

## 【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29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 平木 秀樹
【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29年 8月11日から平成30年 2月 9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  中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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。

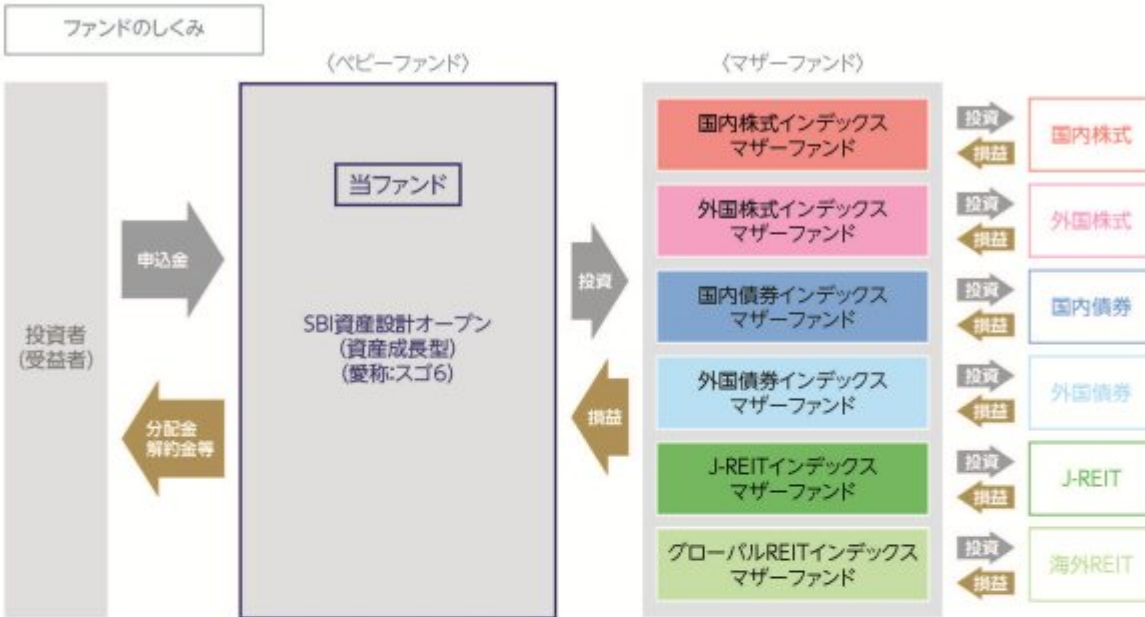
#### [ 特殊型 ]

- (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。



※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 R E I T	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。

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

「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。

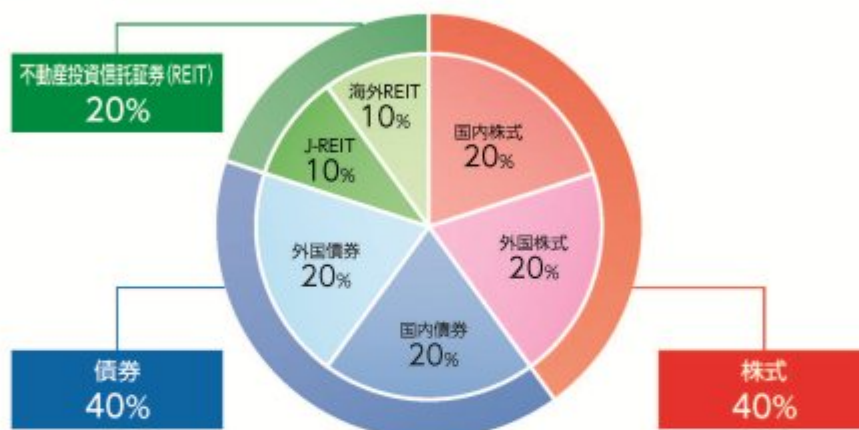
「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「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】

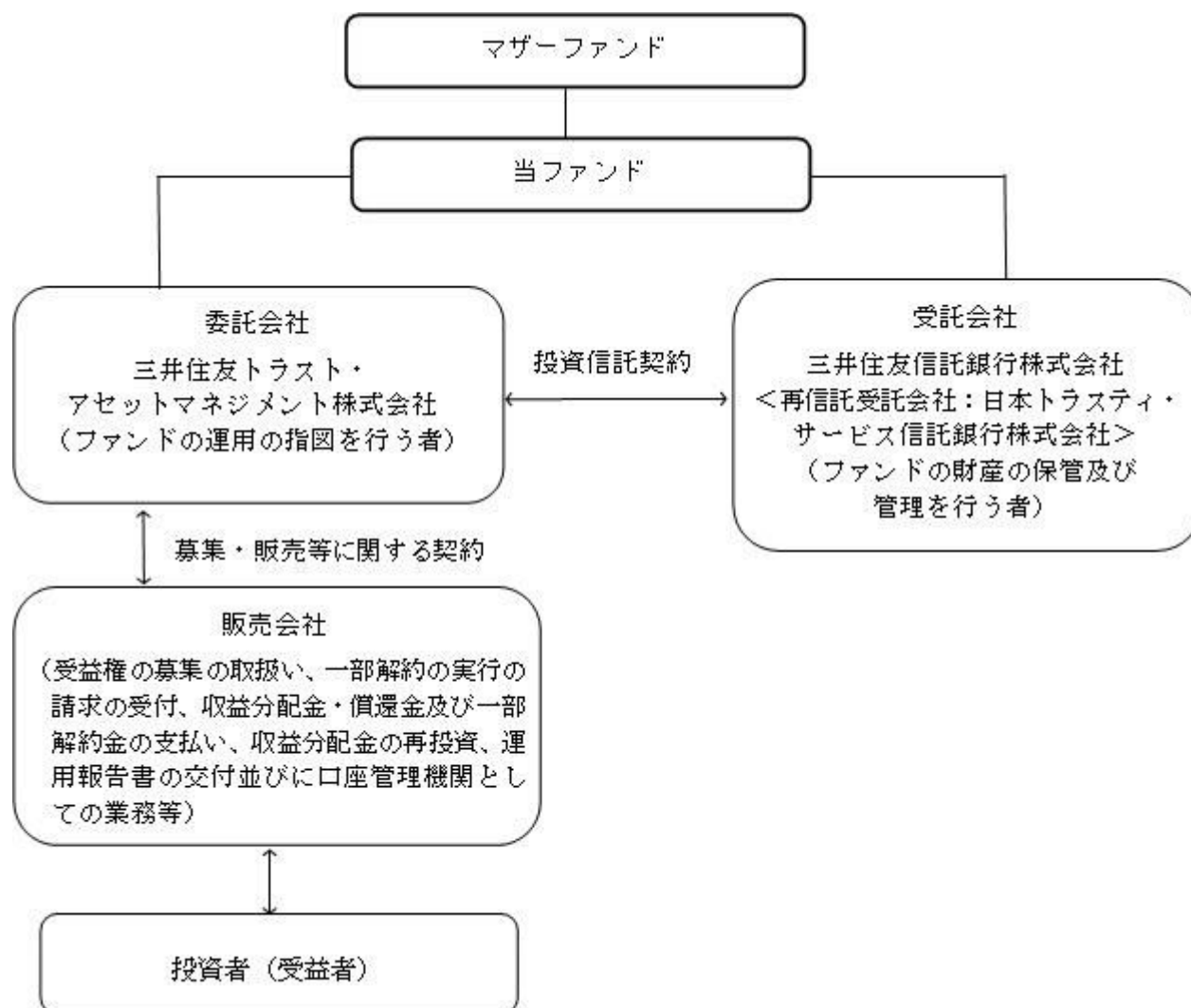
平成20年1月9日 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

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29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。

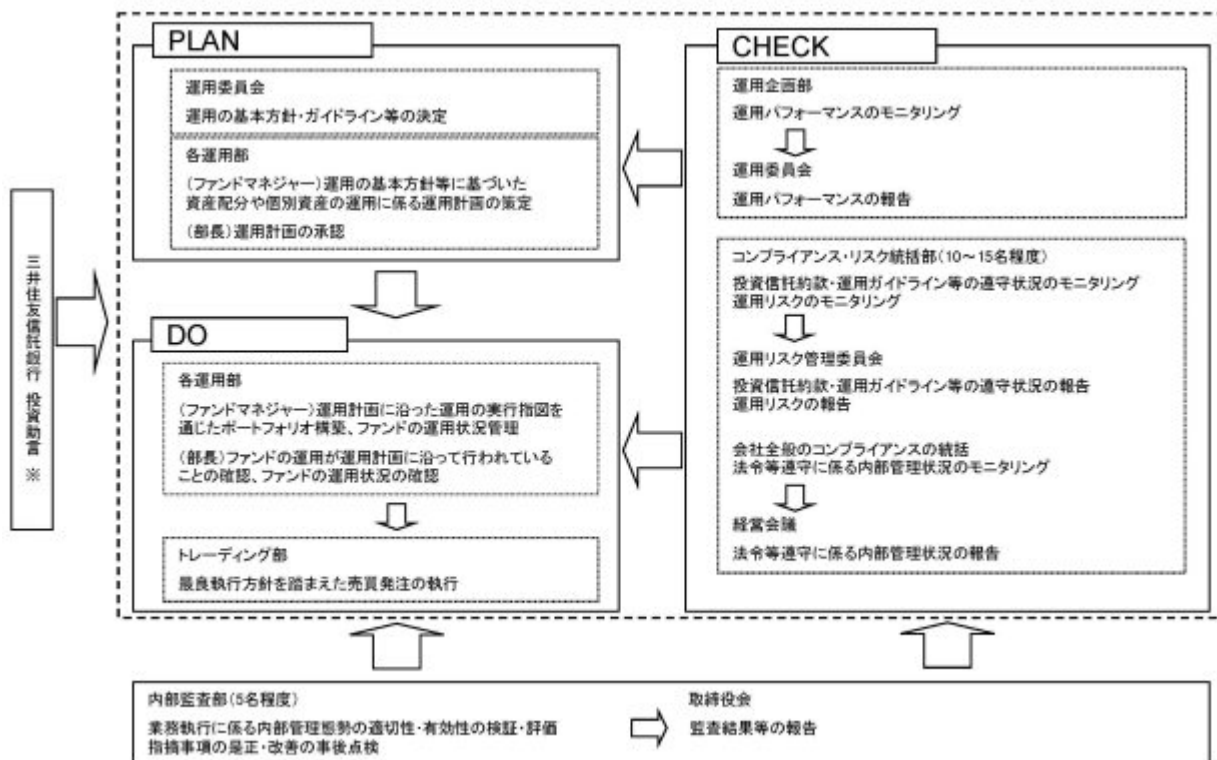
投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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



\*2012年6月～2017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内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。目指数は、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、ファンドの認定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

\*2 MSCI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、一定の借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、ファンドの認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。

\*6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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す。

## (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（純資産総額に対して）	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、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示していません。

#### （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ず（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29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29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	25,264,855,025	98.80
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		307,590,809	1.20
合計（純資産総額）		25,572,445,834	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	2,505,027,137	1.8533	4,642,566,794	2.2113	5,539,366,508	21.66
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	3,984,863,614	1.1999	4,781,437,851	1.3796	5,497,517,841	21.50
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	1,814,984,429	2.5017	4,540,546,547	2.6567	4,821,869,132	18.86
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	2,978,068,074	1.3965	4,158,872,066	1.3829	4,118,370,339	16.10
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	1,615,380,888	1.4828	2,395,286,781	1.6600	2,681,532,274	10.49
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	1,671,175,974	1.5292	2,555,562,300	1.5595	2,606,198,931	10.19

(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	98.80
合計	98.80

(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
第9期計算期間末（平成28年11月10日）	23,607,510,913	23,607,510,913	12,934	12,934
平成28年 5月末日	22,877,924,615		13,440	
6月末日	21,952,213,452		12,716	
7月末日	23,045,519,759		13,140	
8月末日	23,151,862,945		13,017	
9月末日	23,191,867,998		12,871	
10月末日	23,598,710,085		12,956	
11月末日	24,707,520,230		13,531	
12月末日	25,195,007,477		14,000	
平成29年 1月末日	24,901,079,952		13,873	
2月末日	25,146,672,562		13,985	
3月末日	25,135,831,645		13,912	
4月末日	25,402,954,716		13,982	
5月末日	25,572,445,834		14,121	

## 【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
第9期計算期間	平成27年11月11日～平成28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期計算期間	平成27年11月11日～平成28年11月10日	7.3
第10期中間計算期間	平成28年11月11日～平成29年 5月10日	10.2

(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期計算期間	平成27年11月11日～平成28年11月10日	5,479,073,321	2,075,827,603	18,252,171,405
第10期中間計算期間	平成28年11月11日～平成29年 5月10日	2,197,117,295	2,283,704,555	18,165,584,145

(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	249,100,147,000	82.30
	ポーランド	200,418,000	0.07
	小計	249,300,565,000	82.36
地方債証券	日本	17,414,821,907	5.75
特殊債券	日本	22,334,281,501	7.38
社債券	日本	11,041,168,350	3.65
	フランス	500,816,000	0.17
	オーストラリア	401,400,000	0.13
	オランダ	200,074,000	0.07
	スウェーデン	199,663,000	0.07
	イギリス	100,651,000	0.03
	小計	12,443,772,350	4.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,185,873,137	0.39
合計(純資産総額)		302,679,313,895	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。

## 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131回利付国債(5年)	5,530,000,000	101.05	5,588,617,800	101.06	5,588,673,300	0.100	2022/3/20	1.85
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	4,700,000,000	100.61	4,728,826,800	100.58	4,727,495,000	0.100	2027/3/20	1.56
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	3,790,000,000	100.93	3,825,474,400	100.91	3,824,716,400	0.100	2021/3/20	1.26
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	100.58	3,792,054,500	100.58	3,791,979,100	0.200	2018/12/20	1.25
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.81	3,639,385,400	100.79	3,638,735,600	0.100	2020/9/20	1.20
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	100.64	3,542,563,200	100.64	3,542,528,000	0.100	2019/12/20	1.17
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	100.73	3,535,658,100	100.72	3,535,587,900	0.200	2019/6/20	1.17



日本	国債証券	第117回利付国債（5年）	3,300,000,000	100.66	3,322,077,000	100.66	3,322,011,000	0.200	2019/3/20	1.10
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	3,200,000,000	103.43	3,309,760,000	103.42	3,309,664,000	0.400	2025/6/20	1.09
日本	国債証券	第129回利付国債（5年）	3,200,000,000	100.99	3,231,872,000	100.99	3,231,808,000	0.100	2021/9/20	1.07
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	3,140,000,000	100.70	3,162,074,200	100.70	3,162,042,800	0.100	2020/3/20	1.04
日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	100.87	2,985,900,000	100.85	2,985,337,600	0.100	2020/12/20	0.99
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	2,760,000,000	103.45	2,855,247,600	103.44	2,855,192,400	0.400	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	2,770,000,000	102.61	2,842,297,000	102.60	2,842,269,300	0.300	2025/12/20	0.94
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,600,000,000	100.83	2,621,710,000	100.83	2,621,710,000	0.100	2026/3/20	0.87
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	2,560,000,000	100.81	2,580,736,000	100.80	2,580,684,800	0.200	2019/9/20	0.85
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	2,530,000,000	100.81	2,550,594,200	100.81	2,550,568,900	0.100	2026/6/20	0.84
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,390,000,000	104.75	2,503,525,000	104.74	2,503,429,400	0.600	2024/6/20	0.83
日本	国債証券	第115回利付国債（5年）	2,450,000,000	100.48	2,461,858,000	100.48	2,461,809,000	0.200	2018/9/20	0.81
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	104.82	2,400,584,100	104.79	2,399,828,400	0.800	2022/9/20	0.79
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,290,000,000	104.07	2,383,225,900	104.06	2,383,157,200	0.500	2024/9/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	105.45	2,372,625,000	105.41	2,371,792,500	0.800	2023/6/20	0.78
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	2,230,000,000	104.51	2,330,706,800	104.47	2,329,837,100	0.600	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	102.18	2,145,780,000	102.17	2,145,591,000	1.500	2018/9/20	0.71
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	2,110,000,000	100.66	2,124,073,700	100.66	2,124,052,600	0.100	2026/12/20	0.70
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	1,910,000,000	103.72	1,981,052,000	103.71	1,980,899,200	1.300	2019/12/20	0.65
日本	国債証券	第377回利付国債（2年）	1,970,000,000	100.52	1,980,362,200	100.53	1,980,460,700	0.100	2019/6/15	0.65
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	1,950,000,000	100.75	1,964,644,500	100.73	1,964,313,000	0.100	2020/6/20	0.65
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	1,800,000,000	103.40	1,861,254,000	103.40	1,861,218,000	0.400	2025/3/20	0.61
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	1,720,000,000	104.08	1,790,262,000	104.05	1,789,677,200	0.600	2023/3/20	0.59

(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	82.36
地方債証券	5.75
特殊債券	7.38
社債券	4.11
合計	99.61

(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

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	159,754,278,240	98.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,985,299,844	1.83
合計(純資産総額)		162,739,578,084	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	2,920,200,000	1.79

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

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

## 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	849,000	5,970.00	5,068,530,000	5,932.00	5,036,268,000	3.09
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,222,400	697.87	3,644,575,541	690.90	3,608,156,160	2.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	553,200	5,249.33	2,903,930,400	5,308.00	2,936,385,600	1.80
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	310,200	8,732.86	2,708,934,600	9,003.00	2,792,730,600	1.72

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	551,900	4,040.86	2,230,154,100	3,974.00	2,193,250,600	1.35
日本	株式	KDDI	情報・通信業	681,800	3,060.01	2,086,316,400	3,066.00	2,090,398,800	1.28
日本	株式	ソニー	電気機器	493,200	4,038.03	1,991,556,600	4,034.00	1,989,568,800	1.22
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	628,400	3,064.09	1,925,479,600	3,117.00	1,958,722,800	1.20
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	433,600	4,202.85	1,822,358,400	4,161.00	1,804,209,600	1.11
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,357,000	194.99	1,824,562,260	192.80	1,804,029,600	1.11
日本	株式	キーエンス	電気機器	31,600	48,923.03	1,545,968,000	50,310.00	1,589,796,000	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	274,200	5,790.81	1,587,841,000	5,707.00	1,564,859,400	0.96
日本	株式	ファナック	電気機器	70,800	21,774.94	1,541,666,000	21,770.00	1,541,316,000	0.95
日本	株式	任天堂	その他製品	43,000	33,948.72	1,459,795,000	33,650.00	1,446,950,000	0.89
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	135,100	10,699.77	1,445,540,000	10,615.00	1,434,086,500	0.88
日本	株式	キヤノン	電気機器	375,900	3,806.96	1,431,037,000	3,780.00	1,420,902,000	0.87
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	507,300	2,719.94	1,379,825,600	2,717.00	1,378,334,100	0.85
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	288,400	4,738.93	1,366,709,600	4,708.00	1,357,787,200	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	277,600	4,693.96	1,303,043,600	4,700.00	1,304,720,000	0.80
日本	株式	信越化学工業	化学	131,200	9,912.03	1,300,459,200	9,932.00	1,303,078,400	0.80
日本	株式	花王	化学	182,500	6,908.31	1,260,767,000	6,983.00	1,274,397,500	0.78
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	246,800	4,714.86	1,163,629,200	4,652.00	1,148,113,600	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	517,100	2,228.97	1,152,602,300	2,218.00	1,146,927,800	0.70
日本	株式	パナソニック	電気機器	801,900	1,376.15	1,103,539,400	1,420.50	1,139,098,950	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	744,900	1,549.43	1,154,175,750	1,527.00	1,137,462,300	0.70
日本	株式	村田製作所	電気機器	73,300	15,529.71	1,138,328,000	15,350.00	1,125,155,000	0.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,677,000	667.90	1,120,069,500	668.70	1,121,409,900	0.69
日本	株式	三菱地所	不動産業	512,600	2,063.97	1,057,994,400	2,068.50	1,060,313,100	0.65
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	58,100	18,244.31	1,059,994,500	18,135.00	1,053,643,500	0.65
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	747,200	1,403.48	1,048,684,400	1,398.50	1,044,959,200	0.64

(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	3.08
		食料品	4.75
		繊維製品	0.66
		パルプ・紙	0.25
		化学	6.81
		医薬品	4.58
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.96

ガラス・土石製品	0.95
鉄鋼	1.14
非鉄金属	0.91
金属製品	0.70
機械	4.96
電気機器	12.85
輸送用機器	8.41
精密機器	1.58
その他製品	2.03
電気・ガス業	1.86
陸運業	4.17
海運業	0.21
空運業	0.53
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	8.07
卸売業	4.22
小売業	4.73
銀行業	7.54
証券、商品先物取引業	1.10
保険業	2.50
その他金融業	1.24
不動産業	2.44
サービス業	3.87
小計	98.17
合計	98.17

(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	186	円	2,921,562,000	2,920,200,000	1.79

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

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

#### 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	93,469,501,797	42.55
	フランス	21,174,354,795	9.64
	イタリア	20,533,587,305	9.35
	イギリス	15,537,029,290	7.07
	ドイツ	15,287,183,714	6.96
	スペイン	12,032,252,590	5.48
	ベルギー	5,410,040,064	2.46
	オランダ	4,736,918,311	2.16
	オーストラリア	4,531,741,896	2.06
	カナダ	4,496,374,070	2.05
	オーストリア	3,215,674,817	1.46
	メキシコ	1,882,775,065	0.86
	アイルランド	1,747,347,700	0.80
	ポーランド	1,411,918,921	0.64
	フィンランド	1,325,993,190	0.60
	デンマーク	1,314,396,072	0.60
	南アフリカ	1,178,420,858	0.54
	スウェーデン	960,121,250	0.44
	マレーシア	905,527,709	0.41
	シンガポール	832,494,178	0.38
ノルウェー	605,671,224	0.28	
スイス	408,309,784	0.19	
	小計	212,997,634,600	96.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,692,291,034	3.05
合計(純資産総額)		219,689,925,634	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,382,294,630	0.63
	買建	ドイツ	2,008,230,463	0.91

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		4,682,044,600	2.13

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

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

## 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 2.5% 02/15/46	17,550,000	10,174.53	1,785,630,446	10,237.86	1,796,744,448	2.500	2046/2/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	14,150,000	11,050.38	1,563,629,211	11,112.61	1,572,435,483	2.875	2043/5/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,418.54	1,375,248,149	10,450.04	1,379,406,148	1.500	2026/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,948.12	1,346,619,367	10,976.28	1,350,082,936	2.000	2025/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,487.26	1,263,599,191	11,495.00	1,264,450,422	2.625	2020/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,201.92	1,136,995,305	11,228.03	1,139,645,650	2.250	2024/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.875% 07/15/18	10,000,000	11,056.73	1,105,673,514	11,056.98	1,105,698,147	0.875	2018/7/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	11,039.96	1,103,996,309	11,039.37	1,103,937,811	0.625	2018/4/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	9,900,000	11,002.18	1,089,215,918	11,067.99	1,095,731,562	2.875	2045/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	10,000,000	10,933.04	1,093,304,425	10,943.72	1,094,372,260	1.250	2021/3/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,850.27	1,063,326,752	10,862.02	1,064,478,730	1.125	2021/6/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	11,072.99	1,057,470,565	11,089.36	1,059,034,561	1.750	2022/3/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/21	9,500,000	10,977.89	1,042,900,125	10,989.65	1,044,017,567	1.375	2021/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	8,750,000	11,635.77	1,018,130,109	11,638.71	1,018,387,310	3.375	2019/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,027.03	992,433,003	11,029.73	992,676,352	1.000	2019/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/23	9,000,000	10,847.77	976,300,123	10,871.62	978,446,011	1.625	2023/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	8,700,000	11,070.61	963,143,275	11,098.27	965,549,520	2.125	2025/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	11,314.02	961,692,490	11,340.07	963,906,454	2.375	2024/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	11,416.97	959,026,132	11,441.60	961,095,155	2.500	2024/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	10,987.02	922,909,817	11,014.13	925,187,586	2.000	2025/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 12/31/20	8,200,000	11,154.08	914,634,770	11,163.41	915,399,871	1.750	2020/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	8,270,000	10,558.09	873,154,225	10,588.03	875,630,842	1.625	2026/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	8,100,000	10,581.05	857,065,764	10,610.81	859,476,210	1.625	2026/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/23	8,000,000	10,687.32	854,986,026	10,710.03	856,802,770	1.375	2023/9/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.375% 12/15/19	7,650,000	11,093.88	848,682,175	11,099.35	849,100,893	1.375	2019/12/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.125% 06/30/21	7,500,000	11,286.77	846,508,498	11,298.61	847,395,756	2.125	2021/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	11,168.83	837,662,728	11,172.21	837,916,390	1.625	2019/8/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/23	7,550,000	10,998.74	830,405,406	11,017.88	831,850,404	1.750	2023/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.125% 03/31/24	7,400,000	11,150.86	825,163,727	11,175.25	826,969,195	2.125	2024/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1% 08/31/19	7,500,000	11,014.29	826,072,153	11,017.86	826,339,531	1.000	2019/8/31	0.38

(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	96.95
合計	96.95

(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	50	アメリカドル	5,905,781.52	655,305,517	5,913,281.5	656,137,715	0.30
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	30	アメリカドル	3,777,574.65	419,159,683	3,784,687.5	419,948,925	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	18	アメリカドル	2,748,695.5	304,995,253	2,759,625	306,207,990	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	32	ユーロ	3,590,641	445,059,952	3,592,000	445,228,400	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	34	ユーロ	4,486,052	556,046,145	4,493,440	556,961,888	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	50	ユーロ	8,092,140	1,003,020,753	8,116,500	1,006,040,175	0.46

(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	19,270,000.00	2,143,523,730	2,136,657,600	0.97
	カナダドル	買建	2,510,000.00	207,433,720	207,024,800	0.09
	ユーロ	買建	16,030,000.00	1,992,334,420	1,987,078,800	0.90
	イギリスポンド	買建	2,470,000.00	352,324,801	351,283,400	0.16

(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。

## 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	177,684,105,226	58.11
	イギリス	20,847,209,475	6.82
	スイス	11,717,618,094	3.83
	フランス	11,636,942,988	3.81
	ドイツ	11,626,055,813	3.80
	カナダ	11,231,257,131	3.67
	オーストラリア	7,362,849,290	2.41
	オランダ	5,760,498,373	1.88
	アイルランド	4,636,613,197	1.52
	スペイン	4,151,217,617	1.36
	スウェーデン	3,525,299,922	1.15
	香港	2,798,563,794	0.92
	イタリア	2,261,612,668	0.74
	シンガポール	2,258,261,628	0.74
	デンマーク	2,114,193,471	0.69
	ジャージー	1,571,161,617	0.51
	バミューダ	1,475,861,180	0.48
	ベルギー	1,463,478,626	0.48
	フィンランド	1,269,368,056	0.42
	キュラソー	858,577,200	0.28
	ケイマン	783,193,423	0.26
	ノルウェー	766,998,366	0.25
	イスラエル	669,588,687	0.22
	ルクセンブルク	407,216,757	0.13
	オーストリア	281,582,156	0.09
	ニュージーランド	216,594,652	0.07
	パナマ	192,105,700	0.06
	ポルトガル	189,707,686	0.06
	リベリア	162,527,941	0.05
	パプアニューギニア	70,405,656	0.02
英ヴァージン諸島	56,021,307	0.02	
マン島	39,649,610	0.01	
モーリシャス	12,079,267	0.00	
	小計	290,098,416,574	94.87
投資信託受益証券	オーストラリア	186,133,275	0.06
	香港	61,556,600	0.02



	シンガポール	21,251,558	0.01
	小計	268,941,433	0.09
投資証券	アメリカ	5,672,363,048	1.86
	オーストラリア	684,634,950	0.22
	フランス	418,426,613	0.14
	イギリス	296,571,261	0.10
	香港	157,198,920	0.05
	シンガポール	116,624,748	0.04
	カナダ	64,229,989	0.02
	小計	7,410,049,529	2.42
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		8,001,452,828	2.62
合計（純資産総額）		305,778,860,364	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,349,825,440	1.75
	買建	カナダ	403,854,530	0.13
	買建	ドイツ	1,330,251,710	0.44
	買建	イギリス	736,978,046	0.24
	買建	オーストラリア	284,612,280	0.09

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		545,789,100	0.18

(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	427,827	17,044.56	7,292,125,367	17,051.22	7,294,973,668	2.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	592,441	7,762.76	4,598,978,245	7,812.69	4,628,560,009	1.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	32,345	110,491.74	3,573,855,615	110,593.83	3,577,157,496	1.17
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	187,650	16,880.34	3,167,596,702	16,908.08	3,172,802,113	1.04
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	218,331	14,083.04	3,074,764,905	14,104.12	3,079,367,846	1.01
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	333,227	9,048.78	3,015,300,479	8,998.85	2,998,661,788	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	24,889	107,794.31	2,682,892,611	108,283.64	2,695,071,635	0.88
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	286,639	9,471.54	2,714,914,360	9,309.54	2,668,478,383	0.87
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,726	110,213.23	2,614,919,313	110,535.02	2,622,553,960	0.86
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	249,023	9,417.55	2,345,188,919	9,360.72	2,331,035,697	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	382,101	5,815.41	2,222,075,352	5,787.67	2,211,475,870	0.72
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	708,423	3,045.85	2,157,751,611	3,035.86	2,150,677,016	0.70
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	491,750	4,229.79	2,080,001,790	4,277.50	2,103,464,559	0.69
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	809,083	2,578.71	2,086,390,746	2,542.09	2,056,764,716	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	204,702	9,681.26	1,981,773,285	9,697.90	1,985,180,345	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	98,017	18,384.96	1,802,038,859	18,320.60	1,795,730,799	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	151,567	11,619.73	1,761,167,799	11,546.49	1,750,068,002	0.57
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	381,126	4,539.37	1,730,073,302	4,560.45	1,738,108,353	0.57
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	486,576	3,566.25	1,735,253,801	3,565.14	1,734,713,896	0.57
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	56,166	30,304.42	1,702,078,166	30,315.78	1,702,716,605	0.56
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	326,285	5,028.70	1,640,791,728	5,126.35	1,672,651,762	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,393	17,187.70	1,673,962,056	17,074.52	1,662,939,194	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	327,782	5,036.47	1,650,865,651	5,040.91	1,652,320,479	0.54
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	124,099	13,296.33	1,650,062,101	13,309.65	1,651,714,504	0.54
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	178,522	8,934.46	1,594,998,025	8,934.46	1,594,998,025	0.52
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	221,003	7,203.52	1,592,000,238	7,199.08	1,591,019,338	0.52

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,503	10,504.58	1,570,466,702	10,510.13	1,571,296,145	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	227,971	6,887.28	1,570,101,751	6,839.57	1,559,224,616	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,594,311	960.18	1,530,837,494	960.47	1,531,291,075	0.50
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	379,416	4,023.40	1,526,545,977	4,014.53	1,523,177,977	0.50

(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	6.46
		素材	4.70
		資本財	7.35
		商業・専門サービス	0.97
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	1.46
		耐久消費財・アパレル	1.71
		消費者サービス	1.87
		メディア	2.55
		小売	3.89
		食品・生活必需品小売り	1.84
		食品・飲料・タバコ	5.89
		家庭用品・パーソナル用品	2.19
		ヘルスケア機器・サービス	3.92
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.42
		銀行	8.99
		各種金融	4.04
		保険	4.06
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	9.55
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.93		
電気通信サービス	2.73		
公益事業	3.23		
半導体・半導体製造装置	2.56		
		小計	94.87
投資信託受益証券			0.09
投資証券			2.42
合計			97.38

