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,786,994,862円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	205,464,688円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,106,303,391円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,377,741,436円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,212,218,634円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,953,929,540円
分散投資コア戦略ファンドA	1,168,488,368円
分散投資コア戦略ファンドS	542,122,164円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	17,723,727円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	242,950,972円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	19,808,165,159円
コア投資戦略ファンド（切替型）	658,462,518円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	54,503,485円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,882,645円
SMT インデックスバランス・オープン	73,419,163円
債券コア戦略ファンド	347,607円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	696,719,714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）	3,844,708,769円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成28年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,060,582,268	-	1,062,600,000	2,017,732
	合計	1,060,582,268	-	1,062,600,000	2,017,732

## (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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成28年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	410,921,498
コール・ローン	1,364,596,721
株式	143,525,776,440
派生商品評価勘定	42,459,900
未収入金	1,921,747
未収配当金	1,427,208,714
前払金	14,019,000
差入委託証拠金	223,171,000
流動資産合計	147,010,075,020
資産合計	147,010,075,020
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,530,200
未払金	6,920,174
未払解約金	84,022,640
未払利息	3,875
その他未払費用	42,502
流動負債合計	147,519,391
負債合計	147,519,391
純資産の部	
元本等	
元本	127,883,957,977
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,978,597,652
元本等合計	146,862,555,629
純資産合計	146,862,555,629
負債純資産合計	147,010,075,020

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

平成28年 5月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成28年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,883,957,977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 1.1484円 (1万口当たり純資産額) (11,484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

平成28年 5月10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

	平成28年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （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	平成28年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年11月11日
期首元本額	115,353,132,477円
期中追加設定元本額	19,865,194,010円
期中一部解約元本額	7,334,368,510円
期末元本額	127,883,957,977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）	1,109,379,235円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,722,787,178円
SBI資産設計オープン（分配型）	30,609,576円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,304,443,922円
世界経済インデックスファンド	825,271,204円
マイセレクション25	27,788,036円
マイセレクション50	74,695,592円
マイセレクション75	71,455,883円
日本株式インデックス・オープン	16,738,098,755円
DCマイセレクション25	5,590,517,548円
DCマイセレクション50	17,362,577,266円
DCマイセレクション75	15,461,978,523円
DC日本株式インデックス・オープン	4,802,388,893円

区分	平成28年 5月10日現在
DCマイセレクションS25	2,433,943,881円
DCマイセレクションS50	6,680,674,639円
DCマイセレクションS75	4,146,163,671円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,443,759,864円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	511,163,283円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	577,979,003円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	302,967,815円
DC世界経済インデックスファンド	1,097,906,347円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	394,371,900円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	45,800,081円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	136,975,192円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	77,528,615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）	855,674,248円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	3,113,947円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	300,813,572円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,062,788,672円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	178,802,598円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,084,925,142円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,706,120,386円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,296,018,053円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	7,137,171,191円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,155,749,690円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	985,820,476円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,465,950,844円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,692,763,829円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	806,008,463円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,149,087,545円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	92,575,405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）	1,857,216,301円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,066,936,993円
日本株式ファンド・シリーズ2	678,869,013円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	61,298,129円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	87,551,785円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	193,000,299円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	12,473,387円
SMT インデックスバランス・オープン	78,296,491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）	2,903,705,616円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成28年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,303,090,300	-	3,289,020,000	14,070,300
合計		3,303,090,300	-	3,289,020,000	14,070,300

## (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。

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

平成28年 5月10日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	246,036,376
金銭信託	568,712,171
コール・ローン	1,888,591,295
国債証券	206,783,772,473
派生商品評価勘定	13,098,116
未収入金	320,880
未収利息	1,699,073,075
前払費用	92,807,624
差入委託証拠金	98,692,849
流動資産合計	211,391,104,859
資産合計	211,391,104,859
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,303,312
前受金	7,369,041
未払金	18,916,490
未払解約金	122,755,847
未払利息	5,363
その他未払費用	74,709
流動負債合計	175,424,762
負債合計	175,424,762
純資産の部	
元本等	
元本	80,192,228,937
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	131,023,451,160
元本等合計	211,215,680,097
純資産合計	211,215,680,097
負債純資産合計	211,391,104,859