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	400	アメリカドル	48,275,487	5,356,648,038	48,214,000	5,349,825,440	1.75
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	27	カナダドル	4,900,297	404,372,508	4,894,020	403,854,530	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	3,436,438	390,619,907	3,425,700	389,399,319	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	214	ユーロ	7,620,155.5	944,518,274	7,590,580	940,852,391	0.31
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	24	オーストラリアドル	3,451,271	286,110,366	3,433,200	284,612,280	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	69	イギリスポンド	5,197,945	739,407,676	5,180,865	736,978,046	0.24

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,070,000.00	340,871,300	340,616,500	0.11
	カナダドル	買建	220,000.00	18,153,960	18,152,200	0.01
	ユーロ	買建	450,000.00	55,702,800	55,777,500	0.02
	イギリスポンド	買建	290,000.00	41,257,010	41,249,600	0.01
	スイスフラン	買建	210,000.00	23,870,070	23,870,700	0.01
	デンマーククローネ	買建	1,370,000.00	22,781,730	22,824,200	0.01
	オーストラリアドル	買建	270,000.00	22,261,770	22,380,300	0.01
	香港ドル	買建	1,470,000.00	20,931,330	20,918,100	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	67,584,078,800	98.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,361,456,012	1.97
合計（純資産総額）		68,945,534,812	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	1,351,590,500	1.96

(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	8,376	596,242.75	4,994,129,294	590,000	4,941,840,000	7.17
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,176	584,271.22	4,777,001,553	582,000	4,758,432,000	6.90
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	24,815	167,652.41	4,160,294,769	166,600	4,134,179,000	6.00
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	16,640	228,737.4	3,806,190,442	215,300	3,582,592,000	5.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	19,077	171,981.71	3,280,895,105	163,000	3,109,551,000	4.51
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	16,688	173,165.73	2,889,789,712	175,400	2,927,075,200	4.25
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	8,896	285,187.47	2,537,027,754	285,200	2,537,139,200	3.68
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	10,118	239,406.95	2,422,319,549	240,700	2,435,402,600	3.53
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,008	290,506.26	2,326,374,187	293,800	2,352,750,400	3.41
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,461	445,516.84	2,432,967,496	423,500	2,312,733,500	3.35
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	3,738	500,511.11	1,870,910,530	511,000	1,910,118,000	2.77
日本	投資証券	GLP投資法人	15,143	129,462.58	1,960,451,924	124,900	1,891,360,700	2.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	23,490	75,160.04	1,765,509,510	80,300	1,886,247,000	2.74
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,528	614,977.66	1,554,663,535	617,000	1,559,776,000	2.26
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	2,942	478,364.3	1,407,347,794	484,500	1,425,399,000	2.07
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,874	467,004.03	1,342,169,593	491,500	1,412,571,000	2.05
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	9,292	145,635.59	1,353,245,921	141,300	1,312,959,600	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,495	224,354.36	1,232,827,222	238,200	1,308,909,000	1.90

日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,350	526,232.1	1,236,645,452	500,000	1,175,000,000	1.70
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	6,182	163,354.07	1,009,854,894	179,600	1,110,287,200	1.61
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,865	577,157.31	1,076,398,392	564,000	1,051,860,000	1.53
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	7,745	141,818.17	1,098,381,738	131,300	1,016,918,500	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	5,546	178,912.56	992,249,106	183,200	1,016,027,200	1.47
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	19,286	53,294.93	1,027,846,068	52,100	1,004,800,600	1.46
日本	投資証券	プレミアム投資法人	7,813	132,584.05	1,035,879,243	119,000	929,747,000	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	7,589	124,928.44	948,081,986	121,800	924,340,200	1.34
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	9,729	77,231.41	751,384,416	82,700	804,588,300	1.17
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	5,799	136,290.1	790,346,323	137,800	799,102,200	1.16
日本	投資証券	積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	6,558	117,693.46	771,833,736	120,600	790,894,800	1.15
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,155	243,209.91	767,327,295	245,100	773,290,500	1.12

(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	98.03
合計	98.03

(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	773円		1,383,268,040	1,351,590,500	1.96

(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	43,078,322,648	70.88
	オーストラリア	4,918,357,849	8.09

	イギリス	3,307,026,917	5.44
	フランス	2,763,078,910	4.55
	シンガポール	2,002,951,691	3.30
	香港	1,162,583,646	1.91
	カナダ	1,121,305,185	1.85
	スペイン	538,277,286	0.89
	ベルギー	453,723,530	0.75
	ニュージーランド	291,633,559	0.48
	オランダ	286,046,795	0.47
	アイルランド	142,925,547	0.24
	ドイツ	126,171,587	0.21
	イタリア	57,991,118	0.10
	マン島	39,643,937	0.07
	ガーンジー	36,931,656	0.06
	イスラエル	29,511,501	0.05
	小計	60,356,483,362	99.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		417,149,579	0.69
合計(純資産総額)		60,773,632,941	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		51,037,000	0.08

(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	157,187	20,052.69	3,152,022,371	17,196.58	2,703,078,946	4.45
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	73,299	24,132.69	1,768,902,074	23,784.27	1,743,363,647	2.87
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	261,710	5,401.29	1,413,573,779	6,194.89	1,621,266,442	2.67
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	179,320	6,983.53	1,252,288,193	8,044.60	1,442,557,672	2.37
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,330	18,801.06	1,265,875,532	21,228.86	1,429,339,629	2.35

フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	49,120	26,345.19	1,294,076,212	28,644.84	1,407,034,786	2.32
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	179,920	6,799.62	1,223,389,214	7,246.79	1,303,843,824	2.15
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	173,800	6,715.29	1,167,119,001	7,383.27	1,283,213,786	2.11
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	76,220	13,092.70	997,925,991	13,406.18	1,021,819,588	1.68
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	77,930	10,101.79	787,233,149	13,093.27	1,020,359,310	1.68
香港	投資証券	LINK REIT	1,082,000	781.06	845,111,248	875.76	947,572,320	1.56
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,646,030	354.09	936,950,261	348.17	921,294,725	1.52
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	32,490	24,140.04	784,310,211	28,315.88	919,983,019	1.51
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	85,360	10,045.92	857,519,953	10,224.96	872,802,927	1.44
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	132,610	6,184.91	820,180,968	6,102.80	809,292,308	1.33
アメリカ	投資証券	HCP INC	232,310	3,207.34	745,097,977	3,464.17	804,761,611	1.32
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	362,590	1,787.56	648,153,411	1,980.63	718,158,807	1.18
アメリカ	投資証券	GGP INC	286,540	2,755.13	789,456,898	2,463.31	705,837,420	1.16
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	949,040	717.42	680,860,280	701.33	665,594,019	1.10
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	55,178	10,399.17	573,805,468	11,212.50	618,683,766	1.02
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	385,390	1,416.81	546,024,406	1,527.76	588,785,353	0.97
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,160	12,159.61	536,968,415	12,982.31	573,299,251	0.94
アメリカ	投資証券	UDR INC	132,650	3,827.53	507,722,373	4,254.20	564,320,479	0.93
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	49,940	11,046.11	551,642,839	11,231.37	560,894,678	0.92
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	173,710	2,739.60	475,896,333	3,163.46	549,526,304	0.90
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	775,570	553.77	429,488,950	699.67	542,647,715	0.89
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	61,300	8,431.85	516,872,429	8,562.78	524,898,610	0.86
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	35,840	15,417.10	552,549,130	13,739.06	492,408,168	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	71,380	7,383.27	527,018,412	6,734.16	480,684,512	0.79
フランス	投資証券	KLEPIERRE	101,190	4,474.59	452,784,269	4,594.82	464,950,494	0.77

(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	99.31
合計	99.31

(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	460,000.00	51,084,600	51,037,000	0.08



(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：2017年5月31日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	14,121円
純資産総額	255.72億円

※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	2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月
分配金	0円	20円	20円	0円	0円

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

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	21.7%	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	-	-	0.5%
		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	21.5%	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	-	-	0.5%
外国債券 インデックス マザーファンド	18.9%	T 2.5% 02/15/46	アメリカ	国債	-	2.500%	2046/02/15	0.2%
		T 2.875% 05/15/43	アメリカ	国債	-	2.875%	2043/05/15	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	16.1%	第131回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.3%
		第346回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2027/03/20	0.3%
グローバル REITインデックス マザーファンド	10.5%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.3%
J-REIT インデックス マザーファンド	10.2%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%

※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、2017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拠ることとなります。

#### < 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ませんとします。

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發します。

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

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

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

##### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

##### (1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のう

え、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

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

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

委託会社は、監督官庁の命令に基いて、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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れ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。

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。受託会社は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れている受益者に対して交付します。

## < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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



のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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、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9期計算期間(平成27年11月11日から平成28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8期 （平成27年11月10日現在）	第9期 （平成28年11月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	13,063,672
コール・ローン	397,591,221	422,947,264
親投資信託受益証券	20,401,900,039	23,226,586,700
未収入金	-	47,830,000
未収利息	640	-
流動資産合計	20,799,491,900	23,710,427,636
資産合計	20,799,491,900	23,710,427,636
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,234,887	17,543,277
未払受託者報酬	4,086,196	4,951,955
未払委託者報酬	65,379,102	79,231,226
未払利息	-	866
その他未払費用	909,295	1,189,399
流動負債合計	81,609,480	102,916,723
負債合計	81,609,480	102,916,723
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,848,925,687	18,252,171,405
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,868,956,733	5,355,339,508
（分配準備積立金）	2,915,232,454	2,933,550,481
元本等合計	20,717,882,420	23,607,510,913
純資産合計	20,717,882,420	23,607,510,913
負債純資産合計	20,799,491,900	23,710,427,636

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	平成26年11月11日 至 平成27年11月10日	自	平成27年11月11日 至 平成28年11月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		181,123		60,031
有価証券売買等損益		991,902,339		1,453,363,339
営業収益合計		992,083,462		1,453,303,308
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		165,975
受託者報酬		7,275,398		9,516,118
委託者報酬		116,406,298		152,257,887
その他費用		909,295		1,215,310
営業費用合計		124,590,991		163,155,290
営業利益又は営業損失（ ）		867,492,471		1,616,458,598
経常利益又は経常損失（ ）		867,492,471		1,616,458,598
当期純利益又は当期純損失（ ）		867,492,471		1,616,458,598
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（ ）		137,547,911		147,400,594
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		3,049,397,919		1,752,518,321
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,049,397,919		1,752,518,321
剰余金減少額又は欠損金増加額		846,222,711		797,077,542
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		846,222,711		797,077,542
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,868,956,733		5,355,339,508

## ( 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8期 (平成27年11月10日現在)	第9期 (平成28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	14,848,925,687口	18,252,171,405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) 1.2934円 (12,934円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第8期 自 平成26年11月11日 至 平成27年11月10日			第9期 自 平成27年11月11日 至 平成28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	328,588,292円	費用控除後の配当等収益額	A	357,528,490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	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	4,341,437,179円	収益調整金額	C	6,354,260,412円
分配準備積立金額	D	2,185,287,894円	分配準備積立金額	D	2,576,021,991円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,256,669,633円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,287,810,893円
当ファンドの期末残存口数	F	14,848,925,687口	当ファンドの期末残存口数	F	18,252,171,405口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,886円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,088円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## ( 金融商品に関する注記 )

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 平成27年11月11日 至 平成28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9期 (平成28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8期	第9期
	自 平成26年11月11日 至 平成27年11月10日	自 平成27年11月11日 至 平成28年11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	5,479,073,321円
期中一部解約元本額	2,590,666,593円	2,075,827,603円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期 (平成27年11月10日現在)	第9期 (平成28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	991,117,998	1,427,387,757
合計	991,117,998	1,427,387,757

## （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	1,678,169,224	2,565,417,292	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,621,774,587	2,396,658,484	
	国内株式インデックス マザーファンド	4,047,560,982	4,843,311,471	
	外国株式インデックス マザーファンド	2,576,174,434	4,754,329,917	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,992,294,572	4,187,417,024	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,793,790,050	4,479,452,512	
合計		14,709,763,849	23,226,586,700	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	平成28年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	16,033,253
コール・ローン	519,089,897
国債証券	258,125,845,250
地方債証券	17,982,919,383
特殊債券	23,769,143,798
社債券	13,630,461,110
未収入金	199,067,700
未収利息	722,428,361
前払費用	10,116,407
流動資産合計	314,975,105,159
資産合計	314,975,105,159
負債の部	
流動負債	
未払金	120,825,600
未払解約金	219,610,058
未払利息	1,063
その他未払費用	33
流動負債合計	340,436,754
負債合計	340,436,754

	平成28年11月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	224,832,108,590
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,802,559,815
元本等合計	314,634,668,405
純資産合計	314,634,668,405
負債純資産合計	314,975,105,159

## 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 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。 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 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益 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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	224,832,108,590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 105,741,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3994円 (1万口当たり純資産額) (13,994円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成28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28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	平成28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	36,163,332,875円
期中一部解約元本額	59,023,882,343円
期末元本額	224,832,108,590円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,992,294,572円
S B I 資産設計オープン（分配型）	22,555,744円
S M T 国内債券インデックス・オープン	8,167,683,800円
世界経済インデックスファンド	651,308,408円
マイセレクション25	66,590,085円
マイセレクション50	65,907,975円
マイセレクション75	18,447,895円
D C マイセレクション25	14,378,714,560円
D C マイセレクション50	16,632,910,534円
D C マイセレクション75	4,511,913,980円
D C 日本債券インデックス・オープン	429,663,039円
D C 日本債券インデックス・オープンS	66,344,956,294円
D C 日本債券インデックス・オープンP	28,806,802,035円
D C マイセレクションS25	5,877,703,051円
D C マイセレクションS50	6,477,107,240円
D C マイセレクションS75	1,210,961,486円
D C ターゲット・イヤール ファンド2025	1,207,322,205円
D C ターゲット・イヤール ファンド2035	767,360,426円
D C ターゲット・イヤール ファンド2045	208,293,531円

区分	平成28年11月10日現在
D C世界経済インデックスファンド	751,366,220円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	984,171,688円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	10,030,994円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	114,168,310円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	19,147,607円
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）	430,481,472円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	603,268,530円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	127,907,953円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	241,660,617円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	6,317,792,209円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,244,653,334円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,439,550,297円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,098,607,436円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,220,894,601円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,652,880,122円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,493,718,037円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,798,955,357円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,571,614,255円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	194,941,438円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,959,318,801円
日本債券ファンド・シリーズ1	7,456,431,594円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,345,406,566円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,967,605,972円
分散投資コア戦略ファンドA	1,113,291,797円
分散投資コア戦略ファンドS	492,174,687円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	20,324,039円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	295,079,665円
国内債券SMTBセクション（SMA専用）	15,870,689,823円
コア投資戦略ファンド（切替型）	358,154,689円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	60,621,103円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,947,914円
SMT インデックスバランス・オープン	82,793,008円
債券コア戦略ファンド	8,013,596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）	709,071,453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）	4,899,792,182円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28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	3,499,658,150
地方債証券	133,255,805
特殊債券	146,897,246
社債券	73,906,920
合計	3,853,718,121

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第360回利付国債(2年)	600,000,000	602,922,000	
	第362回利付国債(2年)	1,390,000,000	1,397,519,900	
	第364回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,719,900,900	
	第365回利付国債(2年)	400,000,000	402,416,000	
	第366回利付国債(2年)	1,580,000,000	1,590,033,000	
	第367回利付国債(2年)	2,360,000,000	2,375,764,800	
	第368回利付国債(2年)	650,000,000	654,491,500	
	第369回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,067,653,200	
	第370回利付国債(2年)	120,000,000	120,879,600	
	第107回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,126,473,600	
	第108回利付国債(5年)	590,000,000	592,761,200	
	第109回利付国債(5年)	1,190,000,000	1,196,509,300	
	第110回利付国債(5年)	700,000,000	705,719,000	
	第111回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,211,424,000	
	第112回利付国債(5年)	900,000,000	909,891,000	
	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	4,430,827,000	
	第114回利付国債(5年)	810,000,000	818,731,800	
	第115回利付国債(5年)	2,450,000,000	2,471,854,000	
	第116回利付国債(5年)	3,830,000,000	3,867,572,300	

第117回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,558,614,400	
第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,551,733,900	
第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,009,280,000	
第120回利付国債(5年)	2,540,000,000	2,572,054,800	
第121回利付国債(5年)	630,000,000	636,142,500	
第122回利付国債(5年)	3,560,000,000	3,596,098,400	
第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,173,849,200	
第124回利付国債(5年)	3,100,000,000	3,135,371,000	
第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,652,706,300	
第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,996,674,400	
第127回利付国債(5年)	2,500,000,000	2,532,300,000	
第128回利付国債(5年)	3,050,000,000	3,090,992,000	
第129回利付国債(5年)	880,000,000	892,267,200	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	230,985,000	
第2回利付国債(40年)	420,000,000	627,530,400	
第3回利付国債(40年)	420,000,000	632,192,400	
第4回利付国債(40年)	530,000,000	803,517,100	
第5回利付国債(40年)	490,000,000	716,144,800	
第6回利付国債(40年)	690,000,000	991,674,900	
第7回利付国債(40年)	730,000,000	1,005,662,600	
第8回利付国債(40年)	670,000,000	858,491,100	
第9回利付国債(40年)	590,000,000	550,682,400	
第289回利付国債(10年)	2,490,000,000	2,540,098,800	
第290回利付国債(10年)	470,000,000	480,791,200	
第291回利付国債(10年)	840,000,000	858,152,400	
第292回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,139,981,100	
第293回利付国債(10年)	190,000,000	196,355,500	
第294回利付国債(10年)	180,000,000	185,733,000	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	102,855,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,169,468,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	579,549,600	
第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,714,448,000	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,357,893,600	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	864,262,400	
第301回利付国債(10年)	640,000,000	669,100,800	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	208,572,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,454,982,500	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	501,062,400	
第305回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,105,635,800	
第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,233,659,700	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	735,728,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,044,182,700	

第309回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,864,514,400	
第310回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,140,739,500	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	633,661,900	
第312回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,765,874,700	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,757,316,000	
第314回利付国債(10年)	860,000,000	908,400,800	
第315回利付国債(10年)	900,000,000	957,573,000	
第316回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,154,669,700	
第317回利付国債(10年)	620,000,000	658,657,000	
第318回利付国債(10年)	650,000,000	687,349,000	
第319回利付国債(10年)	750,000,000	799,192,500	
第320回利付国債(10年)	1,220,000,000	1,293,736,800	
第321回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,743,959,600	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	793,500,000	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,028,937,200	
第324回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,909,749,100	
第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,421,949,800	
第326回利付国債(10年)	600,000,000	632,358,000	
第327回利付国債(10年)	740,000,000	784,474,000	
第328回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,804,950,800	
第329回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,862,630,000	
第330回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,642,949,000	
第331回利付国債(10年)	680,000,000	716,033,200	
第332回利付国債(10年)	2,410,000,000	2,540,597,900	
第333回利付国債(10年)	2,060,000,000	2,173,938,600	
第334回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,567,076,300	
第335回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,403,446,600	
第336回利付国債(10年)	890,000,000	934,740,300	
第337回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,395,792,000	
第338回利付国債(10年)	2,210,000,000	2,303,947,100	
第339回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,212,132,000	
第340回利付国債(10年)	2,840,000,000	2,964,108,000	
第341回利付国債(10年)	2,710,000,000	2,804,362,200	
第342回利付国債(10年)	3,000,000,000	3,047,970,000	
第343回利付国債(10年)	3,240,000,000	3,290,025,600	
第344回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,116,324,000	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	54,044,000	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	209,422,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	156,028,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	152,996,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	65,019,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	254,087,000	



第7回利付国債(30年)	180,000,000	239,211,000
第8回利付国債(30年)	50,000,000	62,809,500
第9回利付国債(30年)	240,000,000	286,480,800
第10回利付国債(30年)	160,000,000	183,225,600
第11回利付国債(30年)	90,000,000	111,775,500
第12回利付国債(30年)	190,000,000	249,044,400
第13回利付国債(30年)	290,000,000	375,680,500
第14回利付国債(30年)	300,000,000	409,608,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	470,529,400
第16回利付国債(30年)	370,000,000	512,683,100
第17回利付国債(30年)	330,000,000	452,456,400
第18回利付国債(30年)	345,000,000	467,416,350
第19回利付国債(30年)	280,000,000	379,643,600
第20回利付国債(30年)	420,000,000	585,887,400
第21回利付国債(30年)	270,000,000	367,210,800
第22回利付国債(30年)	400,000,000	559,364,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	602,860,000
第24回利付国債(30年)	260,000,000	365,105,000
第25回利付国債(30年)	290,000,000	396,557,600
第26回利付国債(30年)	550,000,000	764,142,500
第27回利付国債(30年)	730,000,000	1,033,964,700
第28回利付国債(30年)	570,000,000	811,788,300
第29回利付国債(30年)	760,000,000	1,072,960,400
第30回利付国債(30年)	660,000,000	921,940,800
第31回利付国債(30年)	740,000,000	1,023,146,200
第32回利付国債(30年)	880,000,000	1,242,296,000
第33回利付国債(30年)	920,000,000	1,241,834,400
第34回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,526,959,200
第35回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,579,502,400
第36回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,530,614,400
第37回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,562,137,200
第38回利付国債(30年)	590,000,000	783,130,600
第39回利付国債(30年)	840,000,000	1,137,427,200
第40回利付国債(30年)	630,000,000	838,756,800
第41回利付国債(30年)	580,000,000	758,773,400
第42回利付国債(30年)	670,000,000	877,123,800
第43回利付国債(30年)	750,000,000	983,760,000
第44回利付国債(30年)	720,000,000	946,238,400
第45回利付国債(30年)	670,000,000	846,538,300
第46回利付国債(30年)	750,000,000	949,155,000
第47回利付国債(30年)	820,000,000	1,060,268,200
第48回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,315,449,400
第49回利付国債(30年)	630,000,000	782,982,900

第50回利付国債(30年)	720,000,000	778,262,400	
第51回利付国債(30年)	1,180,000,000	1,113,412,600	
第52回利付国債(30年)	380,000,000	379,012,000	
第38回利付国債(20年)	20,000,000	20,810,200	
第39回利付国債(20年)	500,000,000	519,580,000	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	104,796,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	343,662,000	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	85,388,000	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	152,588,800	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	185,519,300	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	315,496,800	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	184,871,600	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	98,365,500	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	144,424,800	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	154,029,400	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	240,116,800	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	110,086,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	122,215,500	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	89,362,400	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	224,436,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	156,437,400	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	168,441,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	268,149,600	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	336,888,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	223,046,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	383,978,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	258,175,200	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	340,595,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	226,136,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	365,523,200	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	252,357,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	376,170,300	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	149,680,700	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	222,995,400	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	454,833,600	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	477,648,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	235,756,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	740,823,300	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	422,067,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	236,116,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	154,066,900	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	315,441,000	

第77回利付国債(20年)	290,000,000	341,248,800
第78回利付国債(20年)	170,000,000	199,309,700
第79回利付国債(20年)	270,000,000	318,891,600
第80回利付国債(20年)	220,000,000	261,857,200
第81回利付国債(20年)	390,000,000	462,501,000
第82回利付国債(20年)	600,000,000	716,892,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	347,942,000
第84回利付国債(20年)	470,000,000	559,596,100
第85回利付国債(20年)	290,000,000	349,032,400
第86回利付国債(20年)	210,000,000	256,695,600
第87回利付国債(20年)	550,000,000	667,128,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	515,180,400
第89回利付国債(20年)	350,000,000	425,939,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	769,538,700
第91回利付国債(20年)	450,000,000	554,121,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,070,405,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	496,112,300
第94回利付国債(20年)	610,000,000	744,444,000
第95回利付国債(20年)	610,000,000	760,285,700
第96回利付国債(20年)	320,000,000	392,041,600
第97回利付国債(20年)	540,000,000	669,616,200
第98回利付国債(20年)	440,000,000	540,830,400
第99回利付国債(20年)	870,000,000	1,073,362,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	599,803,200
第101回利付国債(20年)	315,000,000	400,768,200
第102回利付国債(20年)	380,000,000	485,203,000
第103回利付国債(20年)	360,000,000	455,493,600
第104回利付国債(20年)	420,000,000	521,682,000
第105回利付国債(20年)	670,000,000	835,228,700
第106回利付国債(20年)	330,000,000	415,285,200
第107回利付国債(20年)	150,000,000	187,656,000
第108回利付国債(20年)	450,000,000	552,105,000
第109回利付国債(20年)	340,000,000	418,200,000
第110回利付国債(20年)	790,000,000	991,134,000
第111回利付国債(20年)	330,000,000	419,604,900
第112回利付国債(20年)	720,000,000	906,472,800
第113回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,313,031,200
第114回利付国債(20年)	590,000,000	746,910,500
第115回利付国債(20年)	720,000,000	920,844,000
第116回利付国債(20年)	550,000,000	705,820,500
第117回利付国債(20年)	820,000,000	1,041,457,400
第118回利付国債(20年)	590,000,000	743,370,500
第119回利付国債(20年)	380,000,000	468,543,800

第120回利付国債（20年）	330,000,000	398,003,100	
第121回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,362,663,500	
第122回利付国債（20年）	280,000,000	346,203,200	
第123回利付国債（20年）	920,000,000	1,178,262,400	
第124回利付国債（20年）	390,000,000	494,048,100	
第125回利付国債（20年）	430,000,000	558,097,000	
第126回利付国債（20年）	470,000,000	596,712,000	
第127回利付国債（20年）	460,000,000	577,502,400	
第128回利付国債（20年）	720,000,000	905,803,200	
第129回利付国債（20年）	420,000,000	522,345,600	
第130回利付国債（20年）	630,000,000	784,980,000	
第131回利付国債（20年）	380,000,000	467,932,000	
第132回利付国債（20年）	630,000,000	777,035,700	
第133回利付国債（20年）	680,000,000	848,782,800	
第134回利付国債（20年）	560,000,000	700,173,600	
第135回利付国債（20年）	450,000,000	555,871,500	
第136回利付国債（20年）	410,000,000	500,298,400	
第137回利付国債（20年）	290,000,000	358,779,300	
第138回利付国債（20年）	390,000,000	470,597,400	
第139回利付国債（20年）	410,000,000	500,987,200	
第140回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,683,734,400	
第141回利付国債（20年）	360,000,000	446,306,400	
第142回利付国債（20年）	820,000,000	1,029,436,200	
第143回利付国債（20年）	750,000,000	919,095,000	
第144回利付国債（20年）	590,000,000	713,658,100	
第145回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,713,891,000	
第146回利付国債（20年）	1,430,000,000	1,778,176,400	
第147回利付国債（20年）	1,370,000,000	1,681,538,000	
第148回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,333,013,000	
第149回利付国債（20年）	1,490,000,000	1,805,447,900	
第150回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,564,729,500	
第151回利付国債（20年）	1,370,000,000	1,588,473,900	
第152回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,575,560,000	
第153回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,540,743,400	
第154回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,365,802,800	
第155回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,579,721,700	
第156回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,097,880,700	
第157回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,605,485,600	
第158回利付国債（20年）	730,000,000	745,476,000	
第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	200,752,000	
国債証券合計	231,480,000,000	258,125,845,250	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,160,000

第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,186,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	136,346,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	134,280,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	122,790,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	123,954,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	242,920,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	241,636,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	105,062,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	105,306,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	104,769,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	210,248,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	104,382,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	103,639,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	105,364,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	104,211,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,944,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	105,465,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	210,310,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,617,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	140,075,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	120,772,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,233,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	101,844,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	208,780,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	206,302,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	243,664,000	
第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,168,000	
第322回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,539,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,042,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,988,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,971,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,308,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,208,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,683,000	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,055,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	104,368,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	121,633,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	105,048,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	104,217,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	107,854,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	104,146,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,681,000	

平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	104,899,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	105,085,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	121,970,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	102,929,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	108,706,527	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	104,896,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,913,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,452,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	125,649,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	209,446,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,992,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,336,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,897,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,676,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,495,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	125,173,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,741,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,549,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,961,000	
平成20年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,251,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,156,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	203,296,550	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,527,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,877,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	104,364,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	122,169,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	124,476,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	210,582,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	134,621,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	120,914,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	104,642,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	124,677,600	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	105,270,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	103,040,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	104,147,000	

第 6 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,648,000	
第 6 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,889,000	
第 7 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,920,000	
第 8 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,861,000	
第 8 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,558,000	
第 8 9 回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,044,466	
第 9 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,424,000	
第 9 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,000,000	
第 9 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,062,000	
第 9 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,335,000	
第 9 7 回共同発行市場公募地方債	356,000,000	377,263,880	
第 9 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,184,000	
第 1 0 2 回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,254,000	
第 1 0 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,224,000	
第 1 0 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,524,000	
第 1 1 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,722,000	
第 1 1 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,461,000	
第 1 1 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,049,000	
第 1 1 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,288,000	
第 1 2 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,134,000	
第 1 2 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,290,000	
第 1 2 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,201,000	
第 1 3 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,022,000	
第 1 3 2 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,200,000	
第 1 3 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,222,000	
第 1 3 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,916,000	
第 1 4 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,557,000	
第 1 4 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,810,000	
第 1 4 6 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,362,000	
第 1 5 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,194,000	
平成 2 4 年度第 2 回熊本県公募公債（ 1 0 年 ）	200,000,000	208,844,000	
平成 2 2 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	103,930,000	
第 1 3 回大阪市公募公債（ 2 0 年 ）	200,000,000	248,756,000	
平成 2 2 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	104,501,000	
第 5 回名古屋市公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	138,743,000	
第 9 回名古屋市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	122,407,000	
第 1 1 回名古屋市公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	126,768,000	
第 4 8 1 回名古屋市公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	104,192,000	
平成 2 2 年度第 2 回京都市公募公債	102,000,000	106,174,860	
平成 2 3 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	105,267,000	
平成 2 4 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	104,418,000	
平成 2 4 年度第 5 回京都市公募公債	100,000,000	104,939,000	

	平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,167,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,086,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	123,790,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	207,880,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,640,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,080,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,533,000	
	平成25年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	100,471,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,981,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	121,565,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	103,644,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	104,272,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,155,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	207,586,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,340,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	156,634,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,196,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	210,312,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	204,406,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	122,678,000	
	地方債証券合計	16,624,590,000	17,982,919,383	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,143,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,038,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,314,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,572,000	
	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	108,141,000	
	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	216,572,000	
	第14回道路債券	100,000,000	111,196,000	
	第17回道路債券	100,000,000	108,943,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	487,464,000	
	第21回道路債券	100,000,000	137,577,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,575,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	153,847,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,327,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,880,000	



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	101,722,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,676,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,975,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,872,000	
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	30,581,100	
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	113,269,950	
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	102,968,000	
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	186,344,930	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,885,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,984,000	
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	149,338,000	
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	248,940,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,631,000	
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	312,648,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,046,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,091,000	
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	144,388,020	
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	135,518,000	
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	104,742,000	
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	103,823,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,519,000	
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	207,808,000	
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	207,262,000	
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	209,868,000	
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	125,752,000	
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	105,040,000	
	100,000,000	105,784,000	