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

平成28年 5月10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）

平成28年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,192,228,937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 2.6339円 (1万口当たり純資産額) (26,339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

	平成28年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成28年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年11月11日
期首元本額	79,946,604,543円
期中追加設定元本額	6,377,464,012円
期中一部解約元本額	6,131,839,618円
期末元本額	80,192,228,937円
期末元本額の内訳	



区分	平成28年 5月10日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	2,857,193,839円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	152,271,202円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,073,003,395円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	740,546,081円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,599,517,931円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,052,073円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,202,613,514円
世界経済インデックスファンド	1,915,353,670円
マイセレクション25	6,359,182円
マイセレクション50	4,341,950円
マイセレクション75	2,981,120円
DCマイセレクション25	1,167,744,054円
DCマイセレクション50	981,394,292円
DCマイセレクション75	647,390,706円
DC外国債券インデックス・オープン	1,458,040,212円
DCマイセレクションS25	474,764,629円
DCマイセレクションS50	379,531,680円
DCマイセレクションS75	170,889,254円
DCターゲット・イヤーフンド2025	52,705,932円
DCターゲット・イヤーフンド2035	40,391,520円
DCターゲット・イヤーフンド2045	15,811,596円
DC世界経済インデックスファンド	2,423,768,050円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	462,268,069円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	165,114,906円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,536,439円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,455,152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）	102,910,993円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	294,484,226円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	440,979,066円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	382,542,645円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	774,026,571円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,675,309,360円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	888,208,671円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,961,423,584円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,287,435,635円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,537,794,333円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	917,413,269円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,104,353,594円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	324,080,606円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	452,237,335円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,673,665,009円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,019,114,169円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	553,315,377円

区分	平成28年 5月10日現在
外国債券ファンド・シリーズ1	481,751,879円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,888,386,670円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,242,683,491円
分散投資コア戦略ファンドA	788,111,314円
分散投資コア戦略ファンドS	1,294,982,586円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	47,357,326円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	633,025,940円
コア投資戦略ファンド（切替型）	767,664,672円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	152,145,166円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	88,643,338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）	326,672,105円
SMT インデックスバランス・オープン	191,203,429円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	22,335,708,640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）	963,870,970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）	580,686,520円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（平成28年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,849,633,312	-	1,857,002,353	7,369,041
合計		1,849,633,312	-	1,857,002,353	7,369,041

（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。

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

（平成28年 5月10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	2,518,439,846	-	2,499,188,900	19,250,946
	アメリカドル	1,129,392,945	-	1,119,204,000	10,188,945
	カナダドル	101,529,222	-	99,460,200	2,069,022

	ユーロ	1,086,461,920	-	1,080,537,500	5,924,420
	イギリスポンド	201,055,759	-	199,987,200	1,068,559
	売建	140,078,206	-	141,401,497	1,323,291
	アメリカドル	74,892,650	-	75,589,650	697,000
	ユーロ	63,957,147	-	64,585,270	628,123
	マレーシアリン ギット	1,228,409	-	1,226,577	1,832
	合計	2,658,518,052	-	2,640,590,397	20,574,237

## (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。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成28年 5月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	10,803,560,691
金銭信託	220,712,801
コール・ローン	732,947,694
株式	234,241,979,982
投資信託受益証券	265,939,581
投資証券	6,607,524,592
派生商品評価勘定	144,743,183
未収入金	2,953,197
未収配当金	407,307,790
差入委託証拠金	1,928,917,661
流動資産合計	255,356,587,172
資産合計	255,356,587,172
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,104,414
前受金	59,913,789
未払解約金	72,513,087
未払利息	2,081
その他未払費用	10,023
流動負債合計	209,543,394
負債合計	209,543,394
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	140,906,965,231
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	114,240,078,547
元本等合計	255,147,043,778
純資産合計	255,147,043,778

	平成28年 5月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	255,356,587,172

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	平成28年 5月10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)

	平成28年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	140,906,965,231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 1.8107円 (1万口当たり純資産額) (18,107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

	平成28年 5月10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

	平成28年 5月10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	平成28年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年11月11日
期首元本額	131,670,490,440円
期中追加設定元本額	15,359,394,237円
期中一部解約元本額	6,122,919,446円
期末元本額	140,906,965,231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）	2,374,022,810円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,579,063円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,612,808,412円
世界経済インデックスファンド	2,742,161,034円
マイセクション25	4,489,430円
マイセクション50	20,292,709円
マイセクション75	22,368,824円
外国株式インデックス・オープン	1,112,052,632円
D C マイセクション25	887,533,926円
D C マイセクション50	4,717,478,781円

区分	平成28年 5月10日現在
D Cマイセレクション7 5	4,924,897,653円
D C外国株式インデックス・オープン	6,546,094,012円
D CマイセレクションS 2 5	384,638,524円
D CマイセレクションS 5 0	1,822,238,877円
D CマイセレクションS 7 5	1,322,548,648円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	159,028,318円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	179,797,781円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	94,227,411円
D C世界経済インデックスファンド	3,521,153,489円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,877,022,335円
マイセレクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	37,613,796円
マイセレクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	24,761,313円
外国株式インデックス・オープンV A 1(適格機関投資家専用)	130,404,252円
バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	193,348,646円
バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	662,659,854円
バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	112,144,094円
バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	680,400,173円
バランスA(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	1,481,150,426円
バランスB(3 7. 5)V A 1(適格機関投資家専用)	714,682,318円
バランスC(5 0)V A 1(適格機関投資家専用)	4,550,074,007円
世界バランスV A 1(適格機関投資家専用)	3,781,462,042円
世界バランスV A 2(適格機関投資家専用)	1,936,984,182円
バランスD(3 5)V A 1(適格機関投資家専用)	700,923,308円
グローバルバランスファンドV A 3 5(適格機関投資家専用)	679,549,530円
バランスE(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	206,819,848円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,760,908,098円
F O F s用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3,696,867,038円
外国株式ファンド・シリーズ1	960,835,366円
コア投資戦略ファンド(安定型)	5,059,155,907円
コア投資戦略ファンド(成長型)	12,593,432,884円
分散投資コア戦略ファンドA	1,382,782,121円
分散投資コア戦略ファンドS	2,270,857,528円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	208,825,706円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	301,760,398円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,390,967,377円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	651,109,197円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	42,391,522円
S M T インデックスバランス・オープン	271,286,721円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	3,939,490,773円
外国株式S M T Bセレクション(SMA専用)	29,379,815,960円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,759,066,177円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成28年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,907,028,391	-	13,966,942,180	59,913,789
合計		13,907,028,391	-	13,966,942,180	59,913,789

## (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。

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

（平成28年 5月10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	870,210,520	-	877,935,500	7,724,980
	アメリカドル	639,327,500	-	645,277,500	5,950,000
	カナダドル	61,420,000	-	61,849,200	429,200
	イギリスポンド	74,336,160	-	75,000,000	663,840
	スイスフラン	45,277,120	-	45,797,000	519,880
	オーストラリアドル	33,233,340	-	33,259,800	26,460
	香港ドル	16,616,400	-	16,752,000	135,600
合計		870,210,520	-	877,935,500	7,724,980

## (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。

## J-REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表



	平成28年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	229,440,993
コール・ローン	761,932,457
投資証券	72,353,600,700
派生商品評価勘定	26,513,000
未収配当金	512,286,588
差入委託証拠金	56,560,000
流動資産合計	73,940,333,738
資産合計	73,940,333,738
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,144,000
前受金	22,369,000
未払金	466,599,539
未払解約金	1,201,796
未払利息	2,163
その他未払費用	54,895
流動負債合計	494,371,393
負債合計	494,371,393
純資産の部	
元本等	
元本	43,985,480,258
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	29,460,482,087
元本等合計	73,445,962,345
純資産合計	73,445,962,345
負債純資産合計	73,940,333,738

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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>不動産投信指数先物取引</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	(1) 受取配当金

	平成28年 5月10日現在
	投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	平成28年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,985,480,258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 1.6698円 (1万口当たり純資産額) (16,698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