第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	105,165,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,820,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,776,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	315,065,730	
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	209,948,000	
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	105,013,000	
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	104,618,000	
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	313,005,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,818,000	
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	105,011,000	
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	314,829,000	
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	208,082,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,586,000	
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	311,274,000	
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	211,282,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	155,725,600	
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	104,449,000	
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	236,052,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	106,774,620	
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	104,592,000	
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	104,315,000	
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	103,962,000	
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	103,447,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,870,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	208,290,280	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,913,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,276,000	

第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,761,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,395,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	329,805,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	116,649,500	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	111,488,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,398,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	138,508,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,305,600	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,565,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,681,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,945,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,024,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,638,020	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,891,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,668,120	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,793,360	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,090,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	120,506,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,659,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,745,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,400,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,923,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,283,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,734,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,355,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,982,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,715,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,946,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,812,000	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	81,559,200	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	104,772,350	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	126,144,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	104,831,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	117,006,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,117,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,205,800	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,776,000	24,265,550	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,811,000	22,301,900	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,387,000	23,117,422	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	104,893,000	

第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,951,000	25,743,732
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,857,000	24,527,389
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	18,208,000	19,143,709
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,304,000	41,050,779
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,241,000	23,695,338
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,143,000	21,580,807
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,619,000	25,183,050
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,914,000	21,351,392
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,408,000	24,784,624
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,835,000	28,976,791
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,152,000	29,267,100
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,431,000	35,299,846
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,981,000	36,024,816
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,950,000	38,145,828
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,943,000	43,135,244
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,267,000	45,570,588
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,202,000	46,411,908
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,765,000
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,498,000	98,265,192
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,140,000	23,367,663
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,034,000	52,423,230
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,423,000	23,650,659
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,568,000
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,129,000	23,788,232
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,650,000	59,719,684
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,035,000	21,448,869
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,528,000	60,824,128
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,398,000	57,577,461
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,840,000	24,613,754
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,866,000	111,925,579
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,134,000	61,014,541
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,967,000	24,576,297
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,648,000	72,786,787
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,694,000	70,722,317
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,357,000	71,482,616
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,868,000
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,780,000	146,609,967
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,241,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,356,000

第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,134,000	153,999,272
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,810,000	78,187,671
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,461,000	78,573,481
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,743,000	80,046,717
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,313,000	74,190,761
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,324,000	74,622,021
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,439,000	79,990,989
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	187,552,500
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,038,000	75,392,089
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,952,000	81,406,832
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,418,000	83,002,928
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,365,000	81,630,469
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,455,000
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,254,000	171,049,187
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,740,000	85,754,218
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,488,000	175,263,368
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,839,000	91,710,276
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,936,000	93,540,407
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,349,000	93,494,048
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,154,000	191,219,988
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,338,000	95,612,305
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,327,000	99,821,743
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,790,000	99,999,559
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,918,000
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,807,000
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	132,120,000
第 1 2 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	121,178,000
い第 7 5 2 号商工債	200,000,000	200,686,000
い第 7 5 6 号商工債	100,000,000	100,428,000
い第 7 7 9 号商工債	100,000,000	100,601,000
い第 7 9 5 号商工債	200,000,000	199,702,000
い第 7 5 2 号農林債	200,000,000	200,686,000
い第 7 8 0 号農林債	100,000,000	100,829,000
い第 7 9 5 号農林債	100,000,000	99,851,000
い第 7 9 6 号農林債	200,000,000	199,696,000
第 2 9 0 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	100,596,000
第 2 9 9 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	100,501,000
第 3 0 0 回信金中金債（ 5 年 ）	300,000,000	301,779,000
第 3 0 3 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	100,676,000
第 3 0 9 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	100,774,000

	第317回信金中金債(5年)	200,000,000	199,990,000	
	第179号商工債(3年)	200,000,000	200,282,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,898,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	210,006,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,212,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,988,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	208,876,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,157,000	
	特殊債券合計	22,175,713,000	23,769,143,798	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,770,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,268,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,296,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	99,893,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ピー エルシー円貨社債	100,000,000	99,756,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,410,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,540,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	100,613,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円 貨社債	100,000,000	100,307,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	100,000,000	100,418,000	
	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	100,537,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,714,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,857,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,795,000	
	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	100,426,000	
	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	102,288,000	
	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	104,524,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,852,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	104,411,000	
	第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	103,239,000	
	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	103,106,000	
	第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,085,000	
	第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,965,000	

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	102,795,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,156,000	
第1回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,399,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,992,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,256,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,372,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,355,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,744,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,306,000	
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	100,846,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,387,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,864,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,809,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,702,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,873,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,195,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,599,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,853,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,014,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,591,000	
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	100,611,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	104,298,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,858,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,842,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,366,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,021,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,334,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,074,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,737,000	
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,293,000	
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	128,862,000	
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	104,376,000	
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	106,295,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	121,756,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,806,000	

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	106,063,000	
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	105,588,000	
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	103,309,000	
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	105,519,000	
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	104,740,000	
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	106,595,000	
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	204,674,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,177,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,801,000	
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	101,144,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,348,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,251,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,554,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,710,000	
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	100,910,000	
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	101,070,000	
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	103,761,000	
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	100,838,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,469,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,961,000	
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	104,519,000	
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	105,048,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,675,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,695,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,511,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,000,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,452,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,931,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,530,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	249,910,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,690,000	



第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,218,440	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	124,225,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,302,200	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,227,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	133,533,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	126,934,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	104,501,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	206,076,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,923,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	103,470,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	124,196,400	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,520,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,869,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,751,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,958,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,768,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,060,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	106,454,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,520,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,810,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,491,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,273,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,667,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,052,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,520,000	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,049,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	133,951,860	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,413,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,187,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,753,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,133,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,407,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,940,210	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,546,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,963,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,572,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	104,425,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,652,000	
社債券合計	13,096,000,000	13,630,461,110	

合計		313,508,369,541	
----	--	-----------------	--

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成28年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	50,210,655
コール・ローン	1,625,611,734
株式	150,397,368,930
派生商品評価勘定	39,293,520
未収配当金	1,292,424,336
差入委託証拠金	288,830,000
流動資産合計	153,693,739,175
資産合計	153,693,739,175
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,811,700
前受金	34,501,800
未払解約金	231,136,742
未払利息	3,330
その他未払費用	24
流動負債合計	270,453,596
負債合計	270,453,596
純資産の部	
元本等	
元本	128,212,719,874
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,210,565,705
元本等合計	153,423,285,579
純資産合計	153,423,285,579
負債純資産合計	153,693,739,175

### 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。
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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	128,212,719,874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 1.1966円 (1万口当たり純資産額) (11,966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28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。

平成28年11月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成28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	30,368,228,821円
期中一部解約元本額	17,508,641,424円
期末元本額	128,212,719,874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）	951,141,582円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,047,560,982円
SBI資産設計オープン（分配型）	30,906,710円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,537,600,110円
世界経済インデックスファンド	929,769,728円
マイセレクション25	27,657,272円
マイセレクション50	69,051,118円
マイセレクション75	68,599,605円
日本株式インデックス・オープン	15,953,268,708円
DCマイセレクション25	6,079,981,826円
DCマイセレクション50	17,729,195,261円
DCマイセレクション75	15,937,610,848円
DC日本株式インデックス・オープン	5,027,856,376円
DCマイセレクションS25	2,477,233,779円
DCマイセレクションS50	6,874,358,024円
DCマイセレクションS75	4,270,914,230円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,746,702,929円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	507,070,628円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	602,688,818円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	324,622,102円

区分	平成28年11月10日現在
D C世界経済インデックスファンド	1,200,018,277円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	338,182,089円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	37,432,974円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	115,550,261円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	68,232,071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）	732,185,272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）	263,195,899円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	909,437,186円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	154,046,061円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	997,768,947円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,283,877,830円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,216,966,799円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	6,584,964,200円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,058,460,841円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	641,418,149円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,341,640,074円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,485,330,806円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	734,526,672円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,061,056,220円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	88,007,671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）	1,581,344,956円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,986,451,476円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,048,373,523円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	85,349,503円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	118,077,441円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	216,847,050円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	13,968,449円
SMT インデックスバランス・オープン	90,301,605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）	3,562,802,989円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成28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	1,732,021,935
合計	1,732,021,935

(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28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	2,996,018,180	-	3,030,500,000	34,481,820
合計		2,996,018,180	-	3,030,500,000	34,481,820

## (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	3,300	2,631.00	8,682,300	
日本水産	108,900	485.00	52,816,500	
マルハニチロ	15,900	2,884.00	45,855,600	
カネコ種苗	2,900	1,427.00	4,138,300	
サカタのタネ	12,400	3,010.00	37,324,000	
ホクト	8,500	1,971.00	16,753,500	
ホクリヨウ	900	740.00	666,000	
住石ホールディングス	23,300	87.00	2,027,100	
日鉄鉱業	2,300	4,360.00	10,028,000	
三井松島産業	5,200	1,219.00	6,338,800	
国際石油開発帝石	441,800	975.10	430,799,180	
日本海洋掘削	2,900	2,233.00	6,475,700	
石油資源開発	13,300	2,188.00	29,100,400	
K&Oエナジーグループ	5,600	1,457.00	8,159,200	
ショーボンドホールディングス	8,800	4,950.00	43,560,000	
ミライト・ホールディングス	25,800	1,000.00	25,800,000	
タマホーム	6,300	557.00	3,509,100	
サンヨーホームズ	1,800	584.00	1,051,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,900	1,463.00	2,779,700	
安藤・間	60,300	775.00	46,732,500	
東急建設	29,800	933.00	27,803,400	
コムシスホールディングス	32,800	1,884.00	61,795,200	

ミサワホーム	10,200	844.00	8,608,800	
ピーアールホールディングス	8,300	216.00	1,792,800	
高松コンストラクショングループ	6,300	2,446.00	15,409,800	
東建コーポレーション	3,400	7,470.00	25,398,000	
ソネック	1,000	615.00	615,000	
ヤマウラ	4,000	523.00	2,092,000	
大成建設	426,000	745.00	317,370,000	
大林組	251,500	967.00	243,200,500	
清水建設	257,000	958.00	246,206,000	
飛島建設	82,100	179.00	14,695,900	
長谷工コーポレーション	97,900	1,023.00	100,151,700	
松井建設	9,500	1,106.00	10,507,000	
銭高組	12,000	346.00	4,152,000	
鹿島建設	369,000	694.00	256,086,000	
不動テトラ	68,500	178.00	12,193,000	
大末建設	3,000	879.00	2,637,000	
鉄建建設	52,000	326.00	16,952,000	
西松建設	97,000	512.00	49,664,000	
三井住友建設	321,300	100.00	32,130,000	
大豊建設	30,000	557.00	16,710,000	
前田建設工業	52,000	946.00	49,192,000	
佐田建設	5,800	430.00	2,494,000	
ナカノフドー建設	7,000	431.00	3,017,000	
奥村組	69,000	621.00	42,849,000	
東鉄工業	10,100	2,841.00	28,694,100	
イチケン	8,000	370.00	2,960,000	
浅沼組	27,000	269.00	7,263,000	
戸田建設	98,000	562.00	55,076,000	
熊谷組	132,000	266.00	35,112,000	
青木あすなろ建設	5,500	709.00	3,899,500	
北野建設	18,000	283.00	5,094,000	
植木組	10,000	218.00	2,180,000	
三井ホーム	11,000	449.00	4,939,000	
矢作建設工業	11,400	893.00	10,180,200	
ピーエス三菱	9,500	353.00	3,353,500	
日本ハウスホールディングス	17,100	386.00	6,600,600	
大東建託	30,900	17,335.00	535,651,500	
新日本建設	10,200	982.00	10,016,400	
N I P P O	19,000	2,047.00	38,893,000	
東亜道路工業	16,000	272.00	4,352,000	
前田道路	26,000	1,935.00	50,310,000	
日本道路	25,000	425.00	10,625,000	



東亜建設工業	6,800	2,343.00	15,932,400
若築建設	48,000	150.00	7,200,000
東洋建設	24,100	394.00	9,495,400
五洋建設	93,100	618.00	57,535,800
大林道路	8,700	633.00	5,507,100
世紀東急工業	12,200	470.00	5,734,000
福田組	14,000	1,228.00	17,192,000
住友林業	57,700	1,493.00	86,146,100
日本基礎技術	9,300	337.00	3,134,100
日成ビルド工業	25,000	458.00	11,450,000
巴コーポレーション	10,500	339.00	3,559,500
パナホーム	31,000	758.00	23,498,000
大和ハウス工業	247,700	2,953.50	731,581,950
ライト工業	16,100	1,163.00	18,724,300
積水ハウス	263,900	1,703.00	449,421,700
日特建設	7,100	473.00	3,358,300
北陸電気工事	4,100	835.00	3,423,500
ユアテック	13,000	745.00	9,685,000
西部電気工業	1,400	2,017.00	2,823,800
四電工	6,000	413.00	2,478,000
中電工	10,600	2,160.00	22,896,000
関電工	33,000	990.00	32,670,000
きんでん	55,800	1,410.00	78,678,000
東京エネシス	9,000	966.00	8,694,000
トーエネック	12,000	507.00	6,084,000
住友電設	5,800	1,124.00	6,519,200
日本電設工業	13,700	1,794.00	24,577,800
協和エクシオ	32,900	1,613.00	53,067,700
新日本空調	6,500	1,176.00	7,644,000
N D S	1,300	2,576.00	3,348,800
九電工	16,300	3,130.00	51,019,000
三機工業	18,600	953.00	17,725,800
日揮	78,300	1,842.00	144,228,600
中外炉工業	25,000	199.00	4,975,000
ヤマト	7,500	549.00	4,117,500
太平電業	11,000	1,017.00	11,187,000
高砂熱学工業	23,100	1,468.00	33,910,800
三晃金属工業	700	2,957.00	2,069,900
朝日工業社	1,900	3,010.00	5,719,000
明星工業	15,200	527.00	8,010,400
大気社	11,100	2,567.00	28,493,700
ダイダシ	11,000	873.00	9,603,000

日比谷総合設備	9,400	1,616.00	15,190,400
東芝プラントシステム	13,600	1,654.00	22,494,400
OSJBホールディングス	25,600	249.00	6,374,400
東洋エンジニアリング	50,000	349.00	17,450,000
千代田化工建設	61,000	888.00	54,168,000
新興プランテック	17,200	783.00	13,467,600
日本製粉	25,000	1,552.00	38,800,000
日清製粉グループ本社	92,000	1,504.00	138,368,000
日東富士製粉	600	3,640.00	2,184,000
昭和産業	35,000	582.00	20,370,000
鳥越製粉	6,700	770.00	5,159,000
中部飼料	9,200	910.00	8,372,000
フィード・ワン	50,700	134.00	6,793,800
東洋精糖	13,000	109.00	1,417,000
日本甜菜製糖	4,300	2,017.00	8,673,100
三井製糖	5,900	2,327.00	13,729,300
塩水港精糖	9,100	236.00	2,147,600
日新製糖	3,600	1,489.00	5,360,400
森永製菓	16,400	4,745.00	77,818,000
中村屋	2,000	4,580.00	9,160,000
江崎グリコ	21,000	5,130.00	107,730,000
名糖産業	3,600	1,327.00	4,777,200
不二家	48,000	204.00	9,792,000
山崎製パン	61,400	2,254.00	138,395,600
第一屋製パン	13,000	135.00	1,755,000
モロゾフ	13,000	440.00	5,720,000
亀田製菓	4,700	5,140.00	24,158,000
寿スピリッツ	6,000	2,858.00	17,148,000
カルビー	34,200	3,520.00	120,384,000
森永乳業	75,000	851.00	63,825,000
六甲バター	3,800	2,618.00	9,948,400
ヤクルト本社	45,000	4,845.00	218,025,000
明治ホールディングス	49,700	9,110.00	452,767,000
雪印メグミルク	18,100	3,245.00	58,734,500
プリマハム	53,000	404.00	21,412,000
日本ハム	57,000	2,679.00	152,703,000
丸大食品	40,000	480.00	19,200,000
S Foods	4,500	2,824.00	12,708,000
伊藤ハム米久ホールディングス	48,400	998.00	48,303,200
サッポロホールディングス	27,500	2,910.00	80,025,000
アサヒグループホールディングス	157,300	3,661.00	575,875,300
キリンホールディングス	361,100	1,857.00	670,562,700

宝ホールディングス	60,700	978.00	59,364,600
オエノンホールディングス	21,000	239.00	5,019,000
養命酒製造	2,600	1,827.00	4,750,200
コカ・コーラウエスト	28,400	3,145.00	89,318,000
コカ・コーライーストジャパン	32,700	2,327.00	76,092,900
サントリー食品インターナショナル	57,500	4,745.00	272,837,500
ダイドードリンコ	3,900	5,730.00	22,347,000
伊藤園	24,900	3,785.00	94,246,500
キーコーヒー	7,400	1,996.00	14,770,400
ユニカフェ	2,300	949.00	2,182,700
ジャパンフーズ	1,100	1,140.00	1,254,000
日清オイリオグループ	48,000	475.00	22,800,000
不二製油グループ本社	22,400	2,019.00	45,225,600
かどや製油	800	3,240.00	2,592,000
J・オイルミルズ	3,900	3,610.00	14,079,000
キッコーマン	59,000	3,370.00	198,830,000
味の素	172,800	2,116.50	365,731,200
キューピー	42,700	2,781.00	118,748,700
ハウス食品グループ本社	31,100	2,257.00	70,192,700
カゴメ	30,100	2,684.00	80,788,400
焼津水産化学工業	4,000	1,007.00	4,028,000
アリアケジャパン	6,900	5,450.00	37,605,000
ピエトロ	1,000	1,551.00	1,551,000
エバラ食品工業	2,000	1,944.00	3,888,000
ニチレイ	41,300	2,204.00	91,025,200
東洋水産	41,200	3,950.00	162,740,000
イトアンド	900	2,087.00	1,878,300
日清食品ホールディングス	32,800	5,490.00	180,072,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,286.00	10,288,000
一正蒲鉾	2,900	1,101.00	3,192,900
フジッコ	8,100	2,359.00	19,107,900
ロック・フィールド	8,700	1,412.00	12,284,400
日本たばこ産業	464,800	3,849.00	1,789,015,200
ケンコーマヨネーズ	3,000	3,410.00	10,230,000
わらべや日洋ホールディングス	4,900	2,391.00	11,715,900
なとり	4,200	1,724.00	7,240,800
北の達人コーポレーション	1,900	450.00	855,000
ユーグレナ	26,900	1,312.00	35,292,800
ミヨシ油脂	29,000	132.00	3,828,000
理研ビタミン	2,500	4,285.00	10,712,500
片倉工業	9,900	1,232.00	12,196,800
ゲンゼ	59,000	370.00	21,830,000

東洋紡	311,000	169.00	52,559,000
ユニチカ	215,000	79.00	16,985,000
富士紡ホールディングス	3,800	3,565.00	13,547,000
倉敷紡績	79,000	209.00	16,511,000
シキボウ	42,000	126.00	5,292,000
日本毛織	22,100	762.00	16,840,200
トーア紡コーポレーション	3,300	512.00	1,689,600
ダイドーリミテッド	8,800	405.00	3,564,000
帝国繊維	8,200	1,550.00	12,710,000
帝人	64,100	1,984.00	127,174,400
東レ	569,000	893.80	508,572,200
サカイオーベックス	2,000	1,852.00	3,704,000
住江織物	20,000	214.00	4,280,000
日本フェルト	4,500	494.00	2,223,000
イチカワ	5,000	265.00	1,325,000
日東製網	800	1,686.00	1,348,800
アツギ	65,000	114.00	7,410,000
ダイニック	15,000	168.00	2,520,000
セーレン	19,600	1,266.00	24,813,600
ソトー	3,100	1,158.00	3,589,800
東海染工	15,000	126.00	1,890,000
小松精練	11,400	630.00	7,182,000
ワコールホールディングス	47,000	1,244.00	58,468,000
ホギメディカル	5,000	6,670.00	33,350,000
レナウン	21,200	103.00	2,183,600
クラウディア	2,900	489.00	1,418,100
T S Iホールディングス	32,400	602.00	19,504,800
三陽商会	45,000	150.00	6,750,000
オンワードホールディングス	51,000	718.00	36,618,000
ルック	18,000	151.00	2,718,000
ゴールドウイン	3,400	4,840.00	16,456,000
デサント	17,900	1,269.00	22,715,100
キング	3,900	387.00	1,509,300
ヤマトインターナショナル	4,900	385.00	1,886,500
特種東海製紙	4,600	3,490.00	16,054,000
王子ホールディングス	306,000	419.00	128,214,000
日本製紙	35,100	1,877.00	65,882,700
三菱製紙	11,100	676.00	7,503,600
北越紀州製紙	43,800	640.00	28,032,000
中越パルプ工業	31,000	221.00	6,851,000
巴川製紙所	12,000	244.00	2,928,000
大王製紙	31,200	1,235.00	38,532,000

レンゴー	75,600	657.00	49,669,200
トーモク	25,000	302.00	7,550,000
ザ・バック	5,500	2,671.00	14,690,500
クラレ	131,900	1,568.00	206,819,200
旭化成	489,000	978.40	478,437,600
共和レザー	4,600	779.00	3,583,400
昭和電工	52,200	1,527.00	79,709,400
住友化学	577,000	476.00	274,652,000
日本化成	15,000	140.00	2,100,000
住友精化	3,200	3,885.00	12,432,000
日産化学工業	42,900	3,800.00	163,020,000
ラサ工業	30,000	124.00	3,720,000
クレハ	5,900	4,050.00	23,895,000
多木化学	5,000	752.00	3,760,000
テイカ	12,000	569.00	6,828,000
石原産業	14,100	778.00	10,969,800
片倉コープアグリ	11,000	205.00	2,255,000
日東エフシー	4,600	845.00	3,887,000
日本曹達	47,000	437.00	20,539,000
東ソー	227,000	726.00	164,802,000
トクヤマ	122,000	446.00	54,412,000
セントラル硝子	80,000	406.00	32,480,000
東亜合成	49,100	1,137.00	55,826,700
大阪ソーダ	34,000	457.00	15,538,000
関東電化工業	16,000	858.00	13,728,000
デンカ	162,000	467.00	75,654,000
信越化学工業	140,600	8,311.00	1,168,526,600
日本カーバイド工業	27,000	135.00	3,645,000
堺化学工業	29,000	343.00	9,947,000
エア・ウォーター	64,600	1,924.00	124,290,400
大陽日酸	60,400	1,118.00	67,527,200
日本化学工業	29,000	235.00	6,815,000
日本パーカライズニング	40,100	1,349.00	54,094,900
高圧ガス工業	11,600	669.00	7,760,400
チタン工業	9,000	182.00	1,638,000
四国化成工業	11,000	972.00	10,692,000
戸田工業	16,000	280.00	4,480,000
ステラ ケミファ	3,700	2,983.00	11,037,100
保土谷化学工業	2,700	2,947.00	7,956,900
日本触媒	12,300	6,920.00	85,116,000
大日精化工業	32,000	550.00	17,600,000
カネカ	106,000	807.00	85,542,000

三菱瓦斯化学	73,000	1,685.00	123,005,000
三井化学	356,000	484.00	172,304,000
J S R	78,800	1,537.00	121,115,600
東京応化工業	14,700	3,660.00	53,802,000
大阪有機化学工業	5,200	766.00	3,983,200
三菱ケミカルホールディングス	525,100	671.00	352,342,100
ダイセル	105,700	1,228.00	129,799,600
住友ベークライト	69,000	568.00	39,192,000
積水化学工業	178,000	1,677.00	298,506,000
日本ゼオン	66,000	953.00	62,898,000
アイカ工業	25,100	3,035.00	76,178,500
宇部興産	395,000	216.00	85,320,000
積水樹脂	12,100	1,732.00	20,957,200
タキロン	16,000	486.00	7,776,000
旭有機材	25,000	204.00	5,100,000
日立化成	43,600	2,447.00	106,689,200
ニチバン	8,000	867.00	6,936,000
リケンテクノス	16,900	541.00	9,142,900
大倉工業	19,000	422.00	8,018,000
積水化成品工業	11,200	735.00	8,232,000
群栄化学工業	1,900	2,916.00	5,540,400
タイガースポリマー	3,900	667.00	2,601,300
ミライアル	2,900	747.00	2,166,300
ダイキアクシス	1,300	973.00	1,264,900
ダイキョーニシカワ	13,800	1,228.00	16,946,400
日本化薬	51,000	1,224.00	62,424,000
カーリットホールディングス	7,300	519.00	3,788,700
日本精化	6,500	790.00	5,135,000
扶桑化学工業	5,600	2,359.00	13,210,400
A D E K A	33,700	1,521.00	51,257,700
日油	63,000	1,061.00	66,843,000
ハリマ化成グループ	6,700	639.00	4,281,300
花王	199,100	5,111.00	1,017,600,100
第一工業製薬	17,000	334.00	5,678,000
ニイタカ	1,200	1,447.00	1,736,400
三洋化成工業	4,900	4,645.00	22,760,500
有機合成薬品工業	5,300	223.00	1,181,900
大日本塗料	45,000	219.00	9,855,000
日本ペイントホールディングス	60,500	3,610.00	218,405,000
関西ペイント	82,400	2,242.00	184,740,800
神東塗料	6,000	200.00	1,200,000
中国塗料	22,500	734.00	16,515,000

日本特殊塗料	5,500	1,340.00	7,370,000
藤倉化成	10,600	624.00	6,614,400
太陽ホールディングス	6,400	3,960.00	25,344,000
D I C	31,000	3,170.00	98,270,000
サカティンクス	16,000	1,402.00	22,432,000
東洋インキS Cホールディングス	77,000	502.00	38,654,000
T & K T O K A	5,700	942.00	5,369,400
富士フィルムホールディングス	155,500	3,975.00	618,112,500
資生堂	148,700	2,746.00	408,330,200
ライオン	97,000	1,941.00	188,277,000
高砂香料工業	5,200	2,835.00	14,742,000
マンダム	7,900	4,820.00	38,078,000
ミルボン	4,200	4,785.00	20,097,000
ファンケル	16,700	1,501.00	25,066,700
コーセー	12,700	8,590.00	109,093,000
コタ	3,000	1,232.00	3,696,000
シーズ・ホールディングス	10,200	2,969.00	30,283,800
シーボン	900	2,138.00	1,924,200
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	7,960.00	63,680,000
ノエビアホールディングス	5,000	3,290.00	16,450,000
アジュバンコスメジャパン	1,500	857.00	1,285,500
エステー	5,400	1,288.00	6,955,200
アグロ カネショウ	3,100	1,130.00	3,503,000
コニシ	12,300	1,235.00	15,190,500
長谷川香料	9,900	1,869.00	18,503,100
星光P M C	4,300	1,112.00	4,781,600
小林製薬	21,700	5,150.00	111,755,000
荒川化学工業	6,700	1,460.00	9,782,000
メック	6,100	939.00	5,727,900
日本高純度化学	2,200	2,467.00	5,427,400
タカラバイオ	16,800	1,493.00	25,082,400
J C U	2,500	4,880.00	12,200,000
新田ゼラチン	4,700	710.00	3,337,000
O A T アグリオ	900	1,244.00	1,119,600
デクセリアルズ	20,600	829.00	17,077,400
アース製薬	5,600	4,680.00	26,208,000
イハラケミカル工業	10,900	911.00	9,929,900
北興化学工業	8,000	343.00	2,744,000
大成ラミック	2,200	2,844.00	6,256,800
クミアイ化学工業	16,200	578.00	9,363,600
日本農薬	17,900	560.00	10,024,000
アキレス	6,400	1,544.00	9,881,600

有沢製作所	13,200	574.00	7,576,800
日東電工	56,500	7,262.00	410,303,000
レック	2,500	2,868.00	7,170,000
きもと	14,100	238.00	3,355,800
藤森工業	5,800	2,494.00	14,465,200
前澤化成工業	5,100	1,128.00	5,752,800
J S P	3,700	2,552.00	9,442,400
エフピコ	7,000	5,550.00	38,850,000
天馬	5,200	1,811.00	9,417,200
信越ポリマー	15,400	694.00	10,687,600
東リ	18,700	361.00	6,750,700
ニフコ	13,700	6,040.00	82,748,000
日本バルカー工業	6,100	1,390.00	8,479,000
ユニ・チャーム	158,700	2,380.50	377,785,350
協和発酵キリン	93,800	1,586.00	148,766,800
武田薬品工業	293,900	4,584.00	1,347,237,600
アステラス製薬	800,800	1,554.00	1,244,443,200
大日本住友製薬	55,500	1,795.00	99,622,500
塩野義製薬	106,100	5,429.00	576,016,900
田辺三菱製薬	91,300	2,081.00	189,995,300
わかもと製薬	9,000	228.00	2,052,000
あすか製薬	8,500	1,757.00	14,934,500
日本新薬	18,000	5,370.00	96,660,000
バイオフェルミン製薬	1,300	2,625.00	3,412,500
中外製薬	78,000	3,355.00	261,690,000
科研製薬	14,600	5,990.00	87,454,000
エーザイ	96,500	6,714.00	647,901,000
ロート製薬	38,400	1,843.00	70,771,200
小野薬品工業	178,000	2,605.50	463,779,000
久光製薬	22,100	5,800.00	128,180,000
持田製薬	5,400	8,120.00	43,848,000
参天製薬	144,400	1,487.00	214,722,800
扶桑薬品工業	2,600	2,673.00	6,949,800
日本ケミファ	1,100	4,665.00	5,131,500
ツムラ	26,300	3,205.00	84,291,500
日医工	18,300	1,574.00	28,804,200
キッセイ薬品工業	13,900	2,693.00	37,432,700
生化学工業	14,500	1,534.00	22,243,000
栄研化学	6,600	2,792.00	18,427,200
日水製薬	3,100	1,146.00	3,552,600
鳥居薬品	5,400	2,425.00	13,095,000
J C R ファーマ	6,000	2,879.00	17,274,000



東和薬品	3,600	3,735.00	13,446,000
富士製薬工業	2,500	2,487.00	6,217,500
沢井製薬	13,300	6,400.00	85,120,000
ゼリア新薬工業	16,000	1,730.00	27,680,000
第一三共	230,700	2,368.00	546,297,600
キョーリン製薬ホールディングス	19,200	2,400.00	46,080,000
大幸薬品	3,900	1,607.00	6,267,300
ダイト	4,400	2,195.00	9,658,000
大塚ホールディングス	168,500	4,706.00	792,961,000
大正製薬ホールディングス	16,800	9,620.00	161,616,000
ペプチドリーム	13,300	5,270.00	70,091,000
日本コークス工業	63,200	93.00	5,877,600
昭和シェル石油	70,100	983.00	68,908,300
ニチレキ	9,600	867.00	8,323,200
東燃ゼネラル石油	128,000	1,000.00	128,000,000
ユシロ化学工業	4,200	1,365.00	5,733,000
ピーピー・カストロール	3,200	1,375.00	4,400,000
富士石油	18,200	309.00	5,623,800
MORESCO	2,700	1,461.00	3,944,700
出光興産	37,200	2,419.00	89,986,800
JXホールディングス	869,900	402.40	350,047,760
コスモエネルギーホールディングス	23,600	1,313.00	30,986,800
横浜ゴム	47,300	1,827.00	86,417,100
東洋ゴム工業	41,400	1,606.00	66,488,400
ブリヂストン	264,500	3,949.00	1,044,510,500
住友ゴム工業	73,400	1,752.00	128,596,800
藤倉ゴム工業	6,500	550.00	3,575,000
オカモト	24,000	1,062.00	25,488,000
フコク	3,300	813.00	2,682,900
ニッタ	7,000	2,679.00	18,753,000
住友理工	14,500	985.00	14,282,500
三ツ星ベルト	19,000	929.00	17,651,000
バンドー化学	14,300	977.00	13,971,100
日東紡績	63,000	393.00	24,759,000
旭硝子	386,000	715.00	275,990,000
日本板硝子	35,700	773.00	27,596,100
石塚硝子	11,000	184.00	2,024,000
日本山村硝子	32,000	194.00	6,208,000
日本電気硝子	162,000	560.00	90,720,000
オハラ	3,200	594.00	1,900,800
住友大阪セメント	146,000	380.00	55,480,000
太平洋セメント	474,000	317.00	150,258,000