	平成28年 5月10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	平成28年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年11月11日
期首元本額	43,171,789,610円
期中追加設定元本額	5,534,587,922円
期中一部解約元本額	4,720,897,274円
期末元本額	43,985,480,258円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,597,487,317円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,889,685円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	8,207,740,943円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	20,908,307,656円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,327,640,625円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,302,375,354円
分散投資コア戦略ファンドA	655,637,562円
分散投資コア戦略ファンドS	1,182,960,907円
コア投資戦略ファンド（切替型）	641,230,596円
J - R E I T インデックス・オープン	305,579,158円
S M T インデックスバランス・オープン	33,388,968円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	911,623,378円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	898,618,109円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（平成28年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	1,064,591,000	-	1,086,960,000	22,369,000

合計	1,064,591,000	-	1,086,960,000	22,369,000
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)1. 時価の算定方法

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

## 2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成28年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	159,879,421
金銭信託	23,257,648
コール・ローン	77,234,485
投資証券	58,821,150,747
派生商品評価勘定	1,063,400
未収入金	40,137,714
未収配当金	111,916,323
流動資産合計	59,234,639,738
資産合計	59,234,639,738
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	210,130
未払金	235,185,790
未払解約金	2,667,140
未払利息	219
その他未払費用	1,051
流動負債合計	238,064,330
負債合計	238,064,330
純資産の部	
元本等	
元本	36,086,928,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	22,909,647,145
元本等合計	58,996,575,408
純資産合計	58,996,575,408
負債純資産合計	59,234,639,738

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

平成28年 5月10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>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成28年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	36,086,928,263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 1.6348円 (1万口当たり純資産額) (16,348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

平成28年 5月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成28年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年11月11日
期首元本額	35,750,137,723円
期中追加設定元本額	1,818,430,243円
期中一部解約元本額	1,481,639,703円
期末元本額	36,086,928,263円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	241,166,679円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,512,769,952円

区分	平成28年 5月10日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	11,539,855円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	8,018,563,598円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	17,776,822,579円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,251,950,310円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,789,123,254円
分散投資コア戦略ファンドA	333,599,182円
分散投資コア戦略ファンドS	675,202,619円
コア投資戦略ファンド（切替型）	329,607,931円
グローバルR E I Tインデックス・オープン	39,679,380円
S M T インデックスバランス・オープン	164,629,276円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,143,202,630円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	323,810,631円
F O F s 用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	475,260,387円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（平成28年 5月10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	162,457,500	-	163,441,500	984,000
	アメリカドル	154,157,500	-	155,083,500	926,000
	カナダドル	8,300,000	-	8,358,000	58,000
	売建	61,139,870	-	61,270,600	130,730
	ユーロ	23,308,770	-	23,463,100	154,330
	イギリスポンド	14,075,100	-	14,062,500	12,600
	オーストラリアドル	15,848,000	-	15,838,000	10,000
	シンガポールドル	7,908,000	-	7,907,000	1,000
合計		223,597,370	-	224,712,100	853,270

#### (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】

## 【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

## 【純資産額計算書】

（平成28年 5月31日現在）

資産総額	22,899,092,093円
負債総額	21,167,478円
純資産総額（ - ）	22,877,924,615円
発行済口数	17,022,394,451口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3440円
（1万口当たり純資産額）	（13,440円）

（参考）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成28年 5月31日現在）

資産総額	328,003,406,065円
負債総額	7,768,876,170円
純資産総額（ - ）	320,234,529,895円
発行済口数	226,811,550,269口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4119円
（1万口当たり純資産額）	（14,119円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成28年 5月31日現在）

資産総額	153,107,565,914円
負債総額	630,954,630円
純資産総額（ - ）	152,476,611,284円
発行済口数	128,424,405,749口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1873円
（1万口当たり純資産額）	（11,873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

(平成28年 5月31日現在)

資産総額	213,907,734,105円
負債総額	31,151,455円
純資産総額( - )	213,876,582,650円
発行済口数	80,197,697,759口
1口当たり純資産額( / )	2.6669円
(1万口当たり純資産額)	(26,669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

(平成28年 5月31日現在)

資産総額	268,389,671,099円
負債総額	1,035,342,920円
純資産総額( - )	267,354,328,179円
発行済口数	140,881,003,246口
1口当たり純資産額( / )	1.8977円
(1万口当たり純資産額)	(18,977円)

## J-REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成28年 5月31日現在)

資産総額	74,803,512,195円
負債総額	403,342,101円
純資産総額( - )	74,400,170,094円
発行済口数	45,649,158,476口
1口当たり純資産額( / )	1.6298円
(1万口当たり純資産額)	(16,298円)

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成28年 5月31日現在）

資産総額	58,639,068,668円
負債総額	170,309,786円
純資産総額（ - ）	58,468,758,882円
発行済口数	35,867,382,190口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6301円
（1万口当たり純資産額）	（16,301円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（平成28年 5月31日現在）

資本金の額 : 3億円

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 : 該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、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、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。

監査役の任期は、選任後4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。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、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、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、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、各取締役及び各監査役に対して会日の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、取締役及び監査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委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

###### [ DO（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実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

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せています。

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コンプライアンス・リスク統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - 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。

さらに、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・評価します。この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。

委託会社の機構は平成28年 8月10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。

平成28年5月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	458	8,006,481
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	35	156,347
単位型公社債投資信託	0	0
合計	493	8,162,828

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、有限責任 不審監査法人により監査を受けておりま

す。

## (1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	12,314,170	16,534,066
前払費用	125,306	102,445
未収委託者報酬	4,518,944	5,528,610
繰延税金資産	116,728	121,367
その他	8,789	5,566
流動資産合計	17,083,939	22,292,056
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 57,461	1 55,487
器具備品	1 116,879	1 90,924
その他	-	1 3,748
有形固定資産合計	174,341	150,160
無形固定資産		
ソフトウェア	197,641	215,175
その他	7,648	5,886
無形固定資産合計	205,290	221,062
投資その他の資産		
投資有価証券	60,277	63,797
長期前払費用	5,425	8,021
長期貸付金	25,838	22,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	114,415	123,235
その他	463	235
貸倒引当金	25,838	22,838
投資その他の資産合計	205,581	220,289
固定資産合計	585,213	591,512
資産合計	17,669,152	22,883,569

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,868	14,543
未払金	2,578,595	3,057,975

未払手数料	1,896,826	2,223,498
その他未払金	681,769	834,477
未払費用	52,291	64,411
未払法人税等	924,882	1,445,329
未払消費税等	354,256	246,748
賞与引当金	94,769	98,630
その他	56,222	3,100
流動負債合計	4,074,887	4,930,740
固定負債		
資産除去債務	12,707	12,926
退職給付引当金	342,831	389,941
その他	-	3,056
固定負債合計	355,538	405,924
負債合計	4,430,425	5,336,665
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	65,500	68,500
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	10,419,991	14,729,555
利益剰余金合計	12,585,491	16,898,055
株主資本合計	13,235,491	17,548,055
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,235	1,151
評価・換算差額等合計	3,235	1,151
純資産合計	13,238,726	17,546,904
負債・純資産合計	17,669,152	22,883,569

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

	前事業年度 ( 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日 )	当事業年度 ( 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	28,159,652	32,163,066
運用受託報酬	8,732	-

営業収益合計	28,168,384	32,163,066
営業費用		
支払手数料	12,922,655	14,102,687
広告宣伝費	130,384	126,914
公告費	880	2,765
調査費	5,994,577	6,758,898
調査費	279,702	331,886
委託調査費	5,712,946	6,425,175
図書費	1,928	1,836
営業雑経費	1,299,065	1,399,773
通信費	17,456	17,552
印刷費	330,921	349,902
協会費	23,182	26,659
諸会費	105	105
情報機器関連費	857,009	927,524
その他営業雑経費	70,390	78,029
営業費用合計	20,347,563	22,391,039
一般管理費		
給料	2,185,555	2,123,392
役員報酬	89,055	89,280
給料・手当	1,839,000	1,759,320
賞与	257,499	274,792
退職給付費用	71,270	73,742
福利費	212,286	222,276
交際費	4,491	6,004
旅費交通費	55,788	67,392
租税公課	42,868	73,989
不動産賃借料	130,938	125,339
減価償却費	129,285	126,985
業務委託費	1 45,054	1 209,510
諸経費	167,290	217,580
一般管理費合計	3,044,830	3,246,214
営業利益	4,775,990	6,525,812