日本ヒューム	7,500	675.00	5,062,500
日本コンクリート工業	17,900	327.00	5,853,300
三谷セキサン	3,900	2,435.00	9,496,500
アジアパイルホールディングス	10,200	431.00	4,396,200
東海カーボン	73,000	358.00	26,134,000
日本カーボン	39,000	214.00	8,346,000
東洋炭素	4,300	1,535.00	6,600,500
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	2,396.00	10,542,400
TOTO	57,600	4,210.00	242,496,000
日本碍子	99,000	1,941.00	192,159,000
日本特殊陶業	67,500	2,169.00	146,407,500
MARUWA	2,900	4,080.00	11,832,000
品川リフラクトリーズ	20,000	223.00	4,460,000
黒崎播磨	18,000	318.00	5,724,000
ヨータイ	5,000	308.00	1,540,000
イソライト工業	4,700	267.00	1,254,900
東京窯業	10,100	175.00	1,767,500
ニッカトー	3,000	387.00	1,161,000
フジインコーポレーテッド	6,700	1,868.00	12,515,600
ニチアス	41,000	1,120.00	45,920,000
ニチハ	10,400	2,658.00	27,643,200
新日鐵住金	353,400	2,238.00	790,909,200
神戸製鋼所	135,500	900.00	121,950,000
合同製鐵	4,500	1,926.00	8,667,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	214,200	1,498.50	320,978,700
日新製鋼	35,700	1,392.00	49,694,400
東京製鐵	40,000	763.00	30,520,000
共英製鋼	8,500	1,967.00	16,719,500
大和工業	15,800	3,205.00	50,639,000
東京鐵鋼	17,000	454.00	7,718,000
大阪製鐵	5,100	1,905.00	9,715,500
淀川製鋼所	10,900	3,015.00	32,863,500
東洋鋼鈹	19,300	321.00	6,195,300
丸一鋼管	26,300	3,555.00	93,496,500
モリ工業	2,600	1,866.00	4,851,600
大同特殊鋼	132,000	446.00	58,872,000
日本高周波鋼業	30,000	75.00	2,250,000
日本冶金工業	65,100	158.00	10,285,800
山陽特殊製鋼	47,000	526.00	24,722,000
愛知製鋼	4,700	5,040.00	23,688,000
日立金属	79,800	1,360.00	108,528,000
日本金属	1,900	1,027.00	1,951,300

大太平洋金属	51,000	332.00	16,932,000
新日本電工	45,300	201.00	9,105,300
栗本鐵工所	3,800	2,152.00	8,177,600
虹技	11,000	237.00	2,607,000
日本鑄鉄管	9,000	184.00	1,656,000
三菱製鋼	55,000	184.00	10,120,000
日亜鋼業	11,700	244.00	2,854,800
日本精線	6,000	505.00	3,030,000
シンニッタン	7,100	512.00	3,635,200
新家工業	18,000	143.00	2,574,000
大紀アルミニウム工業所	13,000	442.00	5,746,000
日本軽金属ホールディングス	177,400	238.00	42,221,200
三井金属鉱業	213,000	228.00	48,564,000
東邦亜鉛	44,000	403.00	17,732,000
三菱マテリアル	48,900	3,205.00	156,724,500
住友金属鉱山	203,000	1,479.50	300,338,500
D O W Aホールディングス	86,000	779.00	66,994,000
古河機械金属	122,000	164.00	20,008,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,600	1,366.00	11,747,600
東邦チタニウム	13,200	705.00	9,306,000
U A C J	100,000	333.00	33,300,000
古河電気工業	26,300	3,200.00	84,160,000
住友電気工業	295,200	1,422.00	419,774,400
フジクラ	103,200	620.00	63,984,000
昭和電線ホールディングス	93,000	73.00	6,789,000
東京特殊電線	1,200	985.00	1,182,000
タツタ電線	14,800	438.00	6,482,400
沖電線	10,000	209.00	2,090,000
カナレ電気	1,100	1,967.00	2,163,700
平河ヒューテック	3,900	1,119.00	4,364,100
リョービ	48,000	412.00	19,776,000
アーレスティ	9,100	986.00	8,972,600
アサヒホールディングス	11,800	1,970.00	23,246,000
稲葉製作所	4,200	1,314.00	5,518,800
宮地エンジニアリンググループ	23,000	175.00	4,025,000
トーカロ	5,100	2,320.00	11,832,000
アルファC o	2,600	978.00	2,542,800
S U M C O	81,800	1,141.00	93,333,800
川田テクノロジーズ	1,500	4,575.00	6,862,500
R S Technologies	300	3,290.00	987,000
東洋製罐グループホールディングス	55,700	1,996.00	111,177,200
ホッカンホールディングス	20,000	391.00	7,820,000

コロナ	4,100	1,111.00	4,555,100
横河ブリッジホールディングス	13,800	1,165.00	16,077,000
駒井ハルテック	1,500	1,944.00	2,916,000
高田機工	7,000	208.00	1,456,000
三和ホールディングス	77,800	1,077.00	83,790,600
文化シャッター	21,800	855.00	18,639,000
三協立山	10,300	1,599.00	16,469,700
アルインコ	5,400	957.00	5,167,800
東洋シャッター	2,000	516.00	1,032,000
LIXILグループ	109,100	2,463.00	268,713,300
日本フィルコン	5,700	555.00	3,163,500
ノーリツ	15,400	1,973.00	30,384,200
長府製作所	8,400	2,583.00	21,697,200
リンナイ	13,300	9,390.00	124,887,000
ダイニチ工業	4,000	668.00	2,672,000
日東精工	11,000	399.00	4,389,000
三洋工業	10,000	174.00	1,740,000
岡部	16,300	959.00	15,631,700
ジーテクト	8,200	2,057.00	16,867,400
東プレ	15,100	2,448.00	36,964,800
高周波熱錬	14,600	842.00	12,293,200
東京製綱	5,300	1,774.00	9,402,200
サンコール	4,200	458.00	1,923,600
モリテック スチール	4,000	253.00	1,012,000
パイオラックス	4,000	6,520.00	26,080,000
日本発條	73,800	1,033.00	76,235,400
中央発條	9,000	292.00	2,628,000
アドバネクス	1,400	1,266.00	1,772,400
立川ブラインド工業	3,300	772.00	2,547,600
三益半導体工業	5,800	1,250.00	7,250,000
日本ドライケミカル	1,000	2,196.00	2,196,000
日本製鋼所	26,000	2,038.00	52,988,000
三浦工業	32,000	1,713.00	54,816,000
タクマ	25,000	962.00	24,050,000
ツガミ	22,000	569.00	12,518,000
オークマ	51,000	895.00	45,645,000
東芝機械	47,000	408.00	19,176,000
アマダホールディングス	105,400	1,154.00	121,631,600
アイダエンジニアリング	22,500	981.00	22,072,500
滝澤鉄工所	23,000	140.00	3,220,000
富士機械製造	23,900	1,329.00	31,763,100
牧野フライス製作所	39,000	678.00	26,442,000

オーエスジー	35,700	2,283.00	81,503,100
ダイジェット工業	11,000	144.00	1,584,000
旭ダイヤモンド工業	22,700	776.00	17,615,200
D M G 森精機	46,600	1,005.00	46,833,000
ソディック	19,900	737.00	14,666,300
ディスコ	9,200	12,940.00	119,048,000
日東工器	4,600	2,383.00	10,961,800
パンチ工業	2,800	874.00	2,447,200
豊和工業	4,400	579.00	2,547,600
O K K	30,000	104.00	3,120,000
東洋機械金属	5,300	404.00	2,141,200
島精機製作所	10,300	3,455.00	35,586,500
N C ホールディングス	2,500	873.00	2,182,500
フリー	1,500	3,205.00	4,807,500
ヤマシンフィルタ	1,500	709.00	1,063,500
日阪製作所	10,600	810.00	8,586,000
やまびこ	14,400	1,085.00	15,624,000
ペガサスミシン製造	7,500	633.00	4,747,500
ナプテスコ	40,700	2,924.00	119,006,800
三井海洋開発	7,900	1,747.00	13,801,300
レオン自動機	6,600	804.00	5,306,400
S M C	23,500	31,590.00	742,365,000
新川	6,500	704.00	4,576,000
ホソカワミクロン	13,000	623.00	8,099,000
ユニオンツール	3,400	2,710.00	9,214,000
オイレス工業	10,100	1,832.00	18,503,200
日精エー・エス・ビー機械	2,500	1,889.00	4,722,500
サトーホールディングス	9,700	2,129.00	20,651,300
日本エアテック	2,500	619.00	1,547,500
日精樹脂工業	6,600	843.00	5,563,800
オカダアイヨン	1,600	812.00	1,299,200
ワイエイシイ	2,900	1,150.00	3,335,000
小松製作所	361,400	2,413.00	872,058,200
住友重機械工業	228,000	615.00	140,220,000
日立建機	35,000	2,263.00	79,205,000
日工	2,400	1,776.00	4,262,400
巴工業	3,200	1,497.00	4,790,400
井関農機	81,000	252.00	20,412,000
T O W A	6,400	1,400.00	8,960,000
丸山製作所	18,000	167.00	3,006,000
北川鉄工所	3,800	1,689.00	6,418,200
ローツェ	2,800	1,792.00	5,017,600

タカキタ	2,600	517.00	1,344,200
クボタ	376,100	1,622.00	610,034,200
荏原実業	2,200	1,260.00	2,772,000
三菱化工機	27,000	197.00	5,319,000
月島機械	14,900	1,177.00	17,537,300
帝国電機製作所	5,700	784.00	4,468,800
新東工業	17,900	880.00	15,752,000
澁谷工業	6,600	2,133.00	14,077,800
アイチ コーポレーション	11,100	822.00	9,124,200
小森コーポレーション	18,900	1,380.00	26,082,000
鶴見製作所	5,900	1,499.00	8,844,100
住友精密工業	12,000	308.00	3,696,000
酒井重工業	15,000	210.00	3,150,000
荏原製作所	32,500	3,060.00	99,450,000
石井鐵工所	1,200	1,507.00	1,808,400
西島製作所	8,000	1,103.00	8,824,000
北越工業	8,400	674.00	5,661,600
ダイキン工業	102,200	10,420.00	1,064,924,000
オルガノ	15,000	444.00	6,660,000
トーヨーカネツ	37,000	230.00	8,510,000
栗田工業	44,300	2,384.00	105,611,200
椿本チエイン	44,000	828.00	36,432,000
大同工業	16,000	236.00	3,776,000
木村化工機	8,000	331.00	2,648,000
アネスト岩田	13,600	1,118.00	15,204,800
ダイフク	37,400	1,921.00	71,845,400
サムコ	1,900	897.00	1,704,300
加藤製作所	4,200	2,860.00	12,012,000
油研工業	15,000	184.00	2,760,000
タダノ	39,300	1,146.00	45,037,800
フジテック	21,800	1,161.00	25,309,800
C K D	22,400	1,289.00	28,873,600
キトー	9,400	950.00	8,930,000
平和	23,200	2,366.00	54,891,200
理想科学工業	7,400	1,761.00	13,031,400
S A N K Y O	20,800	3,555.00	73,944,000
日本金銭機械	6,900	1,465.00	10,108,500
マースエンジニアリング	4,200	2,016.00	8,467,200
福島工業	4,600	3,365.00	15,479,000
オーイズミ	3,100	678.00	2,101,800
ダイコク電機	3,100	1,548.00	4,798,800
竹内製作所	13,700	2,066.00	28,304,200

アマノ	23,200	1,929.00	44,752,800
JUKI	11,800	877.00	10,348,600
サンデンホールディングス	46,000	291.00	13,386,000
蛇の目マシン工業	7,300	745.00	5,438,500
マックス	12,000	1,259.00	15,108,000
グローリー	23,900	3,485.00	83,291,500
新晃工業	5,200	1,185.00	6,162,000
大和冷機工業	12,000	915.00	10,980,000
セガサミーホールディングス	74,200	1,633.00	121,168,600
日本ピストンリング	2,900	1,590.00	4,611,000
リケン	3,500	3,810.00	13,335,000
T P R	8,400	2,981.00	25,040,400
ツバキ・ナカシマ	8,300	1,687.00	14,002,100
ホシザキ	16,400	9,300.00	152,520,000
大豊工業	6,000	1,508.00	9,048,000
日本精工	153,700	1,133.00	174,142,100
N T N	173,000	364.00	62,972,000
ジェイテクト	79,800	1,576.00	125,764,800
不二越	75,000	402.00	30,150,000
日本トムソン	23,900	364.00	8,699,600
T H K	52,900	2,233.00	118,125,700
ユーシン精機	3,300	2,500.00	8,250,000
前澤給装工業	2,800	1,413.00	3,956,400
イーグル工業	8,100	1,401.00	11,348,100
前澤工業	5,500	345.00	1,897,500
日本ピラー工業	7,600	1,174.00	8,922,400
キッツ	35,900	635.00	22,796,500
日立工機	20,000	951.00	19,020,000
マキタ	48,800	7,540.00	367,952,000
日立造船	59,400	555.00	32,967,000
三菱重工業	1,254,000	454.20	569,566,800
I H I	576,000	302.00	173,952,000
スター精密	13,100	1,459.00	19,112,900
日清紡ホールディングス	41,600	1,065.00	44,304,000
イビデン	52,400	1,396.00	73,150,400
コニカミノルタ	175,300	927.00	162,503,100
ブラザー工業	96,800	2,040.00	197,472,000
ミネベア	120,600	991.00	119,514,600
日立製作所	1,797,000	562.50	1,010,812,500
東芝	1,674,000	381.90	639,300,600
三菱電機	798,400	1,480.50	1,182,031,200
富士電機	226,000	542.00	122,492,000

東洋電機製造	15,000	295.00	4,425,000
安川電機	86,800	1,716.00	148,948,800
シンフォニアテクノロジー	48,000	202.00	9,696,000
明電舎	69,000	331.00	22,839,000
オリジン電気	11,000	265.00	2,915,000
山洋電気	20,000	706.00	14,120,000
デンヨー	6,900	1,231.00	8,493,900
東芝テック	47,000	508.00	23,876,000
芝浦メカトロニクス	12,000	244.00	2,928,000
マブチモーター	21,100	6,350.00	133,985,000
日本電産	97,000	10,185.00	987,945,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	2,392.00	2,152,800
東光高岳	3,800	2,011.00	7,641,800
ダブル・スコープ	7,200	1,606.00	11,563,200
ダイヘン	41,000	635.00	26,035,000
田淵電機	11,400	316.00	3,602,400
ヤーマン	1,000	3,115.00	3,115,000
JVCケンウッド	55,000	324.00	17,820,000
ミマキエンジニアリング	6,800	548.00	3,726,400
第一精工	3,500	1,175.00	4,112,500
日新電機	15,000	1,259.00	18,885,000
大崎電気工業	14,000	966.00	13,524,000
オムロン	79,600	3,960.00	315,216,000
日東工業	11,000	1,552.00	17,072,000
I D E C	9,800	989.00	9,692,200
不二電機工業	800	1,392.00	1,113,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	144,000	441.00	63,504,000
サクサホールディングス	19,000	212.00	4,028,000
メルコホールディングス	4,100	2,873.00	11,779,300
テクノメディカ	1,700	1,771.00	3,010,700
日本電気	1,029,000	288.00	296,352,000
富士通	722,000	631.00	455,582,000
沖電気工業	32,400	1,359.00	44,031,600
岩崎通信機	33,000	74.00	2,442,000
電気興業	21,000	560.00	11,760,000
サンケン電気	44,000	416.00	18,304,000
ナカヨ	8,000	361.00	2,888,000
アイホン	4,200	1,774.00	7,450,800
ルネサスエレクトロニクス	38,800	767.00	29,759,600
セイコーエプソン	111,400	2,147.00	239,175,800
ワコム	58,200	265.00	15,423,000
アルバック	13,800	3,150.00	43,470,000



アクセル	3,200	773.00	2,473,600
E I Z O	7,400	3,230.00	23,902,000
ジャパンディスプレイ	139,800	213.00	29,777,400
日本信号	20,600	888.00	18,292,800
京三製作所	18,000	383.00	6,894,000
能美防災	8,500	1,638.00	13,923,000
ホーチキ	5,500	1,295.00	7,122,500
エレコム	6,500	1,873.00	12,174,500
日本無線	4,600	1,336.00	6,145,600
パナソニック	855,100	1,003.00	857,665,300
アンリツ	54,600	548.00	29,920,800
富士通ゼネラル	25,000	2,248.00	56,200,000
日立国際電気	19,600	2,187.00	42,865,200
ソニー	528,400	3,207.00	1,694,578,800
T D K	42,200	7,130.00	300,886,000
帝国通信工業	17,000	159.00	2,703,000
ミツミ電機	26,500	582.00	15,423,000
タムラ製作所	29,000	429.00	12,441,000
アルプス電気	69,100	2,510.00	173,441,000
池上通信機	24,000	131.00	3,144,000
パイオニア	112,400	249.00	27,987,600
日本電波工業	7,300	816.00	5,956,800
鈴木	3,000	509.00	1,527,000
日本トリム	1,800	4,220.00	7,596,000
ローランド ディー . ジー .	3,800	2,299.00	8,736,200
フォスター電機	8,800	1,767.00	15,549,600
クラリオン	39,000	348.00	13,572,000
S M K	19,000	409.00	7,771,000
ヨコオ	5,400	736.00	3,974,400
ホシデン	22,700	852.00	19,340,400
ヒロセ電機	12,100	13,470.00	162,987,000
日本航空電子工業	24,000	1,466.00	35,184,000
T O A	8,800	926.00	8,148,800
日立マクセル	11,200	1,992.00	22,310,400
古野電気	9,700	755.00	7,323,500
ユニデンホールディングス	22,000	146.00	3,212,000
アルパイン	17,800	1,404.00	24,991,200
スミダコーポレーション	6,200	1,079.00	6,689,800
アイコム	4,100	1,960.00	8,036,000
リオン	2,900	1,470.00	4,263,000
本多通信工業	2,400	1,316.00	3,158,400
船井電機	8,400	863.00	7,249,200

横河電機	81,200	1,572.00	127,646,400
新電元工業	29,000	404.00	11,716,000
アズビル	22,700	3,050.00	69,235,000
東亜ディーケーケー	3,800	484.00	1,839,200
日本光電工業	31,300	2,457.00	76,904,100
チノー	2,700	1,026.00	2,770,200
共和電業	8,500	371.00	3,153,500
日本電子材料	3,000	481.00	1,443,000
堀場製作所	14,800	5,000.00	74,000,000
アドバンテスト	51,000	1,485.00	75,735,000
小野測器	3,700	844.00	3,122,800
エスペック	6,700	1,218.00	8,160,600
パナソニック デバイスSUNX	6,600	624.00	4,118,400
キーエンス	17,000	76,470.00	1,299,990,000
日置電機	3,900	2,011.00	7,842,900
シスメックス	58,200	6,600.00	384,120,000
日本マイクロニクス	14,000	1,157.00	16,198,000
メガチップス	7,000	2,191.00	15,337,000
OBARA GROUP	4,400	4,050.00	17,820,000
澤藤電機	5,000	185.00	925,000
コーセル	10,400	1,207.00	12,552,800
イリソ電子工業	2,400	5,980.00	14,352,000
新日本無線	6,400	317.00	2,028,800
オブテックス	5,500	2,974.00	16,357,000
千代田インテグレ	4,000	2,182.00	8,728,000
アイ・オー・データ機器	2,400	982.00	2,356,800
レーザーテック	8,800	1,890.00	16,632,000
スタンレー電気	53,500	2,955.00	158,092,500
岩崎電気	28,000	158.00	4,424,000
ウシオ電機	45,500	1,368.00	62,244,000
岡谷電機産業	4,100	384.00	1,574,400
ヘリオス テクノ ホールディング	7,000	426.00	2,982,000
日本セラミック	6,100	1,994.00	12,163,400
遠藤照明	3,800	829.00	3,150,200
日本デジタル研究所	7,200	2,410.00	17,352,000
古河電池	5,000	706.00	3,530,000
双信電機	3,800	266.00	1,010,800
山一電機	7,100	891.00	6,326,100
図研	4,900	1,078.00	5,282,200
日本電子	27,000	441.00	11,907,000
カシオ計算機	62,500	1,309.00	81,812,500
ファナック	75,900	19,350.00	1,468,665,000

日本シイエムケイ	16,200	510.00	8,262,000
エンプラス	3,400	3,150.00	10,710,000
大真空	2,800	1,088.00	3,046,400
ローム	36,200	6,090.00	220,458,000
浜松ホトニクス	58,400	2,864.00	167,257,600
三井ハイテック	9,900	666.00	6,593,400
新光電気工業	28,300	668.00	18,904,400
京セラ	122,900	5,089.00	625,438,100
太陽誘電	36,400	1,052.00	38,292,800
村田製作所	78,500	13,230.00	1,038,555,000
ユーシン	9,900	741.00	7,335,900
双葉電子工業	12,300	1,730.00	21,279,000
北陸電気工業	30,000	117.00	3,510,000
ニチコン	23,600	929.00	21,924,400
日本ケミコン	64,000	180.00	11,520,000
K O A	10,400	961.00	9,994,400
市光工業	16,000	328.00	5,248,000
小糸製作所	44,800	5,430.00	243,264,000
ミツバ	13,800	1,338.00	18,464,400
S C R E E Nホールディングス	15,300	7,070.00	108,171,000
キャノン電子	6,900	1,600.00	11,040,000
キャノン	402,900	2,970.00	1,196,613,000
リコー	225,000	852.00	191,700,000
M U T O Hホールディングス	10,000	231.00	2,310,000
東京エレクトロン	49,900	9,787.00	488,371,300
トヨタ紡織	26,200	2,580.00	67,596,000
芦森工業	19,000	160.00	3,040,000
ユニプレス	14,400	1,871.00	26,942,400
豊田自動織機	68,200	4,680.00	319,176,000
モリタホールディングス	13,100	1,585.00	20,763,500
三櫻工業	9,600	709.00	6,806,400
デンソー	184,500	4,525.00	834,862,500
東海理化電機製作所	19,700	1,955.00	38,513,500
三井造船	270,000	147.00	39,690,000
川崎重工業	582,000	303.00	176,346,000
名村造船所	23,100	630.00	14,553,000
サノヤスホールディングス	10,700	264.00	2,824,800
日本車輛製造	27,000	269.00	7,263,000
ニチユ三菱フォークリフト	8,600	669.00	5,753,400
近畿車輛	1,100	2,383.00	2,621,300
日産自動車	895,700	983.30	880,741,810
いすゞ自動車	216,900	1,269.50	275,354,550

トヨタ自動車	930,800	5,838.00	5,434,010,400
日野自動車	106,800	1,167.00	124,635,600
三菱自動車工業	274,300	525.00	144,007,500
エフテック	4,200	1,140.00	4,788,000
レシップホールディングス	2,500	855.00	2,137,500
GMB	1,400	1,029.00	1,440,600
ファルテック	1,300	1,236.00	1,606,800
武蔵精密工業	8,700	2,414.00	21,001,800
日産車体	32,900	1,067.00	35,104,300
新明和工業	30,000	936.00	28,080,000
極東開発工業	14,900	1,331.00	19,831,900
日信工業	16,700	1,562.00	26,085,400
トピー工業	6,200	2,472.00	15,326,400
ティラド	29,000	231.00	6,699,000
曙ブレーキ工業	34,800	266.00	9,256,800
タチエス	12,700	1,564.00	19,862,800
NOK	36,200	2,079.00	75,259,800
フタバ産業	23,400	653.00	15,280,200
KYB	84,000	472.00	39,648,000
大同メタル工業	9,500	1,100.00	10,450,000
プレス工業	39,800	444.00	17,671,200
ミクニ	10,200	364.00	3,712,800
カルソニックカンセイ	51,000	1,294.00	65,994,000
太平洋工業	15,400	1,288.00	19,835,200
ケーヒン	17,200	1,665.00	28,638,000
河西工業	10,200	1,147.00	11,699,400
アイシン精機	68,500	4,540.00	310,990,000
富士機工	7,500	369.00	2,767,500
マツダ	237,000	1,563.00	370,431,000
今仙電機製作所	6,900	871.00	6,009,900
本田技研工業	673,500	2,980.50	2,007,366,750
スズキ	148,300	4,018.00	595,869,400
富士重工業	232,400	3,805.00	884,282,000
安永	3,200	512.00	1,638,400
ヤマハ発動機	105,700	2,428.00	256,639,600
ショーワ	19,600	624.00	12,230,400
TBK	9,600	450.00	4,320,000
エクセディ	10,200	2,917.00	29,753,400
豊田合成	24,200	2,330.00	56,386,000
愛三工業	13,100	854.00	11,187,400
盟和産業	1,200	1,082.00	1,298,400
ヨロズ	7,100	1,603.00	11,381,300

エフ・シー・シー	12,200	1,925.00	23,485,000
シマノ	30,200	18,390.00	555,378,000
テイ・エス テック	17,400	2,724.00	47,397,600
ジャムコ	4,600	1,916.00	8,813,600
テルモ	114,700	4,000.00	458,800,000
クリエートメディック	2,500	927.00	2,317,500
日機装	25,900	964.00	24,967,600
島津製作所	96,000	1,620.00	155,520,000
JMS	14,000	273.00	3,822,000
長野計器	5,900	620.00	3,658,000
ブイ・テクノロジー	1,500	12,570.00	18,855,000
東京計器	26,000	198.00	5,148,000
愛知時計電機	1,000	3,355.00	3,355,000
オーバル	7,400	252.00	1,864,800
東京精密	14,500	2,797.00	40,556,500
マニー	9,900	2,402.00	23,779,800
ニコン	130,400	1,589.00	207,205,600
トプコン	37,700	1,750.00	65,975,000
オリンパス	119,500	3,520.00	420,640,000
理研計器	6,600	1,320.00	8,712,000
タムロン	6,600	1,691.00	11,160,600
HOYA	157,000	4,360.00	684,520,000
ノーリツ鋼機	7,600	760.00	5,776,000
エー・アンド・デイ	6,800	440.00	2,992,000
シチズン時計	84,500	585.00	49,432,500
リズム時計工業	30,000	181.00	5,430,000
大研医器	6,700	796.00	5,333,200
メニコン	5,100	3,010.00	15,351,000
松風	4,000	1,287.00	5,148,000
セイコーホールディングス	53,000	335.00	17,755,000
ニプロ	51,800	1,198.00	62,056,400
スノーピーク	1,100	3,375.00	3,712,500
パラマウントベッドホールディングス	7,200	4,060.00	29,232,000
トランザクション	1,500	1,746.00	2,619,000
SHO-BI	2,500	413.00	1,032,500
ニホンフラッシュ	3,500	1,114.00	3,899,000
前田工織	7,500	1,123.00	8,422,500
永大産業	10,000	462.00	4,620,000
アートネイチャー	8,000	615.00	4,920,000
ダンロップスポーツ	4,700	1,016.00	4,775,200
バンダイナムコホールディングス	82,500	3,080.00	254,100,000
アイフィスジャパン	1,700	434.00	737,800

共立印刷	12,400	303.00	3,757,200
S H O E I	3,400	1,863.00	6,334,200
フランスベッドホールディングス	9,400	892.00	8,384,800
パイロットコーポレーション	13,100	4,460.00	58,426,000
萩原工業	2,100	2,376.00	4,989,600
トッパン・フォームズ	13,400	1,039.00	13,922,600
フジシールインターナショナル	8,400	4,320.00	36,288,000
タカラトミー	29,100	1,101.00	32,039,100
廣済堂	7,500	306.00	2,295,000
A s - m e エステール	2,000	654.00	1,308,000
アーク	31,500	78.00	2,457,000
タカノ	3,300	739.00	2,438,700
プロネクサス	7,000	994.00	6,958,000
ホクシン	5,300	204.00	1,081,200
ウッドワン	13,000	261.00	3,393,000
大建工業	5,300	2,075.00	10,997,500
凸版印刷	211,000	982.00	207,202,000
大日本印刷	216,000	1,054.00	227,664,000
図書印刷	10,000	450.00	4,500,000
共同印刷	23,000	354.00	8,142,000
日本写真印刷	12,600	2,543.00	32,041,800
光村印刷	7,000	210.00	1,470,000
宝印刷	3,600	1,419.00	5,108,400
アシックス	74,300	2,289.00	170,072,700
ツツミ	2,800	1,731.00	4,846,800
小松ウオール工業	2,500	1,717.00	4,292,500
ヤマハ	50,400	3,415.00	172,116,000
河合楽器製作所	2,900	2,019.00	5,855,100
クリナップ	8,800	934.00	8,219,200
ピジョン	45,200	2,769.00	125,158,800
兼松サステック	8,000	158.00	1,264,000
キングジム	6,200	823.00	5,102,600
リンテック	17,800	2,294.00	40,833,200
T A S A K I	2,100	1,491.00	3,131,100
イトーキ	15,800	655.00	10,349,000
任天堂	46,100	24,410.00	1,125,301,000
三菱鉛筆	6,200	5,340.00	33,108,000
タカラスタANDARD	15,500	1,866.00	28,923,000
コクヨ	38,900	1,316.00	51,192,400
ナカバヤシ	13,000	238.00	3,094,000
グローブライド	3,600	1,757.00	6,325,200
岡村製作所	26,100	1,017.00	26,543,700

美津濃	40,000	573.00	22,920,000
アデランス	13,000	617.00	8,021,000
東京電力ホールディングス	634,900	407.00	258,404,300
中部電力	246,600	1,542.50	380,380,500
関西電力	305,400	1,040.00	317,616,000
中国電力	103,500	1,207.00	124,924,500
北陸電力	73,300	1,173.00	85,980,900
東北電力	187,000	1,266.00	236,742,000
四国電力	67,400	996.00	67,130,400
九州電力	165,300	1,071.00	177,036,300
北海道電力	70,000	794.00	55,580,000
沖縄電力	11,000	2,336.00	25,696,000
電源開発	59,600	2,243.00	133,682,800
エフオン	3,100	741.00	2,297,100
イーレックス	3,100	3,120.00	9,672,000
東京瓦斯	803,000	481.40	386,564,200
大阪瓦斯	726,000	433.00	314,358,000
東邦瓦斯	189,000	926.00	175,014,000
北海道瓦斯	18,000	268.00	4,824,000
広島ガス	15,400	358.00	5,513,200
西部瓦斯	84,000	244.00	20,496,000
静岡ガス	23,000	822.00	18,906,000
メタウォーター	4,200	2,871.00	12,058,200
SBSホールディングス	7,400	933.00	6,904,200
東武鉄道	400,000	517.00	206,800,000
相鉄ホールディングス	120,000	485.00	58,200,000
東京急行電鉄	407,000	806.00	328,042,000
京浜急行電鉄	205,000	1,136.00	232,880,000
小田急電鉄	119,900	2,077.00	249,032,300
京王電鉄	209,000	861.00	179,949,000
京成電鉄	56,100	2,495.00	139,969,500
富士急行	20,000	1,013.00	20,260,000
新京成電鉄	10,000	407.00	4,070,000
東日本旅客鉄道	144,800	9,197.00	1,331,725,600
西日本旅客鉄道	72,000	6,421.00	462,312,000
東海旅客鉄道	62,200	17,350.00	1,079,170,000
西武ホールディングス	103,400	1,916.00	198,114,400
鴻池運輸	10,600	1,387.00	14,702,200
西日本鉄道	90,000	477.00	42,930,000
ハマキョウレックス	4,900	1,843.00	9,030,700
サカイ引越センター	2,600	2,250.00	5,850,000
近鉄グループホールディングス	753,000	424.00	319,272,000