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業外収益		
受取利息	6,802	8,092
収益分配金	4,617	2,026
投資有価証券売却益	1,846	350
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	1,936	5,272
営業外収益合計	18,203	18,742
営業外費用		



長期前払費用償却	1	27,866	1	27,866
支払補償費		7,656		1,893
投資有価証券売却損		117		365
その他		3,283		14
営業外費用合計		38,924		30,139
経常利益		4,755,269		6,514,415
特別損失				
外国税関連費用	2	56,222		-
特別損失合計		56,222		-
税引前当期純利益		4,699,047		6,514,415
法人税、住民税及び事業税		1,667,610		2,183,255
法人税等調整額		30,739		11,403
法人税等合計		1,698,349		2,171,851
当期純利益		3,000,697		4,342,563

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
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	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	

当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	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	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

### (企業結合に関する会計基準等の適用)

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。）及び「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。）等を当事業年度から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当事業年度期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項（4）及び事業分離等会計基準第57 - 4項（4）に定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

## 未適用の会計基準等

・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

### (1) 概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

(分類2)に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

(分類3)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

(分類4)に係る分類の要件を満たす企業が(分類2)又は(分類3)に該当する場合の取扱い

## (2)適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

## (3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

## 表示方法の変更

## (損益計算書関係)

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「業務委託費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。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っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた212,345千円は、「業務委託費」45,054千円、「諸経費」167,290千円として組み替えております。

## 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 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
建 物	45,415	千円	54,302	千円
器具備品	218,270	"	263,257	"
そ の 他	-	"	841	"
計	263,685	"	318,401	"

## (損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)		当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	
業務委託費	37,614	千円	39,733	千円
長期前払費用償却	27,866	"	27,866	"

## 2外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

平成28年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成27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	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28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	16,534,066	16,534,066	-
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

(\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## (1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 投資有価証券

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

## (4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

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

(単位:千円)

区分	平成27年3月31日	平成28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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27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	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

当事業年度(平成28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	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

## (有価証券関係)

## 1. 其他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日現在)

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

当事業年度(平成28年3月31日現在)

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

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

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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
34,635	1,846	117

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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
20,015	350	365

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
(1) 退職給付債務	342,831	389,941
(2) 退職給付引当金	342,831	389,941

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

### 3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
(1) 退職給付費用	71,270	73,742

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,089千円、当事業年度で14,434千円であります。

### 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の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成27年3月31日）		当事業年度 （平成28年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	64,846	千円	86,931	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	8,356	"	6,993	"
賞与引当金損金算入限度超過額	31,368	"	30,437	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	110,871	"	119,400	"



外国税関連費用損金不算入額	18,609	〃	-	〃
その他	5,855	〃	7,674	〃
繰延税金資産 合計	239,908	〃	251,436	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	1,546	〃	-	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	7,217	〃	6,833	〃
繰延税金負債 合計	8,763	〃	6,833	〃
繰延税金資産の純額	231,144	〃	244,602	〃

## 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。

## 3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の33.06%から、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が15,263千円、その他有価証券評価差額金が27千円、それぞれ減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が15,236千円増加しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

### 2. 地域ごとの情報

#### （1）営業収益

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

#### （2）有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	3,178,319千円

（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 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,979,867千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

#### 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	4,412,908円85銭	5,848,968円06銭
1株当たり当期純利益金額	1,000,232円56銭	1,447,521円33銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 4【利害関係人との取引制限】

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

## (1) 自己又はその役員との取引

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

## (2) 運用財産相互間の取引

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

## (3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以

下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成28年6月30日に社外取締役との責任限定契約に係る規定を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成28年 8月10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(平成28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) (平成28年3月末日現在)	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937	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。

### 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 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成28年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年 6 月 3 日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28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

1. 上記は、当社が、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おりません。

# 独立監査人の監査報告書

平成28年1月8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

中島紀子

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SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成26年11月11日から平成27年11月10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、SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成27年11月10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

1. 上記は、当社が、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おりません。



# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年7月7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

中島紀子

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SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成27年11月11日から平成28年5月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成28年5月10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（平成27年11月11日から平成28年5月10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

1. 上記は、当社が、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おりません。