阪急阪神ホールディングス	94,500	3,445.00	325,552,500
南海電気鉄道	158,000	485.00	76,630,000
京阪ホールディングス	168,000	686.00	115,248,000
神戸電鉄	18,000	361.00	6,498,000
名古屋鉄道	273,000	544.00	148,512,000
山陽電気鉄道	27,000	527.00	14,229,000
日本通運	289,000	541.00	156,349,000
ヤマトホールディングス	133,800	2,278.50	304,863,300
山九	99,000	611.00	60,489,000
丸運	4,000	234.00	936,000
丸全昭和運輸	25,000	428.00	10,700,000
センコー	33,700	768.00	25,881,600
トナミホールディングス	15,000	287.00	4,305,000
ニッコンホールディングス	25,400	2,182.00	55,422,800
日本石油輸送	800	2,283.00	1,826,400
福山通運	45,000	593.00	26,685,000
セイノーホールディングス	53,100	1,186.00	62,976,600
神奈川中央交通	9,000	720.00	6,480,000
日立物流	15,600	2,131.00	33,243,600
丸和運輸機関	1,900	2,966.00	5,635,400
C & F ロジホールディングス	7,800	1,134.00	8,845,200
日本郵船	633,000	187.00	118,371,000
商船三井	393,000	257.00	101,001,000
川崎汽船	284,000	238.00	67,592,000
N S ユナイテッド海運	38,000	142.00	5,396,000
飯野海運	41,000	375.00	15,375,000
共栄タンカー	10,000	192.00	1,920,000
乾汽船	5,500	978.00	5,379,000
日本航空	134,900	3,191.00	430,465,900
A N A ホールディングス	1,389,000	293.20	407,254,800
パスコ	7,000	372.00	2,604,000
トランコム	2,200	5,350.00	11,770,000
日新	31,000	312.00	9,672,000
三菱倉庫	49,000	1,423.00	69,727,000
三井倉庫ホールディングス	43,000	311.00	13,373,000
住友倉庫	55,000	525.00	28,875,000
澁澤倉庫	19,000	304.00	5,776,000
東陽倉庫	12,800	266.00	3,404,800
日本トランスシティ	17,000	380.00	6,460,000
ケイヒン	14,000	141.00	1,974,000
中央倉庫	4,300	1,000.00	4,300,000
安田倉庫	5,800	679.00	3,938,200



東洋埠頭	22,000	176.00	3,872,000
宇徳	6,100	378.00	2,305,800
上組	89,000	923.00	82,147,000
サンリツ	1,800	486.00	874,800
キムラユニティ	1,900	1,106.00	2,101,400
キューソー流通システム	2,400	2,283.00	5,479,200
郵船ロジスティクス	6,900	1,004.00	6,927,600
近鉄エクスプレス	13,400	1,443.00	19,336,200
東海運	4,000	436.00	1,744,000
エーアイティー	4,600	921.00	4,236,600
内外トランスライン	2,200	1,003.00	2,206,600
NEC ネットエスアイ	8,100	2,015.00	16,321,500
システナ	5,900	1,736.00	10,242,400
デジタルアーツ	3,300	2,781.00	9,177,300
新日鉄住金ソリューションズ	12,300	1,967.00	24,194,100
キューブシステム	3,200	652.00	2,086,400
コア	3,100	1,200.00	3,720,000
ソフトクリエイティブホールディングス	3,500	1,184.00	4,144,000
T I S	24,500	2,340.00	57,330,000
ネオス	2,200	457.00	1,005,400
電算システム	2,600	1,700.00	4,420,000
グリー	44,900	594.00	26,670,600
コーエーテクモホールディングス	17,500	1,931.00	33,792,500
三菱総合研究所	2,900	3,040.00	8,816,000
ボルテージ	1,500	967.00	1,450,500
電算	800	2,016.00	1,612,800
A G S	1,900	1,110.00	2,109,000
ファインデックス	5,500	869.00	4,779,500
ヒト・コミュニケーションズ	1,700	1,463.00	2,487,100
ブレインパッド	1,100	934.00	1,027,400
K L a b	14,100	638.00	8,995,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	5,300	857.00	4,542,100
イーブックイニシアティブジャパン	1,200	825.00	990,000
ネクソン	81,200	1,678.00	136,253,600
アイスタイル	11,300	645.00	7,288,500
エムアップ	2,100	585.00	1,228,500
エイチーム	4,100	2,312.00	9,479,200
テクノスジャパン	2,900	2,491.00	7,223,900
コロプラ	20,600	1,024.00	21,094,400
モバイルクリエイティブ	4,900	349.00	1,710,100
ブロードリーフ	9,100	982.00	8,936,200
ハーツユナイテッドグループ	3,900	1,614.00	6,294,600

メディアドゥ	1,600	1,362.00	2,179,200
ブイキューブ	4,100	676.00	2,771,600
サイバーリンクス	1,100	907.00	997,700
ディー・エル・イー	2,200	668.00	1,469,600
VOYAGE GROUP	2,500	883.00	2,207,500
オブティム	800	5,830.00	4,664,000
ベリサーブ	900	2,848.00	2,563,200
ティーガイア	7,400	1,641.00	12,143,400
日本アジアグループ	8,400	351.00	2,948,400
豆蔵ホールディングス	5,400	1,025.00	5,535,000
テクマトリックス	2,300	1,936.00	4,452,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	154,900	257.00	39,809,300
GMOペイメントゲートウェイ	6,000	4,700.00	28,200,000
ザッパラス	4,200	399.00	1,675,800
インターネットイニシアティブ	10,900	1,595.00	17,385,500
さくらインターネット	5,700	894.00	5,095,800
GMOクラウド	1,600	1,086.00	1,737,600
SRAホールディングス	3,900	2,301.00	8,973,900
Minor iソリューションズ	1,700	996.00	1,693,200
朝日ネット	6,700	425.00	2,847,500
アドソル日進	1,500	1,202.00	1,803,000
フリービット	4,100	820.00	3,362,000
コムチュア	1,200	3,245.00	3,894,000
サイバーコム	1,000	816.00	816,000
gumi	7,700	688.00	5,297,600
PCIホールディングス	900	2,302.00	2,071,800
パイブドHD	1,300	1,085.00	1,410,500
LINE	12,300	4,145.00	50,983,500
ソルクシーズ	2,100	544.00	1,142,400
フェイス	2,000	1,183.00	2,366,000
ハイマックス	1,000	1,248.00	1,248,000
野村総合研究所	50,200	3,590.00	180,218,000
サイバネットシステム	6,000	622.00	3,732,000
CEホールディングス	1,100	1,050.00	1,155,000
インテージホールディングス	4,200	1,756.00	7,375,200
東邦システムサイエンス	2,400	588.00	1,411,200
ソースネクスト	4,500	519.00	2,335,500
ティー・ワイ・オー	14,600	147.00	2,146,200
フォーカスシステムズ	2,900	481.00	1,394,900
クレスコ	1,700	2,000.00	3,400,000
フジ・メディア・ホールディングス	76,900	1,494.00	114,888,600
オービック	25,500	5,220.00	133,110,000

ジャストシステム	12,000	1,084.00	13,008,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,200	1,148.00	3,673,600
ヤフー	529,500	410.00	217,095,000
トレンドマイクロ	39,100	3,580.00	139,978,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,400	1,334.00	1,867,600
日本オラクル	11,900	5,510.00	65,569,000
アルファシステムズ	2,400	1,755.00	4,212,000
フューチャー	10,000	711.00	7,110,000
CAC Holdings	5,500	850.00	4,675,000
ソフトバンク・テクノロジー	1,800	2,913.00	5,243,400
トーセ	2,000	750.00	1,500,000
オービックビジネスコンサルタント	3,800	4,760.00	18,088,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,700	2,942.00	49,131,400
アイティフォー	9,600	604.00	5,798,400
東計電算	1,300	2,041.00	2,653,300
エクスネット	700	1,535.00	1,074,500
大塚商会	19,900	5,230.00	104,077,000
サイボウズ	9,800	428.00	4,194,400
ソフトブレーン	10,100	359.00	3,625,900
電通国際情報サービス	4,600	1,761.00	8,100,600
デジタルガレージ	11,500	1,926.00	22,149,000
EMシステムズ	2,500	1,495.00	3,737,500
ウェザーニューズ	2,500	3,265.00	8,162,500
C I J	6,700	501.00	3,356,700
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,434.00	1,003,800
日本エンタープライズ	7,600	258.00	1,960,800
WOWOW	3,500	2,961.00	10,363,500
フュージョンパートナー	4,600	910.00	4,186,000
日本コロムビア	2,200	685.00	1,507,000
イマジカ・ロボットホールディングス	6,200	615.00	3,813,000
ネットワンシステムズ	32,000	739.00	23,648,000
システムソフト	13,100	148.00	1,938,800
アルゴグラフィックス	3,400	1,999.00	6,796,600
マーベラス	12,500	733.00	9,162,500
エイベックス・グループ・ホールディングス	13,600	1,378.00	18,740,800
日本ユニシス	20,400	1,259.00	25,683,600
兼松エレクトロニクス	4,700	2,196.00	10,321,200
東京放送ホールディングス	48,700	1,665.00	81,085,500
日本テレビホールディングス	67,400	1,855.00	125,027,000
朝日放送	7,300	663.00	4,839,900
テレビ朝日ホールディングス	20,200	2,000.00	40,400,000
スカパーJ S A Tホールディングス	48,100	491.00	23,617,100

テレビ東京ホールディングス	6,000	2,247.00	13,482,000
日本BS放送	1,700	995.00	1,691,500
U-NEXT	1,900	602.00	1,143,800
ワイヤレスゲート	2,500	1,640.00	4,100,000
コネクシオ	6,500	1,411.00	9,171,500
日本通信	61,800	154.00	9,517,200
クロップス	1,600	529.00	846,400
日本電信電話	593,000	4,454.00	2,641,222,000
KDDI	730,800	2,930.50	2,141,609,400
光通信	8,900	9,440.00	84,016,000
NTTドコモ	552,000	2,475.50	1,366,476,000
エムティーアイ	11,300	690.00	7,797,000
GMOインターネット	27,000	1,522.00	41,094,000
カドカワ	21,400	1,553.00	33,234,200
学研ホールディングス	25,000	336.00	8,400,000
ゼンリン	9,800	1,777.00	17,414,600
昭文社	4,100	596.00	2,443,600
インプレスホールディングス	6,100	136.00	829,600
アイネット	4,200	1,043.00	4,380,600
松竹	49,000	1,175.00	57,575,000
東宝	48,300	3,080.00	148,764,000
東映	27,000	804.00	21,708,000
AOI Pro.	3,400	805.00	2,737,000
エヌ・ティ・ティ・データ	45,600	5,500.00	250,800,000
ピー・シー・エー	1,100	1,227.00	1,349,700
ビジネスブレイン太田昭和	1,300	966.00	1,255,800
DTS	7,600	2,354.00	17,890,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	28,400	3,135.00	89,034,000
シーイーシー	4,400	1,898.00	8,351,200
カブコン	17,300	2,611.00	45,170,300
アイ・エス・ビー	1,400	861.00	1,205,400
ジャステック	4,700	1,092.00	5,132,400
SCSK	20,100	3,790.00	76,179,000
日本システムウエア	2,400	1,529.00	3,669,600
アイネス	9,300	1,161.00	10,797,300
TKC	6,800	2,899.00	19,713,200
富士ソフト	11,000	2,783.00	30,613,000
NSD	15,700	1,668.00	26,187,600
コナミホールディングス	33,400	4,280.00	142,952,000
福井コンピュータホールディングス	2,100	2,750.00	5,775,000
JBCホールディングス	6,200	673.00	4,172,600
ミロク情報サービス	5,500	2,053.00	11,291,500

ソフトバンクグループ	362,700	6,574.00	2,384,389,800
ハウスイ	6,000	113.00	678,000
高千穂交易	2,900	948.00	2,749,200
伊藤忠食品	1,800	4,025.00	7,245,000
エレマテック	3,000	1,729.00	5,187,000
JALUX	2,400	1,784.00	4,281,600
あらた	3,300	2,416.00	7,972,800
トーメンデバイス	1,100	1,942.00	2,136,200
東京エレクトロン デバイス	2,700	1,489.00	4,020,300
フィールズ	5,700	1,198.00	6,828,600
双日	436,200	267.00	116,465,400
アルフレッサ ホールディングス	87,400	1,779.00	155,484,600
横浜冷凍	18,300	1,043.00	19,086,900
神栄	10,000	138.00	1,380,000
山下医科器械	600	1,708.00	1,024,800
ラサ商事	3,200	607.00	1,942,400
ラクーン	3,200	481.00	1,539,200
アルコニックス	4,200	1,369.00	5,749,800
神戸物産	4,000	3,150.00	12,600,000
あい ホールディングス	13,200	2,561.00	33,805,200
ディーブイエックス	2,600	1,401.00	3,642,600
ダイワボウホールディングス	63,000	266.00	16,758,000
マクニカ・富士エレホールディングス	13,700	1,407.00	19,275,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,900	984.00	13,677,600
八洲電機	5,700	567.00	3,231,900
UKCホールディングス	4,800	1,850.00	8,880,000
OCHIホールディングス	2,200	1,090.00	2,398,000
TOKAIホールディングス	32,500	719.00	23,367,500
大阪工機	900	681.00	612,900
三洋貿易	4,100	1,395.00	5,719,500
ビューティガレージ	600	1,173.00	703,800
ウイン・パートナーズ	2,700	1,810.00	4,887,000
ミタチ産業	1,900	616.00	1,170,400
シップヘルスケアホールディングス	14,200	3,035.00	43,097,000
明治電機工業	2,500	1,067.00	2,667,500
デリカフーズ	1,600	961.00	1,537,600
スターティア	1,700	487.00	827,900
コメダホールディングス	10,000	1,661.00	16,610,000
富士興産	2,700	409.00	1,104,300
協栄産業	9,000	133.00	1,197,000
小野建	6,400	1,169.00	7,481,600
佐島電機	5,900	732.00	4,318,800

エコトレーディング	1,700	656.00	1,115,200
伯東	5,100	949.00	4,839,900
コンドーテック	5,900	793.00	4,678,700
中山福	4,300	774.00	3,328,200
ナガイレーベン	10,700	2,210.00	23,647,000
三菱食品	8,100	3,355.00	27,175,500
松田産業	5,400	1,471.00	7,943,400
第一興商	12,000	4,515.00	54,180,000
メディカルホールディングス	73,900	1,528.00	112,919,200
S P K	1,600	2,135.00	3,416,000
萩原電気	2,500	1,957.00	4,892,500
アズワン	5,800	4,530.00	26,274,000
スズデン	2,700	949.00	2,562,300
尾家産業	2,400	1,056.00	2,534,400
シモジマ	4,500	1,051.00	4,729,500
ドウシシャ	8,700	2,039.00	17,739,300
小津産業	1,600	2,014.00	3,222,400
高速	4,400	1,039.00	4,571,600
たけびし	2,600	1,070.00	2,782,000
黒田電気	10,100	2,113.00	21,341,300
リックス	1,700	1,391.00	2,364,700
丸文	6,500	625.00	4,062,500
ハピネット	6,200	1,118.00	6,931,600
橋本総業ホールディングス	1,500	1,554.00	2,331,000
日本ライフライン	3,200	5,470.00	17,504,000
エクセル	3,200	1,398.00	4,473,600
マルカキカイ	2,400	1,337.00	3,208,800
I D O M	19,900	533.00	10,606,700
日本エム・ディ・エム	5,600	787.00	4,407,200
進和	4,400	1,559.00	6,859,600
エスケイジャパン	1,400	279.00	390,600
ダイトエレクトロン	3,400	862.00	2,930,800
シークス	5,300	3,600.00	19,080,000
田中商事	2,300	654.00	1,504,200
オーハシテクニカ	4,200	1,241.00	5,212,200
白銅	1,900	1,223.00	2,323,700
伊藤忠商事	541,000	1,385.50	749,555,500
丸紅	727,000	557.60	405,375,200
高島	13,000	170.00	2,210,000
長瀬産業	44,400	1,335.00	59,274,000
蝶理	4,700	1,586.00	7,454,200
豊田通商	82,300	2,551.00	209,947,300

三共生興	11,200	357.00	3,998,400	
兼松	157,000	172.00	27,004,000	
ツカモトコーポレーション	13,000	112.00	1,456,000	
三井物産	668,000	1,464.50	978,286,000	
日本紙パルプ商事	38,000	347.00	13,186,000	
日立ハイテクノロジーズ	25,600	4,405.00	112,768,000	
カメイ	9,600	997.00	9,571,200	
東都水産	1,100	1,657.00	1,822,700	
OUGホールディングス	12,000	261.00	3,132,000	
スターゼン	3,100	4,820.00	14,942,000	
山善	28,400	827.00	23,486,800	
椿本興業	8,000	307.00	2,456,000	
住友商事	465,000	1,253.00	582,645,000	
内田洋行	18,000	425.00	7,650,000	
三菱商事	554,300	2,390.50	1,325,054,150	
第一実業	17,000	608.00	10,336,000	
キャノンマーケティングジャパン	21,100	1,776.00	37,473,600	
西華産業	24,000	305.00	7,320,000	
佐藤商事	6,600	786.00	5,187,600	
菱洋エレクトロ	7,100	1,287.00	9,137,700	
東京産業	7,400	396.00	2,930,400	
ユアサ商事	7,000	2,565.00	17,955,000	
神鋼商事	1,900	1,971.00	3,744,900	
小林産業	5,400	255.00	1,377,000	
阪和興業	74,000	648.00	47,952,000	
カナデン	7,100	1,014.00	7,199,400	
菱電商事	12,000	678.00	8,136,000	
フルサト工業	4,100	1,505.00	6,170,500	
岩谷産業	82,000	599.00	49,118,000	
すてきナイスグループ	32,000	140.00	4,480,000	
昭光通商	26,000	90.00	2,340,000	
ニチモウ	11,000	164.00	1,804,000	
極東貿易	11,000	208.00	2,288,000	
イワキ	11,000	209.00	2,299,000	
三愛石油	19,800	706.00	13,978,800	
稲畑産業	17,700	1,154.00	20,425,800	
G S I クレオス	18,000	112.00	2,016,000	
明和産業	6,900	329.00	2,270,100	
ワキタ	15,700	882.00	13,847,400	
東邦ホールディングス	23,700	1,965.00	46,570,500	
サンゲツ	25,300	1,867.00	47,235,100	
ミツウロコグループホールディングス	11,900	697.00	8,294,300	

シナネンホールディングス	3,200	2,019.00	6,460,800
伊藤忠エネクス	16,300	845.00	13,773,500
サンリオ	22,800	1,863.00	42,476,400
サンワテクノス	4,400	848.00	3,731,200
リョーサン	11,000	3,225.00	35,475,000
新光商事	8,100	1,142.00	9,250,200
トーホー	3,300	2,441.00	8,055,300
三信電気	8,200	869.00	7,125,800
東陽テクニカ	9,800	939.00	9,202,200
モスフードサービス	9,700	3,405.00	33,028,500
加賀電子	6,700	1,643.00	11,008,100
ソーダニッカ	7,600	484.00	3,678,400
立花エレテック	5,000	1,225.00	6,125,000
フォーバル	3,200	740.00	2,368,000
PALTAC	11,800	2,568.00	30,302,400
三谷産業	7,900	324.00	2,559,600
ヤマタネ	3,700	1,339.00	4,954,300
丸紅建材リース	7,000	189.00	1,323,000
日鉄住金物産	6,500	3,840.00	24,960,000
トラスコ中山	8,400	5,050.00	42,420,000
オートバックスセブン	27,400	1,485.00	40,689,000
加藤産業	11,500	2,398.00	27,577,000
イノテック	6,400	476.00	3,046,400
イエローハット	7,000	2,270.00	15,890,000
J Kホールディングス	7,400	547.00	4,047,800
日伝	3,100	2,959.00	9,172,900
北沢産業	6,200	172.00	1,066,400
杉本商事	4,300	1,366.00	5,873,800
因幡電機産業	10,400	3,760.00	39,104,000
バイテックホールディングス	3,000	1,167.00	3,501,000
ミスミグループ本社	83,000	1,995.00	165,585,000
アルテック	6,300	234.00	1,474,200
タキヒヨー	11,000	432.00	4,752,000
蔵王産業	1,200	1,329.00	1,594,800
スズケン	33,600	3,210.00	107,856,000
ジェコス	5,100	943.00	4,809,300
ルネサスイーストン	6,800	459.00	3,121,200
ローソン	25,600	7,780.00	199,168,000
サンエー	5,600	5,490.00	30,744,000
カワチ薬品	5,700	2,645.00	15,076,500
エービーシー・マート	13,400	6,490.00	86,966,000
ハードオフコーポレーション	3,300	1,041.00	3,435,300



アスクル	9,000	4,445.00	40,005,000
ゲオホールディングス	12,400	1,282.00	15,896,800
アダストリア	11,400	2,967.00	33,823,800
ジーフット	4,500	762.00	3,429,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	744.00	669,600
くらコーポレーション	4,800	5,050.00	24,240,000
キャンドウ	3,900	1,839.00	7,172,100
パルグループホールディングス	3,800	2,755.00	10,469,000
エディオン	28,700	990.00	28,413,000
サーラコーポレーション	9,300	627.00	5,831,100
ワッツ	3,200	1,093.00	3,497,600
ハローズ	2,500	2,273.00	5,682,500
あみやき亭	1,500	3,875.00	5,812,500
ひらまつ	10,400	605.00	6,292,000
ゲンキー	1,500	6,780.00	10,170,000
大黒天物産	1,800	5,050.00	9,090,000
ハニーズ	6,500	1,189.00	7,728,500
ファーマライズホールディングス	1,900	540.00	1,026,000
アルペン	6,600	2,102.00	13,873,200
クオール	8,400	1,444.00	12,129,600
ジェイアイエヌ	5,000	5,470.00	27,350,000
ビックカメラ	42,500	915.00	38,887,500
D C Mホールディングス	43,000	906.00	38,958,000
Monotaro	26,200	2,431.00	63,692,200
東京一番フーズ	2,000	533.00	1,066,000
ダイヤモンドダイニング	1,600	1,088.00	1,740,800
きちり	2,100	685.00	1,438,500
アークランドサービスホールディングス	2,300	2,963.00	6,814,900
J.フロント リテイリング	93,500	1,460.00	136,510,000
ドトール・日レスホールディングス	13,000	2,072.00	26,936,000
マツモトキヨシホールディングス	14,000	5,060.00	70,840,000
ブロンコビリー	3,900	2,964.00	11,559,600
スタートトゥデイ	67,400	1,794.00	120,915,600
トレジャー・ファクトリー	2,200	807.00	1,775,400
物語コーポレーション	2,000	4,325.00	8,650,000
ココカラファイン	7,700	3,880.00	29,876,000
三越伊勢丹ホールディングス	147,000	1,156.00	169,932,000
Hamee	1,100	810.00	891,000
ウエルシアホールディングス	7,300	7,170.00	52,341,000
クリエイトSDホールディングス	10,900	2,158.00	23,522,200
丸善CHIホールディングス	8,600	363.00	3,121,800
ミサワ	1,500	470.00	705,000

エー・ピーカンパニー	1,400	685.00	959,000	
チムニー	2,300	2,924.00	6,725,200	
シュッピン	2,800	1,157.00	3,239,600	
ネクステージ	1,500	1,522.00	2,283,000	
ジョイフル本田	12,000	2,749.00	32,988,000	
鳥貴族	1,800	2,664.00	4,795,200	
キリン堂ホールディングス	2,500	776.00	1,940,000	
ホットランド	3,500	1,006.00	3,521,000	
すかいらーく	31,700	1,548.00	49,071,600	
綿半ホールディングス	3,100	1,550.00	4,805,000	
ヨシックス	700	1,408.00	985,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	24,600	940.00	23,124,000	
ブックオフコーポレーション	4,300	781.00	3,358,300	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,000	948.00	2,844,000	
あさひ	5,500	1,242.00	6,831,000	
日本調剤	2,600	4,280.00	11,128,000	
コスモス薬品	3,700	22,000.00	81,400,000	
トーエル	3,600	925.00	3,330,000	
一六堂	1,800	370.00	666,000	
オンリー	900	777.00	699,300	
セブン&アイ・ホールディングス	309,200	4,335.00	1,340,382,000	
薬王堂	1,200	6,710.00	8,052,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	19,900	983.00	19,561,700	
ツルハホールディングス	17,000	11,690.00	198,730,000	
サンマルクホールディングス	4,800	2,906.00	13,948,800	
フェリシモ	2,200	1,012.00	2,226,400	
トリドールホールディングス	9,100	2,480.00	22,568,000	
クスリのアオキ	6,600	5,060.00	33,396,000	
サツドラホールディングス	1,000	1,972.00	1,972,000	
ダイユー・リックホールディングス	2,600	651.00	1,692,600	
メディカルシステムネットワーク	8,500	375.00	3,187,500	
総合メディカル	3,600	3,270.00	11,772,000	
はるやま商事	3,600	786.00	2,829,600	
ノジマ	8,600	1,255.00	10,793,000	
カップ・クリエイト	10,400	1,214.00	12,625,600	
ライトオン	5,500	999.00	5,494,500	
良品計画	9,800	22,720.00	222,656,000	
三城ホールディングス	9,300	451.00	4,194,300	
アドヴァン	7,500	984.00	7,380,000	
アルビス	2,000	2,238.00	4,476,000	
コナカ	9,600	498.00	4,780,800	

ハウス オブ ローゼ	1,000	1,464.00	1,464,000
G - 7ホールディングス	2,200	1,326.00	2,917,200
イオン北海道	7,400	537.00	3,973,800
コジマ	11,200	236.00	2,643,200
ヒマラヤ	2,400	799.00	1,917,600
コーナン商事	10,500	2,076.00	21,798,000
エコス	3,000	1,176.00	3,528,000
マルシェ	1,800	811.00	1,459,800
ドンキホーテホールディングス	47,800	4,130.00	197,414,000
西松屋チェーン	13,000	1,411.00	18,343,000
ゼンショーホールディングス	38,300	2,004.00	76,753,200
幸楽苑ホールディングス	4,800	1,567.00	7,521,600
ハークスレイ	1,900	950.00	1,805,000
サイゼリヤ	12,200	2,693.00	32,854,600
V Tホールディングス	25,100	579.00	14,532,900
魚力	2,400	1,259.00	3,021,600
ポブラ	1,800	481.00	865,800
ユナイテッドアローズ	9,800	2,930.00	28,714,000
ハイデイ日高	6,700	2,581.00	17,292,700
京都きもの友禅	4,800	917.00	4,401,600
コロワイド	24,600	1,917.00	47,158,200
ピーシーデポコーポレーション	9,800	487.00	4,772,600
壱番屋	6,700	3,835.00	25,694,500
トップカルチャー	2,900	470.00	1,363,000
P L A N T	1,800	1,065.00	1,917,000
スギホールディングス	16,200	5,400.00	87,480,000
スクロール	11,400	339.00	3,864,600
ヨンドシーホールディングス	5,700	2,638.00	15,036,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	32,400	6,670.00	216,108,000
木曽路	9,100	2,209.00	20,101,900
サトレストランシステムズ	8,800	814.00	7,163,200
千趣会	13,500	718.00	9,693,000
タカキュー	6,300	184.00	1,159,200
ケーヨー	12,500	525.00	6,562,500
上新電機	17,000	906.00	15,402,000
日本瓦斯	13,600	3,090.00	42,024,000
ベスト電器	23,800	138.00	3,284,400
ロイヤルホールディングス	12,300	1,815.00	22,324,500
いなげや	8,200	1,392.00	11,414,400
島忠	19,100	2,859.00	54,606,900
チヨダ	8,700	2,522.00	21,941,400
ライフコーポレーション	5,700	3,240.00	18,468,000

リンガーハット	7,200	2,328.00	16,761,600
MrMax	9,500	404.00	3,838,000
テンアライド	6,800	367.00	2,495,600
AOKIホールディングス	14,800	1,290.00	19,092,000
オークワ	11,000	1,111.00	12,221,000
コメリ	11,400	2,534.00	28,887,600
青山商事	15,500	3,665.00	56,807,500
しまむら	8,600	13,100.00	112,660,000
はせがわ	4,200	440.00	1,848,000
高島屋	124,000	871.00	108,004,000
松屋	16,600	907.00	15,056,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,900	1,558.00	59,048,200
近鉄百貨店	28,000	345.00	9,660,000
パルコ	7,100	983.00	6,979,300
丸井グループ	78,000	1,398.00	109,044,000
アクシアル リテイリング	5,700	3,815.00	21,745,500
イオン	304,000	1,475.50	448,552,000
イズミ	14,700	4,860.00	71,442,000
東武ストア	900	2,748.00	2,473,200
平和堂	15,100	2,145.00	32,389,500
フジ	8,300	2,184.00	18,127,200
ヤオコー	8,400	4,100.00	34,440,000
ゼビオホールディングス	10,100	1,588.00	16,038,800
ケーズホールディングス	34,100	1,935.00	65,983,500
Olympicグループ	4,600	597.00	2,746,200
日産東京販売ホールディングス	11,100	261.00	2,897,100
アインホールディングス	8,900	7,230.00	64,347,000
元気寿司	1,900	2,042.00	3,879,800
ヤマダ電機	247,200	554.00	136,948,800
アークランドサカモト	12,600	1,239.00	15,611,400
ニトリホールディングス	31,900	12,230.00	390,137,000
グルメ杵屋	5,000	983.00	4,915,000
愛眼	5,400	190.00	1,026,000
ケーユーホールディングス	3,900	778.00	3,034,200
吉野家ホールディングス	25,800	1,568.00	40,454,400
松屋フーズ	3,600	3,530.00	12,708,000
サガミチェーン	9,300	1,255.00	11,671,500
関西スーパーマーケット	6,000	1,350.00	8,100,000
王将フードサービス	5,400	4,025.00	21,735,000
プレナス	8,300	2,164.00	17,961,200
ミニストップ	5,500	1,804.00	9,922,000
アークス	13,900	2,566.00	35,667,400

パローホールディングス	15,900	2,780.00	44,202,000	
藤久	700	1,706.00	1,194,200	
ベルク	3,300	4,040.00	13,332,000	
大庄	4,000	1,531.00	6,124,000	
ファーストリテイリング	12,300	36,890.00	453,747,000	
サンドラッグ	14,100	7,850.00	110,685,000	
サクスパー ホールディングス	7,000	1,173.00	8,211,000	
ヤマザワ	1,600	1,693.00	2,708,800	
やまや	1,600	1,506.00	2,409,600	
ペルーナ	18,500	655.00	12,117,500	
島根銀行	1,600	1,259.00	2,014,400	
じもとホールディングス	53,000	175.00	9,275,000	
めぶきフィナンシャルグループ	356,200	372.00	132,506,400	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	10,700	3,385.00	36,219,500	
九州フィナンシャルグループ	121,100	701.00	84,891,100	
ゆうちょ銀行	209,100	1,244.00	260,120,400	
富山第一銀行	18,800	511.00	9,606,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	483,600	496.80	240,252,480	
西日本フィナンシャルホールディングス	50,100	1,015.00	50,851,500	
新生銀行	703,000	179.00	125,837,000	
あおぞら銀行	467,000	350.00	163,450,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,597,500	557.50	3,120,606,250	
りそなホールディングス	864,100	468.40	404,744,440	
三井住友トラスト・ホールディングス	154,200	3,679.00	567,301,800	
三井住友フィナンシャルグループ	591,500	3,643.00	2,154,834,500	
第四銀行	91,000	455.00	41,405,000	
北越銀行	8,000	2,525.00	20,200,000	
千葉銀行	285,000	667.00	190,095,000	
群馬銀行	164,100	538.00	88,285,800	
武蔵野銀行	11,800	2,967.00	35,010,600	
千葉興業銀行	20,200	461.00	9,312,200	
筑波銀行	30,700	312.00	9,578,400	
七十七銀行	116,000	481.00	55,796,000	
青森銀行	57,000	349.00	19,893,000	
秋田銀行	48,000	347.00	16,656,000	
山形銀行	41,000	444.00	18,204,000	
岩手銀行	4,800	4,445.00	21,336,000	
東邦銀行	66,000	403.00	26,598,000	
東北銀行	38,000	144.00	5,472,000	
みちのく銀行	37,000	207.00	7,659,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	300,000	459.00	137,700,000	
静岡銀行	201,000	876.00	176,076,000	

十六銀行	99,000	322.00	31,878,000
スルガ銀行	75,500	2,465.00	186,107,500
八十二銀行	142,500	585.00	83,362,500
山梨中央銀行	46,000	499.00	22,954,000
大垣共立銀行	99,000	380.00	37,620,000
福井銀行	63,000	270.00	17,010,000
北國銀行	78,000	365.00	28,470,000
清水銀行	2,500	3,100.00	7,750,000
富山銀行	1,400	4,080.00	5,712,000
滋賀銀行	69,000	542.00	37,398,000
南都銀行	7,100	3,910.00	27,761,000
百五銀行	66,000	399.00	26,334,000
京都銀行	132,000	762.00	100,584,000
紀陽銀行	29,000	1,761.00	51,069,000
三重銀行	3,300	2,056.00	6,784,800
ほくほくフィナンシャルグループ	49,100	1,535.00	75,368,500
広島銀行	218,000	456.00	99,408,000
山陰合同銀行	44,400	776.00	34,454,400
中国銀行	52,400	1,424.00	74,617,600
鳥取銀行	2,300	1,680.00	3,864,000
伊予銀行	79,000	647.00	51,113,000
百十四銀行	81,000	360.00	29,160,000
四国銀行	57,000	247.00	14,079,000
阿波銀行	63,000	693.00	43,659,000
大分銀行	42,000	382.00	16,044,000
宮崎銀行	49,000	310.00	15,190,000
佐賀銀行	45,000	268.00	12,060,000
十八銀行	45,000	326.00	14,670,000
沖縄銀行	7,200	3,645.00	26,244,000
琉球銀行	15,200	1,384.00	21,036,800
セブン銀行	276,900	307.00	85,008,300
みずほフィナンシャルグループ	10,029,000	176.60	1,771,121,400
高知銀行	27,000	115.00	3,105,000
山口フィナンシャルグループ	69,000	1,175.00	81,075,000
長野銀行	2,400	1,973.00	4,735,200
名古屋銀行	6,200	3,725.00	23,095,000
北洋銀行	120,600	406.00	48,963,600
愛知銀行	2,500	5,780.00	14,450,000
第三銀行	4,200	1,735.00	7,287,000
中京銀行	3,000	2,313.00	6,939,000
大光銀行	26,000	262.00	6,812,000
愛媛銀行	8,700	1,327.00	11,544,900

トマト銀行	2,800	1,586.00	4,440,800
みなと銀行	6,700	1,861.00	12,468,700
京葉銀行	60,000	452.00	27,120,000
関西アーバン銀行	10,300	1,163.00	11,978,900
栃木銀行	40,800	469.00	19,135,200
北日本銀行	2,300	3,045.00	7,003,500
東和銀行	138,000	102.00	14,076,000
福島銀行	80,000	95.00	7,600,000
大東銀行	38,000	170.00	6,460,000
トモニホールディングス	60,900	557.00	33,921,300
フィデアホールディングス	71,700	187.00	13,407,900
池田泉州ホールディングス	78,400	479.00	37,553,600
F P G	27,100	836.00	22,655,600
S B Iホールディングス	83,500	1,267.00	105,794,500
ジャフコ	12,300	3,540.00	43,542,000
大和証券グループ本社	691,000	611.00	422,201,000
野村ホールディングス	1,510,100	536.60	810,319,660
岡三証券グループ	63,000	562.00	35,406,000
丸三証券	23,500	853.00	20,045,500
東洋証券	26,000	183.00	4,758,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	84,800	534.00	45,283,200
光世証券	18,000	121.00	2,178,000
水戸証券	22,900	238.00	5,450,200
いちよし証券	16,500	761.00	12,556,500
松井証券	42,200	827.00	34,899,400
だいこう証券ビジネス	4,500	509.00	2,290,500
マネックスグループ	80,400	238.00	19,135,200
カブドットコム証券	55,100	323.00	17,797,300
極東証券	9,900	1,492.00	14,770,800
岩井コスモホールディングス	7,000	883.00	6,181,000
藍澤証券	13,800	559.00	7,714,200
マネーパートナーズグループ	11,000	462.00	5,082,000
かんぽ生命保険	27,900	2,212.00	61,714,800
S O M P Oホールディングス	154,400	3,403.00	525,423,200
アニコム ホールディングス	5,000	2,570.00	12,850,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	220,800	3,146.00	694,636,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	70,800	1,457.00	103,155,600
第一生命ホールディングス	445,400	1,584.00	705,513,600
東京海上ホールディングス	299,300	4,175.00	1,249,577,500
T & Dホールディングス	269,200	1,319.50	355,209,400
アドバンスクリエイト	1,700	1,579.00	2,684,300
全国保証	20,800	4,105.00	85,384,000

クレディセゾン	56,000	1,800.00	100,800,000	
アクリーティブ	6,100	361.00	2,202,100	
芙蓉総合リース	8,400	5,070.00	42,588,000	
興銀リース	13,900	2,263.00	31,455,700	
東京センチュリー	14,900	3,600.00	53,640,000	
日本証券金融	32,500	465.00	15,112,500	
アイフル	123,900	329.00	40,763,100	
ポケットカード	5,500	502.00	2,761,000	
リコーリース	5,800	3,065.00	17,777,000	
イオンフィナンシャルサービス	47,200	1,818.00	85,809,600	
アコム	148,400	500.00	74,200,000	
ジャックス	41,000	476.00	19,516,000	
オリエントコーポレーション	159,700	191.00	30,502,700	
日立キャピタル	17,400	2,439.00	42,438,600	
アプラスフィナンシャル	35,400	104.00	3,681,600	
オリックス	523,100	1,681.50	879,592,650	
三菱UFJリース	187,400	480.00	89,952,000	
日本取引所グループ	229,700	1,525.00	350,292,500	
イー・ギャランティ	2,200	2,595.00	5,709,000	
アサックス	1,300	1,526.00	1,983,800	
NECキャピタルソリューション	3,000	1,647.00	4,941,000	
いちご	70,200	432.00	30,326,400	
日本駐車場開発	89,200	142.00	12,666,400	
ヒューリック	154,100	987.00	152,096,700	
三栄建築設計	3,000	1,735.00	5,205,000	
野村不動産ホールディングス	49,100	1,736.00	85,237,600	
三重交通グループホールディングス	13,200	381.00	5,029,200	
サムティ	6,000	1,076.00	6,456,000	
ディア・ライフ	5,100	337.00	1,718,700	
エー・ディー・ワークス	68,700	38.00	2,610,600	
日本商業開発	4,100	1,753.00	7,187,300	
プレサンスコーポレーション	11,500	1,234.00	14,191,000	
ユニゾホールディングス	6,100	2,616.00	15,957,600	
THEグローバル社	2,700	445.00	1,201,500	
日本管理センター	5,300	1,356.00	7,186,800	
サンセイランディック	1,600	685.00	1,096,000	
エストラスト	1,400	562.00	786,800	
フージャースホールディングス	9,600	539.00	5,174,400	
オープンハウス	10,700	2,238.00	23,946,600	
東急不動産ホールディングス	178,800	633.00	113,180,400	
飯田グループホールディングス	61,600	1,972.00	121,475,200	
ムゲンエステート	2,600	666.00	1,731,600	



シーアールイー	1,100	1,547.00	1,701,700
パーク24	37,300	3,255.00	121,411,500
パラカ	2,100	1,767.00	3,710,700
三井不動産	392,000	2,479.50	971,964,000
三菱地所	549,000	2,169.50	1,191,055,500
平和不動産	14,000	1,531.00	21,434,000
東京建物	85,700	1,386.00	118,780,200
ダイビル	19,100	905.00	17,285,500
京阪神ビルディング	12,300	545.00	6,703,500
住友不動産	177,000	2,748.50	486,484,500
大京	137,000	222.00	30,414,000
テオーシー	28,700	949.00	27,236,300
東京楽天地	12,000	505.00	6,060,000
レオパレス21	93,300	574.00	53,554,200
スターツコーポレーション	7,500	1,940.00	14,550,000
フジ住宅	9,500	692.00	6,574,000
空港施設	9,000	554.00	4,986,000
明和地所	4,100	583.00	2,390,300
住友不動産販売	6,700	2,495.00	16,716,500
ゴールドクレスト	6,700	1,927.00	12,910,900
日本エスリード	2,900	1,227.00	3,558,300
日神不動産	8,800	436.00	3,836,800
日本エスコン	10,000	308.00	3,080,000
タカラレーベン	32,300	662.00	21,382,600
サンヨーハウジング名古屋	3,800	927.00	3,522,600
イオンモール	47,600	1,558.00	74,160,800
ファースト住建	2,800	1,432.00	4,009,600
トーセイ	10,100	787.00	7,948,700
穴吹興産	8,000	245.00	1,960,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	45,900	928.00	42,595,200
サンフロンティア不動産	8,000	949.00	7,592,000
エフ・ジェー・ネクスト	6,500	616.00	4,004,000
インテリックス	1,600	695.00	1,112,000
ランドビジネス	4,400	261.00	1,148,400
グランディハウス	6,600	364.00	2,402,400
日本空港ビルデング	23,600	4,165.00	98,294,000
日本工営	26,000	468.00	12,168,000
ネクスト	19,400	888.00	17,227,200
ジェイエイシーリクルートメント	4,800	1,428.00	6,854,400
日本M&Aセンター	22,600	3,445.00	77,857,000
アコーディア・ゴルフ	23,700	1,052.00	24,932,400
中広	1,000	680.00	680,000

タケエイ	7,000	841.00	5,887,000
トラスト・テック	3,200	1,481.00	4,739,200
パソナグループ	6,900	814.00	5,616,600
C D S	1,900	974.00	1,850,600
リンクアンドモチベーション	18,900	313.00	5,915,700
G C A	7,100	784.00	5,566,400
エス・エム・エス	10,800	2,757.00	29,775,600
テンプホールディングス	60,500	1,801.00	108,960,500
リニカル	4,700	1,324.00	6,222,800
クックパッド	17,500	1,030.00	18,025,000
エスクリ	3,100	566.00	1,754,600
アイ・ケイ・ケイ	3,700	588.00	2,175,600
学情	3,400	1,113.00	3,784,200
スタジオアリス	3,200	2,170.00	6,944,000
シミックホールディングス	4,000	1,399.00	5,596,000
N J S	1,800	1,299.00	2,338,200
総合警備保障	28,500	4,460.00	127,110,000
カカクコム	55,800	1,785.00	99,603,000
アイロムグループ	2,200	929.00	2,043,800
ルネサンス	4,100	1,427.00	5,850,700
ディップ	10,100	2,674.00	27,007,400
オプトホールディング	5,800	693.00	4,019,400
ツクイ	18,700	663.00	12,398,100
キャリアデザインセンター	1,800	916.00	1,648,800
エムスリー	67,700	3,080.00	208,516,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	721.00	4,253,900
アウトソーシング	4,500	3,780.00	17,010,000
ウェルネット	5,900	1,344.00	7,929,600
ワールドホールディングス	1,900	1,700.00	3,230,000
ディー・エヌ・エー	35,100	3,265.00	114,601,500
博報堂D Yホールディングス	108,400	1,302.00	141,136,800
ぐるなび	11,300	2,603.00	29,413,900
エスアールジータカミヤ	8,700	554.00	4,819,800
ファンコミュニケーションズ	20,000	737.00	14,740,000
ジェイコムホールディングス	1,700	1,882.00	3,199,400
W D Bホールディングス	2,900	1,097.00	3,181,300
ティア	4,000	616.00	2,464,000
バリューコマース	7,500	332.00	2,490,000
インフォマート	16,600	1,123.00	18,641,800
J Pホールディングス	23,100	253.00	5,844,300
E P Sホールディングス	9,800	1,323.00	12,965,400
レッグス	1,900	819.00	1,556,100

プレステージ・インターナショナル	11,100	761.00	8,447,100
アミューズ	4,400	1,752.00	7,708,800
ドリームインキュベータ	2,400	2,882.00	6,916,800
クイック	4,100	920.00	3,772,000
T A C	5,200	204.00	1,060,800
ケネディクス	105,200	437.00	45,972,400
電通	87,100	5,230.00	455,533,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,000	607.00	2,428,000
ぴあ	2,400	2,446.00	5,870,400
イオンファンタジー	2,300	2,969.00	6,828,700
シーティーエス	2,200	1,103.00	2,426,600
ネクシィーズグループ	2,900	1,379.00	3,999,100
みらかホールディングス	20,000	5,020.00	100,400,000
アルプス技研	3,200	2,339.00	7,484,800
ダイオーズ	1,500	954.00	1,431,000
日本空調サービス	7,800	544.00	4,243,200
オリエンタルランド	84,500	5,994.00	506,493,000
ダスキン	20,100	2,149.00	43,194,900
明光ネットワークジャパン	9,800	973.00	9,535,400
ファルコホールディングス	3,700	1,402.00	5,187,400
ラウンドワン	24,500	734.00	17,983,000
リゾートトラスト	30,300	2,095.00	63,478,500
ビー・エム・エル	10,300	2,677.00	27,573,100
ワタベウェディング	1,400	413.00	578,200
りらいあコミュニケーションズ	13,000	992.00	12,896,000
リソー教育	13,500	564.00	7,614,000
早稲田アカデミー	1,100	899.00	988,900
ユー・エス・エス	94,700	1,735.00	164,304,500
東京個別指導学院	2,700	571.00	1,541,700
サイバーエージェント	41,100	2,832.00	116,395,200
楽天	399,500	1,197.50	478,401,250
クリーク・アンド・リバー社	2,900	710.00	2,059,000
テー・オー・ダブリュー	6,400	625.00	4,000,000
セントラルスポーツ	2,700	2,542.00	6,863,400
フルキャストホールディングス	8,200	939.00	7,699,800
リソルホールディングス	8,000	316.00	2,528,000
テクノプロ・ホールディングス	12,700	3,670.00	46,609,000
アトラ	1,000	990.00	990,000
インターワークス	1,700	967.00	1,643,900
K e e P e r 技研	1,000	1,466.00	1,466,000
ファーストロジック	500	1,717.00	858,500
デザインワン・ジャパン	600	2,028.00	1,216,800

イー・ガーディアン	2,600	1,219.00	3,169,400
リブセンス	5,400	436.00	2,354,400
ジャパンマテリアル	2,900	3,745.00	10,860,500
ベクトル	6,400	1,165.00	7,456,000
ウチヤマホールディングス	3,900	413.00	1,610,700
サクセスホールディングス	800	1,174.00	939,200
キャリアリンク	1,900	743.00	1,411,700
I B J	6,200	780.00	4,836,000
アサンテ	2,900	1,631.00	4,729,900
N・フィールド	3,800	1,233.00	4,685,400
M&Aキャピタルパートナーズ	1,000	2,902.00	2,902,000
ライドオン・エクスプレス	2,000	1,039.00	2,078,000
E R Iホールディングス	2,200	802.00	1,764,400
アビスト	1,200	2,576.00	3,091,200
ウィルグループ	1,700	1,115.00	1,895,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	700	2,568.00	1,797,600
日本ビューホテル	1,200	1,256.00	1,507,200
リクルートホールディングス	170,800	4,165.00	711,382,000
エラン	1,100	1,301.00	1,431,100
日本郵政	204,100	1,309.00	267,166,900
ベルシステム24ホールディングス	12,100	973.00	11,773,300
ソラスト	3,600	1,152.00	4,147,200
リログループ	2,900	16,740.00	48,546,000
東祥	1,700	4,775.00	8,117,500
エイチ・アイ・エス	12,800	2,907.00	37,209,600
ラックランド	1,500	1,846.00	2,769,000
共立メンテナンス	6,300	6,050.00	38,115,000
イチネンホールディングス	8,300	1,065.00	8,839,500
建設技術研究所	5,000	957.00	4,785,000
スペース	4,300	1,229.00	5,284,700
燦ホールディングス	1,600	1,475.00	2,360,000
スバル興業	6,000	419.00	2,514,000
東京テアトル	30,000	121.00	3,630,000
タナベ経営	1,600	1,202.00	1,923,200
ナガワ	1,500	4,130.00	6,195,000
よみうりランド	16,000	458.00	7,328,000
東京都競馬	54,000	236.00	12,744,000
カナモト	10,900	2,400.00	26,160,000
東京ドーム	31,300	1,070.00	33,491,000
西尾レントオール	6,300	2,784.00	17,539,200
トランス・コスモス	9,100	2,632.00	23,951,200
乃村工藝社	16,800	1,732.00	29,097,600

藤田観光	26,000	309.00	8,034,000	
KNT-CTホールディングス	44,000	130.00	5,720,000	
日本管財	6,700	1,521.00	10,190,700	
トーカイ	3,500	3,525.00	12,337,500	
白洋舎	800	2,484.00	1,987,200	
セコム	81,300	7,814.00	635,278,200	
セントラル警備保障	3,500	2,102.00	7,357,000	
丹青社	13,600	756.00	10,281,600	
メイテック	9,500	4,000.00	38,000,000	
アサツー ディ・ケイ	12,800	2,897.00	37,081,600	
応用地質	7,500	1,230.00	9,225,000	
船井総研ホールディングス	10,100	1,612.00	16,281,200	
進学会	3,400	491.00	1,669,400	
オオバ	6,000	421.00	2,526,000	
学究社	2,100	1,285.00	2,698,500	
ベネッセホールディングス	26,200	2,914.00	76,346,800	
イオンディライト	8,800	2,988.00	26,294,400	
ナック	5,000	876.00	4,380,000	
ニチイ学館	13,800	885.00	12,213,000	
ダイセキ	13,700	2,130.00	29,181,000	
ステップ	2,700	1,216.00	3,283,200	
合計	112,439,300		150,397,368,930	

## (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28年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	平成28年11月10日現在
項目	金額（円）
預金	83,558,330
金銭信託	49,694,711
コール・ローン	1,608,907,619
国債証券	181,810,107,423
派生商品評価勘定	17,642,217
未収入金	4,241,862
未収利息	1,453,732,036
前払金	12,300,301
前払費用	48,227,917
差入委託証拠金	87,880,472
流動資産合計	185,176,292,888
資産合計	185,176,292,888
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,359,753
未払金	476,737
未払解約金	109,355,908
未払利息	3,296
その他未払費用	21
流動負債合計	122,195,715
負債合計	122,195,715
純資産の部	
元本等	
元本	74,103,205,642
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	110,950,891,531
元本等合計	185,054,097,173
純資産合計	185,054,097,173
負債純資産合計	185,176,292,888

## 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>

	平成28年11月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成28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	74,103,205,642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 2.4972円 (1万口当たり純資産額) (24,972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28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。

平成28年11月10日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

平成28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28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	10,788,042,714円
期中一部解約元本額	16,631,441,615円
期末元本額	74,103,205,642円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,611,097,073円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	1,007,659,212円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	702,351,901円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,793,790,050円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,978,988円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,470,279,006円
世界経済インデックスファンド	2,184,805,526円
マイセレクション25	6,093,573円
マイセレクション50	4,627,252円
マイセレクション75	3,079,598円
DCマイセレクション25	1,302,472,084円
DCマイセレクション50	1,132,654,418円
DCマイセレクション75	670,767,064円
DC外国債券インデックス・オープン	1,549,272,150円
DCマイセレクションS25	547,269,080円
DCマイセレクションS50	441,188,583円
DCマイセレクションS75	180,084,584円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,960,184円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	46,711,261円

区分	平成28年11月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	18,719,794円
DC世界経済インデックスファンド	2,716,432,267円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	442,951,373円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	167,917,813円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	8,004,527円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	3,083,027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)	89,486,400円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	278,004,831円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	411,141,647円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	358,059,108円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	773,098,069円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,401,778,861円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	902,517,319円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,903,176,588円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,281,366,706円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	1,087,442,475円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	924,996,720円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,097,689,651円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	323,960,194円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	461,410,293円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,556,481,300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)	918,974,083円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	589,059,567円
外国債券ファンド・シリーズ1	516,807,707円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,933,375,364円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,528,120,331円
分散投資コア戦略ファンドA	641,709,771円
分散投資コア戦略ファンドS	1,305,681,574円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	68,770,205円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	861,399,373円
コア投資戦略ファンド(切替型)	455,613,012円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	170,810,554円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	100,201,909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)	523,726,986円
SMT インデックスバランス・オープン	220,889,574円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	18,757,059,133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)	799,880,499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)	778,265,450円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28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		1,434,040,518
合計		1,434,040,518

(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28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	1,147,708,989	-	1,135,408,688	12,300,301
	合計	1,147,708,989	-	1,135,408,688	12,300,301

(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	1,434,771,735	-	1,452,354,500	17,582,765
	アメリカドル	665,287,025	-	673,791,800	8,504,775
	カナダドル	66,447,560	-	66,920,500	472,940
	ユーロ	597,230,090	-	602,596,800	5,366,710
	イギリスポンド	105,807,060	-	109,045,400	3,238,340
	合計	1,434,771,735	-	1,452,354,500	17,582,765

(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 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,968,994.40	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,992,887.35	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,396,204.07	
		T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	2,996,353.86	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,899,199.07	
		T 0.875% 01/15/18	5,200,000.00	5,205,489.95	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,505,648.44	
		T 0.875% 03/31/18	4,750,000.00	4,753,312.84	
		T 0.875% 07/15/18	10,000,000.00	10,001,226.40	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,469,678.28	
		T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	3,996,406.96	
		T 0.875% 11/15/17	1,500,000.00	1,501,703.77	
		T 1.125% 01/15/19	5,800,000.00	5,818,437.09	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,983,618.20	
		T 1.125% 06/15/18	3,000,000.00	3,012,422.25	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,643,378.75	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,916,062.05	
		T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	3,046,026.12	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	905,243.71	
		T 1.25% 01/31/20	1,320,000.00	1,322,365.80	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,405,429.90	
		T 1.25% 03/31/21	10,000,000.00	9,915,064.40	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,388,068.91	
		T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,540,683.43	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,521,188.53	
		T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,589,612.30	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	5,031,148.40	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,790,650.99	
		T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,118,670.21	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	5,025,976.70	
		T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,903,689.96	
		T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	1,004,231.20	

T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,555,630.84	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,218,231.24	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,866,170.90	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,428,695.42	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,933,166.69	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	4,003,033.56	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,999,975.82	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,025,710.69	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,022,729.66	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,481,759.02	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,023,151.44	
T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,361,764.28	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,450,376.34	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,933,416.92	
T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,090,882.40	
T 1.5% 08/15/26	2,200,000.00	2,088,838.42	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,861,976.82	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,588,339.89	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,053,330.05	
T 1.5% 12/31/18	2,550,000.00	2,578,624.38	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,806,835.48	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,042,420.12	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,071,136.90	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,956,585.93	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	3,035,494.47	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	5,056,086.55	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,490,351.64	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,609,156.87	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,109,990.24	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,078,531.68	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,549,976.06	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,519,742.37	
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,517,314.60	
T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,784,955.45	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,821,970.46	
T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	6,982,919.72	
T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	2,005,838.54	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,061,009.88	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,308,498.72	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,041,556.24	
T 1.875% 10/31/22	3,150,000.00	3,179,543.47	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,484,375.16	

T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,806,807.36
T 1% 05/15/18	5,550,000.00	5,562,798.63
T 1% 05/31/18	5,000,000.00	5,011,327.10
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,986,811.04
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,480,620.07
T 1% 09/15/18	5,200,000.00	5,207,908.57
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,988,404.00
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,273,195.20
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,086,970.78
T 2.125% 05/15/25	5,100,000.00	5,149,684.14
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,715,660.55
T 2.125% 06/30/22	3,500,000.00	3,587,743.04
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,271,753.49
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,691,683.44
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,056,036.66
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,623,757.83
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,153,906.66
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,619,575.96
T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,425,689.71
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,101,076.39
T 2.25% 08/15/46	1,000,000.00	876,732.56
T 2.25% 11/15/24	8,150,000.00	8,336,153.33
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,949,973.00
T 2.25% 11/30/17	5,000,000.00	5,078,258.30
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,093,873.08
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,782,657.98
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,390,287.92
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,854,744.60
T 2.5% 02/15/46	10,700,000.00	9,918,224.18
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,763,245.31
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,748,623.69
T 2.625% 01/31/18	8,000,000.00	8,176,892.48
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,129,608.35
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,763,288.08
T 2.625% 11/15/20	2,000,000.00	2,098,206.04
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,782,191.41
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,181,393.95
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,894,768.01
T 2.75% 08/15/42	2,000,000.00	1,975,367.32
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,316,804.85
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,141,448.64
T 2.75% 12/31/17	1,200,000.00	1,226,723.98
T 2.875% 03/31/18	5,250,000.00	5,397,585.95

T 2.875% 05/15/43	10,300,000.00	10,384,816.48	
T 2.875% 08/15/45	8,400,000.00	8,426,958.79	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,552,608.00	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,638,438.16	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,414,225.56	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,094,776.16	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,887,760.73	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,331,006.09	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,053,688.90	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,276,484.98	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,950,580.90	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,124,136.35	
T 2% 10/31/21	400,000.00	408,738.66	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,452,328.28	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,633,065.90	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,031,523.46	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,057,660.48	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,256,638.55	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,682,307.65	
T 3.125% 08/15/44	6,500,000.00	6,864,953.87	
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,543,044.20	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	6,207,476.49	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	5,891,632.00	
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,279,012.42	
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	6,002,137.13	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,783,533.95	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,886,681.32	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,314,735.58	
T 3.75% 08/15/41	3,200,000.00	3,758,239.45	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,279,717.15	
T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,721,528.40	
T 3.875% 08/15/40	650,000.00	777,423.82	
T 3% 05/15/42	3,950,000.00	4,092,586.50	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,600,759.15	
T 3% 11/15/44	2,300,000.00	2,369,904.91	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,137,811.50	
T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,640,138.03	
T 4.25% 11/15/40	1,450,000.00	1,832,345.99	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,291,665.55	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,441,779.41	
T 4.375% 05/15/41	1,500,000.00	1,931,896.38	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,468,916.61	

	T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,412,200.86
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,313,193.22
	T 4.5% 08/15/39	250,000.00	326,602.80
	T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	5,183,338.68
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,533,386.62
	T 5.25% 02/15/29	400,000.00	530,142.51
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,717,434.36
	T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,211,075.98
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,610,739.27
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,271,558.19
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,015,749.32
	T 6.25% 05/15/30	400,000.00	586,741.23
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,120,714.24
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,230,716.40
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,502,096.80
	アメリカドル 小計	733,320,000.00	752,668,987.62 (79,504,425,162)
カナダドル	CAN 0.25% 05/01/18	3,950,000.00	3,930,408.00
	CAN 0.75% 03/01/21	1,250,000.00	1,248,275.00
	CAN 0.75% 09/01/20	1,350,000.00	1,351,566.00
	CAN 0.75% 09/01/21	1,730,000.00	1,724,014.20
	CAN 1.25% 02/01/18	1,000,000.00	1,008,205.00
	CAN 1.25% 03/01/18	3,100,000.00	3,126,861.50
	CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	505,930.00
	CAN 1.5% 03/01/20	1,400,000.00	1,438,059.00
	CAN 1.5% 06/01/23	1,550,000.00	1,594,926.75
	CAN 1.5% 06/01/26	1,480,000.00	1,495,939.60
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,436,995.00
	CAN 1.75% 09/01/19	1,350,000.00	1,392,059.25
	CAN 1% 06/01/27	270,000.00	257,154.75
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,670,714.00
	CAN 2.5% 06/01/24	1,350,000.00	1,478,938.50
	CAN 2.75% 06/01/22	1,550,000.00	1,703,853.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	1,232,542.50
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	518,859.60
	CAN 3.25% 06/01/21	1,690,000.00	1,875,781.70
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,977,678.00
	CAN 3.5% 12/01/45	1,810,000.00	2,395,426.40
	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,454,768.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,650,000.00	2,277,445.50
	CAN 4.25% 06/01/18	2,100,000.00	2,218,114.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,200,000.00	1,755,774.00
	CAN 5.75% 06/01/33	1,360,000.00	2,112,964.00



	CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,413,544.00
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	588,110.40
	カナダドル 小計	43,020,000.00	48,184,908.15 (3,794,561,516)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,300,000.00	10,935,374.50
	MBONO 10% 12/05/24	22,700,000.00	27,617,047.00
	MBONO 4.75% 06/14/18	22,400,000.00	22,006,992.00
	MBONO 5% 12/11/19	12,300,000.00	11,908,306.50
	MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	11,872,157.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	37,300,000.00	37,578,258.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	15,549,660.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	18,303,327.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	12,200,000.00	13,134,398.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	3,850,000.00	4,126,930.50
	MBONO 7.75% 12/14/17	17,700,000.00	18,098,250.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	17,720,664.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	19,042,485.00
	MBONO 8.5% 12/13/18	21,450,000.00	22,470,591.00
	MBONO 8% 06/11/20	14,500,000.00	15,327,007.50
	MBONO 8% 12/07/23	22,600,000.00	24,590,495.00
	メキシコペソ 小計	271,000,000.00	290,281,943.00 (1,547,202,756)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,570,000.00	1,635,304.15
	BGB 1.25% 06/22/18	980,000.00	1,010,335.90
	BGB 1.6% 06/22/47	550,000.00	577,258.00
	BGB 1.9% 06/22/38	710,000.00	814,302.55
	BGB 1% 06/22/26	1,550,000.00	1,626,794.75
	BGB 1% 06/22/31	1,200,000.00	1,223,976.00
	BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	412,340.25
	BGB 2.25% 06/22/23	1,660,000.00	1,916,586.20
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,541,785.00
	BGB 3.75% 06/22/45	1,090,000.00	1,733,045.50
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,909,625.00
	BGB 3% 06/22/34	1,000,000.00	1,335,385.00
	BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,204,900.00
	BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,887,263.50
	BGB 4.25% 03/28/41	1,650,000.00	2,734,503.75
	BGB 4.25% 09/28/21	1,750,000.00	2,142,516.25
	BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,841,862.50
	BGB 4.5% 03/28/26	850,000.00	1,177,560.25
	BGB 4% 03/28/18	550,000.00	585,719.75
	BGB 4% 03/28/22	1,110,000.00	1,367,342.40

BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,501,935.70
BGB 5.5% 03/28/28	2,000,000.00	3,102,470.00
BGB 5% 03/28/35	1,720,000.00	2,904,271.60
BTPS 0.1% 04/15/19	1,000,000.00	999,155.00
BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,005,210.00
BTPS 0.35% 11/01/21	850,000.00	836,680.50
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,394,197.00
BTPS 0.65% 11/01/20	1,500,000.00	1,516,455.00
BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,626,481.00
BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,493,842.50
BTPS 1.05% 12/01/19	1,200,000.00	1,230,438.00
BTPS 1.25% 12/01/26	550,000.00	525,046.50
BTPS 1.35% 04/15/22	650,000.00	669,061.25
BTPS 1.45% 09/15/22	1,000,000.00	1,032,145.00
BTPS 1.5% 06/01/25	1,600,000.00	1,598,840.00
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,487,000.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,590,336.00
BTPS 1.65% 03/01/32	2,300,000.00	2,166,243.50
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,682,050.00
BTPS 2.25% 09/01/36	950,000.00	926,478.00
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,645,075.00
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,650,189.50
BTPS 2.7% 03/01/47	1,220,000.00	1,188,121.40
BTPS 2.8% 03/01/67	550,000.00	500,453.25
BTPS 2% 12/01/25	1,450,000.00	1,496,559.50
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,688,554.50
BTPS 3.5% 03/01/30	2,460,000.00	2,885,063.40
BTPS 3.5% 06/01/18	1,600,000.00	1,687,160.00
BTPS 3.5% 11/01/17	4,000,000.00	4,144,200.00
BTPS 3.5% 12/01/18	800,000.00	856,812.00
BTPS 3.75% 03/01/21	3,250,000.00	3,705,373.75
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,769,836.50
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,592,720.00
BTPS 3.75% 09/01/24	3,300,000.00	3,875,503.50
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,148,745.00
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	5,088,690.00
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,951,954.25
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,534,808.00
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,874,218.50
BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,917,994.50
BTPS 4.5% 03/01/24	2,950,000.00	3,610,328.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,800,000.00	3,483,172.00
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,494,286.25

BTPS 4.5% 08/01/18	1,800,000.00	1,939,086.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,524,156.75	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,870,724.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,579,083.75	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,800,000.00	2,478,366.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,050,000.00	3,787,505.25	
BTPS 4% 09/01/20	3,550,000.00	4,039,261.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	1,900,000.00	2,667,448.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,300,000.00	4,535,800.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,290,800.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	1,950,000.00	2,466,116.25	
BTPS 5.75% 02/01/33	1,650,000.00	2,436,901.50	
BTPS 5% 03/01/22	2,250,000.00	2,745,843.75	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,383,361.00	
BTPS 5% 08/01/34	2,650,000.00	3,673,589.00	
BTPS 5% 09/01/40	2,550,000.00	3,578,682.75	
BTPS 6.5% 11/01/27	2,520,000.00	3,695,970.60	
BTPS 6% 05/01/31	3,150,000.00	4,676,127.75	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,114,868.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,220,192.00	
DBR 0.5% 02/15/25	2,400,000.00	2,506,092.00	
DBR 0.5% 02/15/26	3,350,000.00	3,466,630.25	
DBR 0% 08/15/26	550,000.00	539,319.00	
DBR 1.5% 02/15/23	1,350,000.00	1,502,253.00	
DBR 1.5% 05/15/23	1,950,000.00	2,175,576.00	
DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,811,851.60	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,607,520.75	
DBR 1.75% 02/15/24	1,300,000.00	1,484,060.50	
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	3,025,093.50	
DBR 1% 08/15/24	1,680,000.00	1,824,664.80	
DBR 1% 08/15/25	3,000,000.00	3,251,835.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,771,675.00	
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,261,680.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,600,000.00	4,055,418.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,150,000.00	3,060,030.50	
DBR 2.5% 08/15/46	2,100,000.00	3,026,194.50	
DBR 2% 01/04/22	3,150,000.00	3,543,057.00	
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,422,098.00	
DBR 3.25% 01/04/20	3,000,000.00	3,368,700.00	
DBR 3.25% 07/04/21	2,250,000.00	2,642,917.50	
DBR 3.25% 07/04/42	1,650,000.00	2,606,917.50	
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,887,065.00	

DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,547,756.75
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,960,337.50
DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,795,630.75
DBR 4.0% 01/04/37	2,700,000.00	4,437,396.00
DBR 4.25% 07/04/18	4,550,000.00	4,921,553.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,886,939.00
DBR 4.75% 07/04/28	1,740,000.00	2,634,908.10
DBR 4.75% 07/04/34	2,200,000.00	3,775,332.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,500,000.00	2,824,020.00
DBR 5.5% 01/04/31	1,550,000.00	2,641,851.00
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,472,970.75
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,345,296.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,050,000.00	1,856,337.00
DBR 6.5% 07/04/27	1,200,000.00	1,998,162.00
FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,588,462.50
FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,274,235.00
FRTR 0.5% 05/25/26	3,400,000.00	3,407,480.00
FRTR 0.5% 11/25/19	3,350,000.00	3,454,603.75
FRTR 1.25% 05/25/36	1,100,000.00	1,127,368.00
FRTR 1.5% 05/25/31	2,500,000.00	2,726,787.50
FRTR 1.75% 05/25/23	3,760,000.00	4,201,593.20
FRTR 1.75% 05/25/66	450,000.00	481,126.50
FRTR 1.75% 11/25/24	3,200,000.00	3,599,136.00
FRTR 1% 05/25/18	4,750,000.00	4,870,008.75
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,380,503.75
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,582,150.00
FRTR 1% 11/25/25	2,500,000.00	2,637,325.00
FRTR 2.25% 05/25/24	3,450,000.00	4,009,452.00
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,682,753.50
FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	4,289,705.00
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	6,080,129.00
FRTR 2.75% 10/25/27	4,950,000.00	6,091,494.75
FRTR 3.25% 05/25/45	2,450,000.00	3,565,093.00
FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,110,624.00
FRTR 3.5% 04/25/20	4,350,000.00	4,949,517.00
FRTR 3.5% 04/25/26	4,230,000.00	5,433,921.45
FRTR 3.75% 04/25/21	4,700,000.00	5,560,429.00
FRTR 3.75% 10/25/19	2,430,000.00	2,740,031.55
FRTR 3% 04/25/22	3,300,000.00	3,878,704.50
FRTR 4.25% 04/25/19	5,100,000.00	5,708,914.50
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,273,756.50
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,682,228.00
FRTR 4.5% 04/25/41	3,320,000.00	5,643,087.00

FRTR 4.75% 04/25/35	2,650,000.00	4,335,347.00
FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,784,640.00
FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	3,077,681.25
FRTR 4% 04/25/60	1,250,000.00	2,269,987.50
FRTR 4% 10/25/38	2,800,000.00	4,364,332.00
FRTR 5.5% 04/25/29	3,050,000.00	4,832,709.75
FRTR 5.75% 10/25/32	3,750,000.00	6,490,875.00
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,612,936.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,554,980.00
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,422,131.20
IRISH 0.8% 03/15/22	450,000.00	471,134.25
IRISH 1% 05/15/26	770,000.00	789,696.60
IRISH 2.4% 05/15/30	880,000.00	1,031,003.60
IRISH 2% 02/18/45	670,000.00	736,537.70
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,099,854.00
IRISH 3.9% 03/20/23	750,000.00	931,207.50
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,238,655.00
IRISH 4.5% 04/18/20	1,980,000.00	2,311,452.00
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	975,453.35
IRISH 5.4% 03/13/25	1,230,000.00	1,715,647.05
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	888,753.75
NETHER 0.25% 01/15/20	1,900,000.00	1,949,618.50
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,697,461.35
NETHER 0.5% 07/15/26	1,410,000.00	1,432,179.30
NETHER 1.25% 01/15/18	2,050,000.00	2,097,508.75
NETHER 1.25% 01/15/19	2,700,000.00	2,810,727.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,500,000.00	1,689,802.50
NETHER 2.25% 07/15/22	2,300,000.00	2,634,811.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,250,000.00	1,618,918.75
NETHER 2.75% 01/15/47	1,250,000.00	1,860,687.50
NETHER 2% 07/15/24	1,500,000.00	1,726,987.50
NETHER 3.25% 07/15/21	1,850,000.00	2,168,977.00
NETHER 3.5% 07/15/20	1,450,000.00	1,666,891.00
NETHER 3.75% 01/15/23	1,650,000.00	2,059,233.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,670,000.00	2,794,486.15
NETHER 4.0% 07/15/18	2,350,000.00	2,534,909.75
NETHER 4% 01/15/37	1,610,000.00	2,617,183.80
NETHER 4% 07/15/19	1,000,000.00	1,124,455.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,485,909.35
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	296,521.00
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,127,699.00
OBL 0.25% 10/11/19	1,150,000.00	1,179,859.75

OBL 0.25% 10/16/20	2,400,000.00	2,473,872.00	
OBL 0.5% 02/23/18	2,800,000.00	2,843,386.00	
OBL 0.5% 04/12/19	1,440,000.00	1,480,557.60	
OBL 0% 10/08/21	850,000.00	867,140.25	
OBL 1% 02/22/19	600,000.00	622,839.00	
OBL 1% 10/12/18	2,150,000.00	2,219,025.75	
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,075,378.50	
RAGB 0.75% 10/20/26	700,000.00	723,663.50	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,050,000.00	1,139,355.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	300,000.00	324,460.50	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,080,000.00	1,212,521.40	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	1,971,305.00	
RAGB 1.95% 06/18/19	800,000.00	852,924.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	740,000.00	933,817.10	
RAGB 3.15% 06/20/44	730,000.00	1,090,057.90	
RAGB 3.4% 11/22/22	850,000.00	1,033,804.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,099,998.80	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,333,744.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	370,000.00	693,688.95	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,450,000.00	1,684,501.25	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,300,000.00	2,094,469.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,550,000.00	1,730,590.50	
RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,434,975.75	
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,355,236.75	
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,377,484.50	
RFGB 0.375% 09/15/20	630,000.00	649,867.05	
RFGB 0.5% 04/15/26	470,000.00	476,072.40	
RFGB 0.75% 04/15/31	440,000.00	443,379.20	
RFGB 0.875% 09/15/25	550,000.00	579,400.25	
RFGB 0% 09/15/23	50,000.00	50,088.50	
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	568,015.25	
RFGB 1.5% 04/15/23	560,000.00	617,478.40	
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	653,776.05	
RFGB 2.625% 07/04/42	500,000.00	696,857.50	
RFGB 2.75% 07/04/28	640,000.00	805,459.20	
RFGB 2% 04/15/24	470,000.00	538,375.60	
RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	680,259.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	821,299.50	
RFGB 4.375% 07/04/19	670,000.00	758,996.10	
RFGB 4% 07/04/25	800,000.00	1,062,932.00	
SPGB 0.25% 01/31/19	140,000.00	141,071.00	
SPGB 0.25% 04/30/18	3,200,000.00	3,221,872.00	
SPGB 0.5% 10/31/17	1,050,000.00	1,057,812.00	

SPGB 0.75% 07/30/21	1,350,000.00	1,383,878.25	
SPGB 1.15% 07/30/20	1,350,000.00	1,404,519.75	
SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,924,824.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	550,000.00	575,657.50	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,350,000.00	2,505,699.25	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,300,000.00	2,393,012.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,450,000.00	2,661,974.00	
SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,406,633.75	
SPGB 2.75% 10/31/24	2,950,000.00	3,357,011.50	
SPGB 2.9% 10/31/46	900,000.00	987,205.50	
SPGB 3.45% 07/30/66	500,000.00	577,190.00	
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,509,298.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,396,624.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	2,730,000.00	2,930,900.70	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,860,389.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	1,650,000.00	1,861,101.00	
SPGB 4.4% 10/31/23	1,950,000.00	2,441,195.25	
SPGB 4.5% 01/31/18	2,830,000.00	2,993,531.55	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,410,249.85	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,371,654.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,495,872.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,915,956.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,554,544.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,600,000.00	2,402,352.00	
SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,410,415.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	2,850,000.00	3,997,324.50	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,300,000.00	2,040,031.50	
SPGB 5.4% 01/31/23	2,700,000.00	3,509,595.00	
SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,711,210.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,270,000.00	3,531,507.10	
SPGB 5.85% 01/31/22	2,150,000.00	2,765,555.75	
SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,394,991.20	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,579,557.00	
ユーロ 小計	529,280,000.00	637,693,315.70 (73,615,316,364)	
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	350,000.00	344,898.75
	UKT 1.25% 07/22/18	3,780,000.00	3,846,263.40
	UKT 1.5% 01/22/21	3,430,000.00	3,562,946.80
	UKT 1.5% 07/22/26	1,700,000.00	1,738,080.00
	UKT 1.75% 07/22/19	3,850,000.00	4,001,016.25
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	3,012,521.25
	UKT 2.25% 09/07/23	2,800,000.00	3,055,178.00

	UKT 2.5% 07/22/65	750,000.00	933,570.00
	UKT 2.75% 09/07/24	2,250,000.00	2,542,601.25
	UKT 2% 07/22/20	3,300,000.00	3,485,674.50
	UKT 2% 09/07/25	2,190,000.00	2,347,044.90
	UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	3,705,953.50
	UKT 3.5% 01/22/45	2,050,000.00	2,746,590.00
	UKT 3.5% 07/22/68	2,250,000.00	3,582,382.50
	UKT 3.75% 07/22/52	2,000,000.00	3,015,750.00
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	603,908.25
	UKT 3.75% 09/07/20	1,550,000.00	1,745,927.75
	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,300,910.00
	UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,703,467.75
	UKT 4.25% 06/07/32	2,200,000.00	2,988,634.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,420,000.00	2,036,833.80
	UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,865,383.20
	UKT 4.25% 12/07/40	2,000,000.00	2,899,850.00
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,221,914.50
	UKT 4.25% 12/07/49	1,830,000.00	2,909,452.95
	UKT 4.25% 12/07/55	1,920,000.00	3,266,505.60
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,528,321.00
	UKT 4.5% 09/07/34	2,100,000.00	2,984,289.00
	UKT 4.5% 12/07/42	2,300,000.00	3,525,037.50
	UKT 4.75% 03/07/20	2,100,000.00	2,405,046.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,800,000.00	2,532,618.00
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,888,532.00
	UKT 4% 01/22/60	1,750,000.00	2,948,408.75
	UKT 4% 03/07/22	1,100,000.00	1,293,501.00
	UKT 5% 03/07/18	1,800,000.00	1,914,417.00
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,492,895.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,889,300.00
	UKT 8% 06/07/21	1,250,000.00	1,671,012.50
	イギリスbond 小計	77,660,000.00	98,536,636.65 (12,947,714,055)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	446,104.00
	SWISS 2% 04/28/21	540,000.00	608,126.40
	SWISS 3% 01/08/18	1,140,000.00	1,194,275.40
	SWISS 4% 02/11/23	850,000.00	1,099,908.50
	SWISS 4% 04/08/28	530,000.00	789,893.45
	スイスフラン 小計	3,460,000.00	4,138,307.75 (444,247,336)
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	7,800,000.00	8,692,983.00
	SGB 1% 11/12/26	7,050,000.00	7,539,798.75
	SGB 2.5% 05/12/25	7,600,000.00	9,167,006.00



	SGB 3.5% 03/30/39	5,020,000.00	7,289,617.30
	SGB 3.5% 06/01/22	11,000,000.00	13,352,845.00
	SGB 4.25% 03/12/19	10,750,000.00	12,019,736.25
	SGB 5% 12/01/20	10,000,000.00	12,275,800.00
スウェーデンクローナ 小計		59,220,000.00	70,337,786.30 (821,545,343)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,770,000.00	3,787,587.05
	NGB 1.75% 03/13/25	3,800,000.00	3,910,770.00
	NGB 2% 05/24/23	5,800,000.00	6,086,549.00
	NGB 3.75% 05/25/21	8,650,000.00	9,688,519.00
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,218,303.25
	NGB 4.5% 05/22/19	7,950,000.00	8,698,452.75
ノルウェークローネ 小計		35,520,000.00	38,390,181.05 (487,555,299)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/18	5,050,000.00	5,136,658.00
	DGB 1.5% 11/15/23	5,800,000.00	6,423,326.00
	DGB 1.75% 11/15/25	9,100,000.00	10,303,884.50
	DGB 3% 11/15/21	10,000,000.00	11,646,750.00
	DGB 4.5% 11/15/39	14,130,000.00	25,082,092.35
	DGB 4% 11/15/17	5,900,000.00	6,177,477.00
	DGB 4% 11/15/19	10,800,000.00	12,275,280.00
	DGB 7% 11/10/24	3,500,000.00	5,451,985.00
デンマーククローネ 小計		64,280,000.00	82,497,452.85 (1,279,535,493)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,600,000.00	2,537,769.00
	POLGB 1.75% 07/25/21	2,450,000.00	2,363,649.75
	POLGB 2.5% 07/25/18	5,200,000.00	5,263,336.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,500,000.00	3,313,572.50
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,433,412.50
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,892,862.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,260,000.00	3,301,630.20
	POLGB 3.75% 04/25/18	1,500,000.00	1,544,595.00
	POLGB 4% 10/25/23	3,650,000.00	3,902,324.50
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,530,000.00	2,806,377.20
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,854,735.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	950,000.00	1,174,147.75
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,356,070.30
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,318,906.25
ポーランドズロチ 小計		38,580,000.00	40,063,387.95 (1,066,086,753)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,100,000.00	2,093,269.50
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,130,000.00	1,094,325.90
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	3,037,020.00

	ACGB 2.75% 06/21/35	650,000.00	625,443.00	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,521,258.25	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,600,000.00	1,634,904.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,650,000.00	2,831,975.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	980,000.00	1,044,214.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	360,000.00	365,230.80	
	ACGB 3.25% 10/21/18	700,000.00	720,366.50	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,100,000.00	1,213,322.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,000,000.00	922,870.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,560,000.00	4,111,016.80	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,020,000.00	3,293,672.40	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,300,000.00	1,581,794.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,350,000.00	4,053,466.50	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,000,000.00	3,242,295.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,770,000.00	2,893,528.15	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,650,000.00	3,185,088.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,850,000.00	3,325,465.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,570,000.00	3,080,260.65	
	オーストラリアドル 小計	42,730,000.00	46,870,787.45 (3,793,252,828)	
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	597,201.00	
	SIGB 1.625% 10/01/19	110,000.00	111,895.85	
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	254,107.50	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	908,632.35	
	SIGB 2.375% 06/01/25	270,000.00	280,760.85	
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	934,681.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	210,000.00	224,309.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	500,000.00	532,347.50	
	SIGB 2.75% 07/01/23	560,000.00	599,356.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	214,680.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	280,000.00	298,695.60	
	SIGB 2% 07/01/20	400,000.00	412,938.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	785,862.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	637,146.90	
	SIGB 3.375% 09/01/33	250,000.00	283,628.75	
	SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	807,156.40	
	SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	838,945.80	
	SIGB 4% 09/01/18	630,000.00	665,692.65	
	シンガポールドドル 小計	8,820,000.00	9,388,038.85 (708,609,172)	
マレーシア リンギット	MGS 3.26% 03/01/18	2,700,000.00	2,727,756.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	550,000.00	554,972.00	

	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,486,100.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	2,043,901.25	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,016,100.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	766,532.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,183,787.25	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,624,112.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,262,202.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,081,471.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,532,212.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,126,824.70	
	MGS 3.955% 09/15/25	540,000.00	548,067.60	
	MGS 4.048% 09/30/21	1,700,000.00	1,751,102.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	600,000.00	588,225.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,705,291.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,350,000.00	2,428,689.75	
	MGS 4.24% 02/07/18	1,150,000.00	1,174,713.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	1,150,000.00	1,189,864.75	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,888,803.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	500,000.00	520,440.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,350,000.00	1,404,533.25	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,111,954.50	
	マレーシアリングット 小計	34,120,000.00	34,717,656.55 (862,733,765)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	23,100,000.00	25,659,480.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,935,635.20	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,850,000.00	6,358,415.25	
	SAGB 6.75% 03/31/21	5,300,000.00	5,016,768.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	6,400,000.00	6,259,392.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,850,000.00	6,606,790.75	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,613,991.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	7,400,000.00	6,739,772.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	10,150,000.00	9,224,269.25	
	SAGB 8.75% 01/31/44	8,450,000.00	7,776,112.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,776,140.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	4,200,000.00	3,988,341.00	
	SAGB 8% 01/31/30	3,200,000.00	2,898,080.00	
	SAGB 8% 12/21/18	5,750,000.00	5,766,445.00	
	SAGB 9% 01/31/40	3,100,000.00	2,936,692.00	
	南アフリカランド 小計	129,120,000.00	119,556,324.20 (937,321,581)	
	合計		181,810,107,423 (181,810,107,423)	

## 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 174銘柄	100.0%	43.7%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 266銘柄	100.0%	40.5%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
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 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	100.0%	2.1%
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%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 15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28年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,406,207,139
金銭信託	13,459,746
コール・ローン	435,770,476
株式	249,156,600,766

	平成28年11月10日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	251,892,343
投資証券	6,385,273,455
派生商品評価勘定	59,575,598
未収入金	10,108,769,739
未収配当金	339,921,448
差入委託証拠金	1,623,213,167
流動資産合計	272,780,683,877
資産合計	272,780,683,877
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,904,731
前受金	27,718,718
未払解約金	11,019,412,285
未払利息	892
流動負債合計	11,118,036,626
負債合計	11,118,036,626
純資産の部	
元本等	
元本	141,784,624,521
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	119,878,022,730
元本等合計	261,662,647,251
純資産合計	261,662,647,251
負債純資産合計	272,780,683,877

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

平成28年11月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成28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	141,784,624,521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 1.8455円 (1万口当たり純資産額) (18,455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28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28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 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。

	平成28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>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28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	29,421,510,610円
期中一部解約元本額	19,307,376,529円
期末元本額	141,784,624,521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）	2,576,174,434円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,753,204円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,571,722,607円
世界経済インデックスファンド	3,112,076,995円
マイセクション25	4,465,124円
マイセクション50	19,470,166円
マイセクション75	22,184,850円
外国株式インデックス・オープン	1,138,872,326円
D C マイセクション25	953,868,794円
D C マイセクション50	4,732,309,758円



区分	平成28年11月10日現在
D Cマイセレクション75	5,158,827,598円
D C外国株式インデックス・オープン	6,794,545,177円
D CマイセレクションS25	385,752,767円
D CマイセレクションS50	1,843,283,190円
D CマイセレクションS75	1,386,959,173円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	160,022,363円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	190,214,419円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	102,488,175円
D C世界経済インデックスファンド	3,917,207,053円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,647,071,645円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	33,074,907円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	21,574,099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）	122,338,002円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	167,772,232円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	601,933,644円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	102,332,581円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	662,851,717円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,403,887,823円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	684,105,131円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,246,655,294円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,524,616,041円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,279,915,979円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	650,908,044円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	653,659,491円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	203,666,028円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,650,448,557円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	3,531,896,504円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,157,231,057円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,776,760,150円
コア投資戦略ファンド（成長型）	11,931,500,875円
分散投資コア戦略ファンドA	1,573,712,882円
分散投資コア戦略ファンドS	2,794,384,990円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	294,609,034円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	408,093,375円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,279,949,504円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	740,639,786円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	47,610,760円
SMT インデックスバランス・オープン	313,105,855円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	4,301,749,176円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,039,485,209円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,846,885,976円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成28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	6,614,978,511	
投資信託受益証券	18,342,478	
投資証券	431,731,459	
合計	6,164,904,574	

(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28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	株価指数先物取引 買建	5,554,154,986	-		5,581,873,704	27,718,718
	合計	5,554,154,986	-		5,581,873,704	27,718,718

## (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)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	10,814,333,949	-		10,853,381,800	39,047,851
	アメリカドル	7,126,432,053	-		7,163,526,300	37,094,247
	カナダドル	431,879,448	-		429,920,400	1,959,048
	ユーロ	1,315,341,629	-		1,312,552,800	2,788,829
	イギリスポンド	770,988,950	-		779,142,700	8,153,750
	スイスフラン	393,401,980	-		393,974,500	572,520
	スウェーデンクローナ	128,366,700	-		128,480,000	113,300

ノルウェークロ ネ	30,571,680	-	30,456,000	115,680
デンマーククロ ネ	80,806,440	-	80,652,000	154,440
オーストラリアド ル	317,983,770	-	315,549,000	2,434,770
香港ドル	158,515,110	-	159,237,000	721,890
シンガポールドル	51,485,384	-	51,319,600	165,784
イスラエルシェケ ル	8,560,805	-	8,571,500	10,695
合計	10,814,333,949	-	10,853,381,800	39,047,851

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,652	61.19	2,732,255.88	
	ANTERO RESOURCES CORP	12,683	24.84	315,045.72	
	APACHE CORP	30,392	58.02	1,763,343.84	
	BAKER HUGHES	33,455	59.00	1,973,845.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	40,136	21.96	881,386.56	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	37.50	588,412.50	
	CHEVRON CORP	153,105	107.64	16,480,222.20	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	125.70	955,194.30	
	CONCHO RESOURCES INC	11,275	132.68	1,495,967.00	
	CONOCOPHILLIPS	100,215	45.73	4,582,831.95	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	47.20	360,938.40	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,346	101.43	339,384.78	
	DEVON ENERGY CORPORATION	37,803	43.62	1,648,966.86	
	EOG RESOURCES INC	44,519	93.43	4,159,410.17	
	EQT CORPORATION	13,878	65.71	911,923.38	
	EXXON MOBIL	337,056	86.25	29,071,080.00	
	FMC TECHNOLOGIES INC	17,553	33.52	588,376.56	
HALLIBURTON CO	69,415	47.82	3,319,425.30		

HELMERICH & PAYNE	8,315	63.56	528,501.40
HESS CORP	24,429	49.00	1,197,021.00
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	26.22	326,386.56
KINDER MORGAN INC	153,170	21.32	3,265,584.40
MARATHON OIL CORP	72,860	14.88	1,084,156.80
MARATHON PETROLEUM CORP	42,555	43.57	1,854,121.35
MURPHY OIL CORP	13,898	27.97	388,727.06
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	32.95	998,747.45
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	38.77	623,150.21
NOBLE ENERGY INC	34,708	37.58	1,304,326.64
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,792	66.90	4,133,884.80
ONEOK INC	18,110	49.39	894,452.90
PHILLIPS 66	38,194	82.45	3,149,095.30
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,174	177.71	2,341,151.54
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	17,636	12.63	222,742.68
RANGE RESOURCES CORP	16,160	33.36	539,097.60
SCHLUMBERGER	112,952	79.94	9,029,382.88
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,763	9.78	379,102.14
SPECTRA ENERGY CORP	56,285	41.16	2,316,690.60
TESORO CORP	10,358	83.24	862,199.92
VALERO ENERGY CORP	37,829	62.03	2,346,532.87
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	73,816	5.06	373,508.96
WILLIAMS COS	57,217	30.72	1,757,706.24
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,682	137.22	2,289,104.04
ALBEMARLE CORP	9,790	80.42	787,311.80
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	4,845	108.84	527,329.80
AVERY DENNISON CORP	7,457	71.04	529,745.28
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	25.64	451,417.84
BALL CORP	13,571	78.59	1,066,544.89
CELANESE CORP-SERIES A	12,821	75.60	969,267.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,559	26.48	544,402.32
CROWN HOLDINGS INC	12,217	54.11	661,061.87
DOW CHEMICAL CO	91,744	53.87	4,942,249.28
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	71,375	70.28	5,016,235.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	73.86	875,831.88
ECOLAB INC	21,465	114.76	2,463,323.40
FMC CORP	10,402	54.25	564,308.50
FREEMPORT-MCMORAN INC	103,175	13.07	1,348,497.25
INT'L PAPER CO	31,551	45.65	1,440,303.15
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,933	124.03	859,899.99
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,487	80.94	2,386,677.78
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	225.39	1,124,470.71

MONSANTO CO	35,630	98.94	3,525,232.20
MOSAIC CO/THE	27,677	26.77	740,913.29
NEWMONT MINING CORP	42,952	37.04	1,590,942.08
NUCOR CORP	25,646	57.62	1,477,722.52
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,241	82.27	677,987.07
PPG INDUSTRIES INC	21,597	95.29	2,057,978.13
PRAXAIR INC	23,220	118.68	2,755,749.60
SEALED AIR CORP	17,217	46.76	805,066.92
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,361	257.74	1,639,484.14
VALSPAR CORP/THE	6,135	102.28	627,487.80
VULCAN MATERIALS CO	10,740	131.55	1,412,847.00
WESTROCK CO	20,913	47.69	997,340.97
WR GRACE & CO	5,635	69.05	389,096.75
3 M COMPANY	49,205	170.39	8,384,039.95
ACUITY BRANDS INC	3,505	241.65	846,983.25
AERCAP HOLDINGS NV	14,355	41.79	599,895.45
AGCO CORP	5,969	51.15	305,314.35
AMETEK INC	18,866	46.80	882,928.80
ARCONIC INC	38,031	17.53	666,683.43
B/E AEROSPACE INC	8,805	59.39	522,928.95
BOEING CO	49,068	145.09	7,119,276.12
CATERPILLAR	47,226	91.20	4,307,011.20
CUMMINS INC	12,985	136.85	1,776,997.25
DEERE&CO	21,474	90.11	1,935,022.14
DOVER CORP	13,373	70.25	939,453.25
EATON CORP	36,887	66.32	2,446,345.84
EMERSON ELECTRIC CO	51,880	53.39	2,769,873.20
FASTENAL CO	23,228	43.59	1,012,508.52
FLOWSERVE CORP	10,826	44.19	478,400.94
FLUOR CORP	11,267	49.11	553,322.37
FORTIVE CORP	24,714	53.46	1,321,210.44
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	54.70	700,707.00
GENERAL DYNAMICS CORP	20,984	162.09	3,401,296.56
GENERAL ELECTRIC CO	747,272	29.63	22,141,669.36
GRAINGER (WW) INC	4,749	220.26	1,046,014.74
HONEYWELL INTL INC	58,690	112.36	6,594,408.40
ILLINOIS TOOL WORKS	26,114	121.15	3,163,711.10
INGERSOLL-RAND PLC	20,617	74.26	1,531,018.42
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	54.91	532,242.63
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19,900	56.99	1,134,101.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,117	148.35	907,456.95
LOCKHEED MARTIN CORP	21,386	253.46	5,420,495.56

MASCO CORP	28,662	30.93	886,515.66
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,846	242.30	3,354,885.80
PACCAR INC	28,096	57.96	1,628,444.16
PARKER HANNIFIN CORP	10,942	131.96	1,443,906.32
PENTAIR PLC	13,583	57.30	778,305.90
RAYTHEON COMPANY	23,990	146.71	3,519,572.90
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,405	126.85	1,319,874.25
ROCKWELL COLLIN	10,382	84.41	876,344.62
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	176.95	1,433,295.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	35.48	490,617.44
SMITH (A.O.) CORP	12,146	47.58	577,906.68
SNAP-ON INC	5,027	160.43	806,481.61
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	119.90	1,440,598.50
TEXTRON	21,877	42.88	938,085.76
TRANSDIGM GROUP INC	4,546	272.00	1,236,512.00
UNITED RENTALS INC	7,302	88.86	648,855.72
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,453	104.81	6,755,318.93
WABCO HOLDINGS INC	4,697	100.12	470,263.64
WABTEC CORP	7,158	81.90	586,240.20
XYLEM INC	13,941	50.66	706,251.06
CINTAS CORP	7,407	107.49	796,178.43
DUN & BRADSTREET CORP	3,101	117.40	364,057.40
EQUIFAX INC	10,196	122.53	1,249,315.88
IHS MARKIT LTD	28,842	35.41	1,021,295.22
MANPOWER GROUP	6,266	80.05	501,593.30
NIELSEN HOLDINGS PLC	30,821	45.13	1,390,951.73
REPUBLIC SERVICES INC	20,703	52.76	1,092,290.28
ROBERT HALF INTL INC	11,558	40.34	466,249.72
STERICYCLE INC	6,767	74.08	501,299.36
VERISK ANALYTICS INC	13,722	83.33	1,143,454.26
WASTE CONNECTIONS INC	14,407	76.86	1,107,322.02
WASTE MANAGEMENT INC	35,785	65.96	2,360,378.60
AMERCO	602	325.90	196,191.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,336	42.41	523,169.76
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	71.45	817,959.60
CSX CORP	77,030	33.88	2,609,776.40
DELTA AIR LINES INC	15,095	45.25	683,048.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,746	49.56	780,371.76
FEDEX CORP	20,616	181.17	3,735,000.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	86.12	614,380.08
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	82.48	721,122.64
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,812	98.80	2,352,625.60

SOUTHWEST AIRLINES CO	13,214	42.37	559,877.18
UNION PACIFIC CORP	68,164	93.95	6,404,007.80
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,417	60.13	445,984.21
UNITED PARCEL SERVICE B	55,957	112.70	6,306,353.90
AUTOLIV INC	7,634	94.29	719,809.86
BORGWARNER INC	18,906	34.03	643,371.18
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,378	65.58	1,467,549.24
FORD MOTOR COMPANY	299,564	11.58	3,468,951.12
GENERAL MOTORS CO	112,014	30.96	3,467,953.44
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	28.23	610,530.21
HARLEY-DAVIDSON	14,677	58.78	862,714.06
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	75,430	43.84	3,306,851.20
LEAR CORP	6,134	116.93	717,248.62
TESLA MOTORS INC	9,376	190.06	1,782,002.56
COACH INC	22,032	36.36	801,083.52
DR HORTON INC	28,586	27.54	787,258.44
GARMIN LTD	9,564	48.94	468,062.16
HANESBRANDS INC	31,136	24.41	760,029.76
HARMAN INTL INDS INC	5,462	85.12	464,925.44
HASBRO INC	9,007	83.43	751,454.01
LEGGETT & PLATT INC	10,594	46.80	495,799.20
LENNAR CORP-CL A	14,466	41.10	594,552.60
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	57.79	489,596.88
MATTEL INC	27,399	31.39	860,054.61
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	50.18	698,505.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	197.77	1,001,111.74
NEWELL BRANDS INC	35,538	49.60	1,762,684.80
NIKE B	107,863	51.12	5,513,956.56
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	83.33	390,901.03
PULTE GROUP INC	24,602	18.04	443,820.08
PVH CORP	6,800	107.05	727,940.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	102.15	467,642.70
TOLL BROTHERS INC	14,067	27.63	388,671.21
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	31.59	503,860.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	25.90	421,729.70
VF CORP	26,718	55.18	1,474,299.24
WHIRLPOOL CORP	6,165	160.74	990,962.10
ARAMARK	19,980	37.20	743,256.00
BLOCK H & R INC	16,984	21.30	361,759.20
CARNIVAL CORPORATION	29,255	49.36	1,444,026.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,441	369.52	901,998.32
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	68.58	687,925.98

DOMINO'S PIZZA INC	4,088	170.36	696,431.68
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	44,309	23.61	1,046,135.49
LAS VEGAS SANDS CORP	35,176	59.71	2,100,358.96
MARRIOTT INTL A	27,183	74.08	2,013,716.64
MCDONALD'S CORP	71,211	114.98	8,187,840.78
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	17,662	17.64	311,557.68
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	28.32	1,023,598.08
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	12,935	35.53	459,580.55
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,811	79.01	1,170,217.11
STARBUCKS CORP	118,742	54.58	6,480,938.36
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	9,314	68.05	633,817.70
WYNN RESORTS LTD	6,619	87.84	581,412.96
YUM BRANDS INC	32,768	61.87	2,027,356.16
CBS CORP-CL B	33,390	57.42	1,917,253.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,252	269.83	4,655,107.16
COMCAST CORP-CL A	196,312	63.45	12,455,996.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	25.90	331,623.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,923	25.16	526,422.68
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	57.93	1,055,368.74
INTERPUBLIC GROUP OF COS	34,808	21.92	762,991.36
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	69.90	605,543.70
LIBERTY GLOBAL PLC-A	23,234	33.15	770,207.10
LIBERTY GLOBAL PLC-C	49,866	32.12	1,601,695.92
LIBERTY LILAC GROUP-C	9,040	20.25	183,060.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	33.55	511,067.15
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	33.91	216,481.44
NEWS CORP-CLASS A	33,479	11.98	401,078.42
OMNICOM GROUP	19,057	80.81	1,539,996.17
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	65.50	416,318.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	4.29	712,212.93
TEGNA INC	15,014	19.26	289,169.64
THE WALT DISNEY CO	125,142	94.64	11,843,438.88
TIME WARNER INC	63,712	86.60	5,517,459.20
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	88,300	27.46	2,424,718.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	37,808	27.33	1,033,292.64
VIACOM INC-CLASS B	29,770	37.98	1,130,664.60
ADVANCE AUTO PARTS	6,343	140.33	890,113.19
AMAZON.COM	32,596	771.88	25,160,200.48
AUTONATION INC	5,015	41.53	208,272.95
AUTOZONE INC	2,370	740.85	1,755,814.50
BED BATH & BEYOND INC	12,615	41.16	519,233.40
BEST BUY COMPANY INC	25,104	38.51	966,755.04



CARMAX INC	16,739	50.62	847,328.18
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,851	58.51	459,362.01
DOLLAR GENERAL CORP	22,756	71.50	1,627,054.00
DOLLAR TREE INC	18,857	76.04	1,433,886.28
EXPEDIA INC	9,800	124.75	1,222,550.00
FOOT LOCKER INC	11,765	69.27	814,961.55
GAP	20,859	27.41	571,745.19
GENUINE PARTS CO	12,843	90.18	1,158,181.74
HOME DEPOT	101,014	126.02	12,729,784.28
KOHL'S CORP	16,046	45.70	733,302.20
L BRANDS INC	19,499	66.48	1,296,293.52
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	20.25	710,187.75
LKQ CORP	24,693	32.09	792,398.37
LOWES COMPANIES	71,744	67.84	4,867,112.96
MACY'S INC	26,554	38.38	1,019,142.52
NETFLIX INC	34,658	122.19	4,234,861.02
NORDSTROM INC	10,094	52.29	527,815.26
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,761	264.15	2,050,068.15
PRICELINE GROUP INC/THE	4,023	1,570.26	6,317,155.98
ROSS STORES INC	32,319	62.86	2,031,572.34
SIGNET JEWELERS LTD	6,518	86.75	565,436.50
STAPLES INC	47,470	8.08	383,557.60
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,202	68.81	3,110,349.62
TIFFANY & CO	10,306	77.86	802,425.16
TJX COMPANIES INC	53,466	73.94	3,953,276.04
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,552	66.99	773,868.48
TRIPADVISOR INC	10,393	52.63	546,983.59
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,911	236.34	1,160,665.74
COSTCO WHOLESALE CORP	35,503	146.79	5,211,485.37
CVS HEALTH CORP	87,098	76.56	6,668,222.88
KROGER CO	72,981	32.29	2,356,556.49
RITE AID CORP	83,480	6.67	556,811.60
SYSCO CORP	43,080	54.16	2,333,212.80
WAL-MART STORES	127,343	71.10	9,054,087.30
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	74,416	81.54	6,067,880.64
WHOLE FOODS MKT INC	25,128	29.68	745,799.04
ALTRIA GROUP INC	158,805	64.04	10,169,872.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,319	46.28	2,189,923.32
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,947	45.63	864,551.61
BUNGE LIMITED	12,122	68.48	830,114.56
CAMPBELL SOUP CO (US)	16,395	54.96	901,069.20
COCA-COLA CO	333,798	42.27	14,109,641.46

CONAGRA	33,243	47.84	1,590,345.12
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,210	153.91	2,187,061.10
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	85.93	1,276,490.15
GENERAL MILLS INC	47,983	62.74	3,010,453.42
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,452	100.46	1,250,927.92
HORMEL FOODS CORP	23,465	36.88	865,389.20
INGREDION INC	5,835	125.32	731,242.20
JM SMUCKER CO	9,562	131.21	1,254,630.02
KELLOGG CO	21,051	74.88	1,576,298.88
KRAFT HEINZ CO/THE	49,191	84.94	4,178,283.54
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	94.55	877,045.80
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	15,072	74.21	1,118,493.12
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	103.09	1,556,659.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	125,730	44.01	5,533,377.30
MONSTER BEVERAGE CORP	11,376	132.59	1,508,343.84
PEPSICO INC	117,290	107.25	12,579,352.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,959	94.35	11,884,231.65
REYNOLDS AMERICAN INC	69,254	54.53	3,776,420.62
TYSON FOODS INC	24,113	69.52	1,676,335.76
WHITEWAVE FOODS CO	14,578	54.47	794,063.66
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,126	45.54	962,078.04
CLOROX COMPANY	11,080	115.11	1,275,418.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,690	70.37	4,833,715.30
COTY INC-CL A	39,000	19.65	766,350.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	75.14	338,430.56
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	80.39	1,432,710.58
KIMBERLY-CLARK CORP	29,096	115.37	3,356,805.52
PROCTER & GAMBLE CO	207,737	85.93	17,850,840.41
ABBOTT LABORATORIES	119,222	40.07	4,777,225.54
AETNA INC	28,377	118.02	3,349,053.54
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,832	75.61	1,121,447.52
ANTHEM INC	21,253	128.75	2,736,323.75
BARD C R INC	5,875	218.95	1,286,331.25
BAXTER INTERNATIONAL	39,728	46.60	1,851,324.80
BECTON DICKINSON & CO	17,175	174.81	3,002,361.75
BOSTON SCIENTIFIC CORP	109,596	21.84	2,393,576.64
CARDINAL HEALTH	26,222	69.25	1,815,873.50
CENTENE CORP	13,787	54.05	745,187.35
CERNER CORP	24,798	50.80	1,259,738.40
CIGNA CORP	20,732	135.80	2,815,405.60
DANAHER CORP	50,250	80.23	4,031,557.50
DAVITA INC	13,384	59.33	794,072.72

DENTSPLY SIRONA INC	19,455	61.19	1,190,451.45
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,016	92.45	1,573,129.20
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	16,679	19.66	327,909.14
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	51,247	74.78	3,832,250.66
HCA HOLDINGS INC	25,211	72.16	1,819,225.76
HENRY SCHEIN INC	7,071	157.52	1,113,823.92
HOLOGIC INC	21,733	37.16	807,598.28
HUMANA INC	12,019	186.00	2,235,534.00
IDEXX LABORATORIES INC	7,291	109.11	795,521.01
INTUITIVE SURGICAL INC	3,070	651.46	1,999,982.20
LABORATORY CRP OF AMER	8,806	121.72	1,071,866.32
MCKESSON CORP	18,177	141.68	2,575,317.36
MEDNAX INC	8,151	61.63	502,346.13
MEDTRONIC PLC	113,971	82.86	9,443,637.06
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	47.01	332,924.82
QUEST DIAGNOSTICS	11,439	80.42	919,924.38
RESMED INC	12,178	58.36	710,708.08
ST JUDE MEDICAL INC	22,892	79.21	1,813,275.32
STRYKER CORP	27,254	116.24	3,168,004.96
THE COOPER COS INC	4,200	181.76	763,392.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,368	141.90	10,978,519.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	119.26	864,396.48
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,822	88.51	692,325.22
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	101.62	1,632,322.06
ABBVIE INC	131,482	62.64	8,236,032.48
AGILENT TECHNOLOGIES	28,166	45.94	1,293,946.04
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,093	127.16	2,300,705.88
ALKERMES PLC	12,547	58.01	727,851.47
ALLERGAN PLC	32,140	212.90	6,842,606.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,369	43.47	233,390.43
AMGEN	61,090	146.42	8,944,797.80
BIOGEN INC	17,781	319.86	5,687,430.66
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,137	91.83	1,206,370.71
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	135,678	56.30	7,638,671.40
CELGENE CORP	62,946	120.07	7,557,926.22
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,990	16.28	260,317.20
GILEAD SCIENCES INC	108,290	78.47	8,497,516.30
ILLUMINA INC	11,836	133.13	1,575,726.68
INCYTE CORP	14,512	104.13	1,511,134.56
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	112.59	559,684.89
JOHNSON & JOHNSON	224,100	120.31	26,961,471.00
LILLY (ELI) & CO	80,698	78.39	6,325,916.22

MALLINCKRODT PLC	9,552	63.85	609,895.20
MERCK & CO	225,330	64.18	14,461,679.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,311	426.04	984,578.44
MYLAN NV	36,548	38.92	1,422,448.16
PERRIGO CO PLC	12,334	83.51	1,030,012.34
PFIZER	493,794	32.12	15,860,663.28
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	12,728	77.68	988,711.04
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,244	418.42	2,612,614.48
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,458	110.81	161,560.98
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	73,424	39.97	2,934,757.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,935	152.05	4,855,716.75
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,935	129.98	511,471.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	92.88	1,846,825.92
WATERS CORP	6,513	142.38	927,320.94
ZOETIS INC	37,987	51.00	1,937,337.00
BANK OF AMERICA CORP	834,255	17.97	14,991,562.35
BB&T CORP	66,571	40.61	2,703,448.31
CIT GROUP INC	16,516	37.65	621,827.40
CITIGROUP	238,288	51.59	12,293,277.92
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42,979	28.20	1,212,007.80
COMERICA INC	15,149	54.76	829,559.24
FIFTH THIRD BANCORP	62,255	22.95	1,428,752.25
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,670	78.04	910,726.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	10.91	953,730.38
JPMORGAN CHASE & CO	297,136	73.25	21,765,212.00
KEY CORP	87,033	15.23	1,325,512.59
M & T BANK CORP	11,456	131.54	1,506,922.24
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	14.80	578,606.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	17.48	478,809.24
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,382	101.25	4,088,677.50
REGIONS FINL CORP	104,639	11.54	1,207,534.06
SIGNATURE BANK	4,354	131.01	570,417.54
SUNTRUST BANKS	40,264	48.14	1,938,308.96
US BANCORP	139,929	46.67	6,530,486.43
WELLS FARGO & CO	391,860	47.99	18,805,361.40
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	139.32	617,605.56
ALLY FINANCIAL INC	36,028	17.34	624,725.52
AMERICAN EXPRESS	65,417	68.74	4,496,764.58
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,641	102.00	1,391,382.00
BANK NEW YORK CO	87,096	45.54	3,966,351.84
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	96,878	151.28	14,655,703.84
BLACKROCK INC	9,903	364.42	3,608,851.26

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,351	76.30	3,155,081.30
CME GROUP INC	27,329	112.00	3,060,848.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33,132	60.29	1,997,528.28
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,839	30.01	715,408.39
EATON VANCE CORP	10,061	37.24	374,671.64
FRANKLIN RESOURCES INC	30,723	38.49	1,182,528.27
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,285	192.63	5,833,799.55
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	50,640	57.34	2,903,697.60
INVESCO LTD	35,864	30.09	1,079,147.76
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	19.65	505,122.90
MOODY'S CORP	13,995	100.67	1,408,876.65
MORGAN STANLEY	117,494	36.52	4,290,880.88
MSCI INC	7,670	81.79	627,329.30
NASDAQ INC	9,070	66.93	607,055.10
NAVIENT CORP	29,884	15.77	471,270.68
NORTHERN TRUST CORP	17,320	77.15	1,336,238.00
PRICE T ROWE GROUP INC	19,837	68.35	1,355,858.95
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	65.27	648,261.64
S&P GLOBAL INC	21,341	125.63	2,681,069.83
SCHWAB (CHARLES) CORP	96,037	33.71	3,237,407.27
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	44.99	485,981.98
STATE STREET CORP	31,889	75.54	2,408,895.06
SYNCHRONY FINANCIAL	67,040	30.22	2,025,948.80
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,831	35.30	805,934.30
VOYA FINANCIAL INC	16,094	33.89	545,425.66
AFLAC	33,349	71.60	2,387,788.40
ALLEGHANY CORP	1,276	537.87	686,322.12
ALLSTATE CORP	30,117	68.17	2,053,075.89
AMERICAN INT'L GROUP	90,640	60.93	5,522,695.20
AON PLC	21,342	110.93	2,367,468.06
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	79.22	800,280.44
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,316	49.90	764,268.40
ASSURANT INC	4,769	82.02	391,153.38
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	59.91	437,462.82
CHUBB LTD	37,602	125.85	4,732,211.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	70.11	870,275.43
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	207.88	697,021.64
FNF GROUP	21,333	33.40	712,522.20
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,480	45.72	1,439,265.60
LINCOLN NATIONAL CORP	19,698	57.51	1,132,831.98
LOEWS CORP	24,792	43.14	1,069,526.88
MARKEL CORP	1,132	866.33	980,685.56

MARSH & MCLENNAN COS	42,049	66.91	2,813,498.59
METLIFE INC	75,488	51.28	3,871,024.64
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	56.10	1,298,995.50
PROGRESSIVE CORP	46,702	32.08	1,498,200.16
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,694	93.51	3,337,745.94
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	126.65	411,485.85
TORCHMARK CORP	9,592	67.54	647,843.68
TRAVELERS COS INC/THE	23,571	106.94	2,520,682.74
UNUM GROUP	18,574	39.35	730,886.90
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,506	118.00	1,239,708.00
WR BERKLEY CORP	8,610	56.93	490,167.30
XL GROUP LTD	23,714	37.19	881,923.66
CBRE GROUP INC-A	24,306	27.26	662,581.56
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.47	638,589.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	91.28	335,271.44
REALOGY HOLDINGS CORP	11,351	23.62	268,110.62
WEYERHAEUSER CO	59,987	29.69	1,781,014.03
ACCENTURE PLC-CL A	50,932	117.21	5,969,739.72
ACTIVISION BLIZZARD INC	47,543	40.15	1,908,851.45
ADOBE SYSTEMS INC	40,514	107.86	4,369,840.04
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	66.53	943,262.34
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,727	207.32	980,001.64
ALPHABET INC-CL A	23,882	805.59	19,239,100.38
ALPHABET INC-CL C	25,137	785.31	19,740,337.47
ANSYS INC	6,865	88.33	606,385.45
AUTODESK INC	17,349	72.63	1,260,057.87
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,836	90.90	3,348,392.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	62.15	599,747.50
CA INC	26,996	31.74	856,853.04
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,646	25.06	617,628.76
CDK GLOBAL INC	10,687	56.37	602,426.19
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	84.78	915,708.78
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	85.95	1,075,320.45
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,896	53.01	2,591,976.96
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	19,239	49.37	949,829.43
EBAY	88,057	28.29	2,491,132.53
ELECTRONIC ARTS INC	24,276	79.44	1,928,485.44
FACEBOOK INC-A	188,041	123.18	23,162,890.38
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	24,951	76.90	1,918,731.90
FISERV INC	17,872	100.51	1,796,314.72
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,932	150.02	1,189,958.64
FORTINET INC	10,871	31.75	345,154.25

GARTNER INC	7,182	100.38	720,929.16
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	72.81	911,071.53
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,103	154.81	11,471,885.43
INTUIT INC	19,577	109.36	2,140,940.72
LINKEDIN CORP - A	9,486	191.01	1,811,920.86
MASTERCARD INC-CLASS A	78,796	106.19	8,367,347.24
MICROSOFT CORP	607,602	60.17	36,559,412.34
MOBILEYE NV	14,784	37.85	559,574.40
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	13.98	244,985.52
ORACLE CORP	252,817	39.55	9,998,912.35
PAYCHEX INC	25,968	55.18	1,432,914.24
PAYPAL HOLDINGS INC	88,261	41.26	3,641,648.86
RED HAT INC	15,580	76.79	1,196,388.20
SABRE CORP	17,243	24.30	419,004.90
SALESFORCE.COM INC	52,100	75.90	3,954,390.00
SERVICENOW INC	13,102	84.98	1,113,407.96
SPLUNK INC	10,741	59.99	644,352.59
SYMANTEC CORP	52,499	24.84	1,304,075.16
SYNOPSYS INC	12,264	59.02	723,821.28
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,353	50.58	725,974.74
TWITTER INC	48,486	19.13	927,537.18
VANTIV INC - CL A	12,864	58.73	755,502.72
VERISIGN INC	8,477	82.05	695,537.85
VISA INC-CLASS A SHARES	154,804	83.24	12,885,884.96
VMWARE INC-CLASS A	6,552	76.97	504,307.44
WESTERN UNION CO	38,757	19.87	770,101.59
WORKDAY INC-CLASS A	10,188	84.97	865,674.36
XEROX CORP	66,872	9.51	635,952.72
YAHOO	72,914	41.21	3,004,785.94
ZILLOW GROUP INC-C	9,847	35.88	353,310.36
AMPHENOL CORPORATION	24,724	67.35	1,665,161.40
APPLE INC	445,755	110.88	49,425,314.40
ARROW ELECTRONICS INC	8,043	62.23	500,515.89
AVNET INC	10,936	43.31	473,638.16
CDW CORP/DE	13,011	44.48	578,729.28
CISCO SYSTEMS	408,763	31.36	12,818,807.68
CORNING	90,000	23.21	2,088,900.00
F5 NETWORKS INC	5,350	140.23	750,230.50
FLEX LTD	45,803	14.01	641,700.03
FLIR SYSTEMS INC	11,686	33.46	391,013.56
HARRIS CORP	9,931	101.20	1,005,017.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	139,341	23.23	3,236,891.43

HP INC	139,884	15.57	2,177,993.88
JUNIPER NETWORKS INC	27,826	25.28	703,441.28
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,652	78.96	999,001.92
NETAPP INC	23,085	33.19	766,191.15
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	159.02	1,146,693.22
SEAGATE TECHNOLOGY	25,766	34.76	895,626.16
TE CONNECTIVITY LTD	29,455	65.95	1,942,557.25
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	27.49	566,898.78
WESTERN DIGITAL CORP	22,449	57.48	1,290,368.52
AT&T INC	500,209	37.44	18,727,824.96
CENTURYLINK INC	46,783	24.29	1,136,359.07
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	103,537	3.21	332,353.77
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,501	54.59	1,337,509.59
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	10,766	103.56	1,114,926.96
SPRINT CORP	64,825	7.11	460,905.75
T-MOBILE US INC	24,703	53.01	1,309,506.03
VERIZON COMMUNICATIONS	331,126	47.86	15,847,690.36
AES CORP	52,646	12.01	632,278.46
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,661	36.81	723,721.41
AMEREN CORPORATION	20,875	49.05	1,023,918.75
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,607	61.25	2,425,928.75
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	72.25	1,031,946.75
ATMOS ENERGY CORP	8,018	72.07	577,857.26
CALPINE CORP	25,284	11.74	296,834.16
CENTERPOINT ENERGY INC	35,361	23.21	820,728.81
CMS ENERGY CORP	24,095	40.34	971,992.30
CONSOLIDATED EDISON INC	24,330	72.26	1,758,085.80
DOMINION RESOURCES	49,824	73.22	3,648,113.28
DTE ENERGY COMPANY	14,355	92.37	1,325,971.35
DUKE ENERGY CORP	55,750	77.34	4,311,705.00
EDISON INTL	26,184	70.17	1,837,331.28
ENTERGY CORP	15,347	68.85	1,056,640.95
EVERSOURCE ENERGY	25,381	53.23	1,351,030.63
EXELON CORP	74,290	32.07	2,382,480.30
FIRSTENERGY CORP	36,433	33.49	1,220,141.17
NEXTERA ENERGY INC	37,356	117.49	4,388,956.44
NISOURCE INC	26,021	22.26	579,227.46
NRG ENERGY INC	25,186	12.03	302,987.58
OGE ENERGY CORP	15,686	31.23	489,873.78
PG&E CORP	39,976	59.41	2,374,974.16
PINNACLE WEST CAPITAL	9,634	73.98	712,723.32
PPL CORPORATION	54,406	33.58	1,826,953.48



	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	40.63	1,649,821.78	
	SCANA CORP	11,729	69.97	820,678.13	
	SEMPRA ENERGY	19,061	99.67	1,899,809.87	
	SOUTHERN CO	75,901	49.22	3,735,847.22	
	UGI CORP	13,950	45.27	631,516.50	
	WEC ENERGY GROUP INC	25,287	56.23	1,421,888.01	
	WESTAR ENERGY INC	11,492	56.74	652,056.08	
	XCEL ENERGY INC	40,763	39.58	1,613,399.54	
	ANALOG DEVICES	24,668	64.97	1,602,679.96	
	APPLIED MATERIALS	87,877	29.13	2,559,857.01	
	BROADCOM LTD	31,659	173.42	5,490,303.78	
	INTEL CORP	383,786	34.75	13,336,563.50	
	KLA-TENCOR CORP	13,414	75.49	1,012,622.86	
	LAM RESEARCH CORP	12,757	98.01	1,250,313.57	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	20,523	59.90	1,229,327.70	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	35,834	12.70	455,091.80	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,468	39.51	927,220.68	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,416	64.31	1,120,022.96	
	MICRON TECHNOLOGY	83,081	17.20	1,428,993.20	
	NVIDIA CORP	43,144	69.96	3,018,354.24	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	23,697	97.28	2,305,244.16	
	QORVO INC	10,609	51.78	549,334.02	
	QUALCOMM	119,259	67.88	8,095,300.92	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,621	77.66	1,213,126.86	
	TEXAS INSTRUMENTS	81,429	69.79	5,682,929.91	
	XILINX INC	20,299	51.85	1,052,503.15	
	アメリカドル 小計	25,419,163		1,555,014,269.67	(164,256,157,305)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	32.08	381,302.88	
	ARC RESOURCES LTD	27,117	22.95	622,335.15	
	CAMECO CORP	28,709	11.43	328,143.87	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	88,519	41.52	3,675,308.88	
	CENOVUS ENERGY INC	68,484	19.27	1,319,686.68	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	48,722	15.62	761,037.64	
	ENBRIDGE	75,035	56.93	4,271,742.55	
	ENCANA CORP	84,430	14.21	1,199,750.30	
	HUSKY ENERGY INC	31,439	14.21	446,748.19	
	IMPERIAL OIL	24,763	43.84	1,085,609.92	
	INTER PIPELINE LTD	30,317	26.95	817,043.15	
	KEYERA CORP	14,929	39.00	582,231.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	34,047	39.53	1,345,877.91	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	34.61	437,228.13	

PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,978	28.76	545,807.28
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	29.03	580,890.30
SUNCOR ENERGY	134,618	40.76	5,487,029.68
TOURMALINE OIL CORP	18,999	34.29	651,475.71
TRANSCANADA CORP	64,507	59.96	3,867,839.72
VERESEN INC	23,263	12.45	289,624.35
VERMILION ENERGY INC	10,067	53.41	537,678.47
AGNICO EAGLE MINES	17,661	67.68	1,195,296.48
AGRIUM INC	10,925	127.21	1,389,769.25
BARRICK GOLD CORP	94,395	23.06	2,176,748.70
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,100	241.19	506,499.00
ELDORADO GOLD CORP	67,212	4.22	283,634.64
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	89.74	1,279,423.18
GOLDCORP INC	66,839	20.12	1,344,800.68
KINROSS GOLD CORP	107,615	5.32	572,511.80
METHANEX CORP	6,468	50.72	328,056.96
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	71,204	22.78	1,622,027.12
SILVER WHEATON CORP	36,838	32.24	1,187,657.12
TECK RESOURCES LTD-CL B	49,377	29.87	1,474,890.99
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	4.39	311,690.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	43.72	189,176.44
YAMANA GOLD INC	85,214	4.83	411,583.62
BOMBARDIER B	157,835	1.79	282,524.65
CAE INC	25,522	19.36	494,105.92
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	25.44	299,276.16
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	55.21	669,807.72
CANADIAN NATL RAILWAY CO	62,975	84.76	5,337,761.00
CP RAILWAY LIMITED	11,668	192.18	2,242,356.24
LINAMAR CORP	3,889	48.43	188,344.27
MAGNA INTERNATIONAL INC	31,692	50.92	1,613,756.64
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	33.96	599,699.64
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	61.84	1,136,124.48
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	26.66	958,347.02
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	132.00	713,988.00
DOLLARAMA INC	10,038	100.75	1,011,328.50
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,632	66.62	2,307,183.84
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	18.19	209,166.81
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	20.51	113,092.14
LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	64.87	1,190,559.11
METRO INC	19,179	41.10	788,256.90
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	104.38	498,414.50
SAPUTO INC	22,700	48.14	1,092,778.00

	BANK MONTREAL	51,993	85.55	4,448,001.15
	BANK NOVA SCOTIA	97,381	71.63	6,975,401.03
	CANADIAN IMPERIAL BANK	31,799	101.00	3,211,699.00
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	47.87	1,348,162.81
	ROYAL BANK OF CANADA	120,698	84.34	10,179,669.32
	TORONTO-DOMINION BANK	150,300	60.56	9,102,168.00
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	69,523	46.65	3,243,247.95
	CI FINANCIAL CORP	18,671	25.31	472,563.01
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	12.00	347,832.00
	IGM FINANCIAL INC	7,685	36.95	283,960.75
	ONEX CORP	7,654	85.65	655,565.10
	THOMSON REUTERS CORP	26,956	55.88	1,506,301.28
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,946	698.00	1,358,308.00
	GREAT-WEST LIFECO INC	26,744	33.49	895,656.56
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,888	53.18	525,843.84
	INTACT FINANCIAL CORP	11,669	93.21	1,087,667.49
	MANULIFE FINANCIAL CORP	158,866	20.09	3,191,617.94
	POWER CORP OF CANADA	33,351	29.00	967,179.00
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	31.81	659,739.40
	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,157	46.35	2,278,426.95
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	21.17	263,884.05
	CGI GROUP INC - CL A	19,105	67.02	1,280,417.10
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,702	644.71	1,097,296.42
	OPEN TEXT CORP	9,997	83.17	831,450.49
	BCE INC	12,539	59.20	742,308.80
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	51.72	1,493,725.32
	TELUS CORP	16,454	42.57	700,446.78
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	45.62	239,094.42
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	37.23	384,362.52
	FORTIS INC	31,686	42.56	1,348,556.16
	HYDRO ONE LTD	15,938	23.86	380,280.68
	カナダドル 小計	3,214,960		126,755,862.60 (9,982,024,179)
ユーロ	ENI	205,336	12.80	2,628,300.80
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	11.95	476,410.65
	NESTE OIL OYJ	11,490	36.28	416,857.20
	OMV AG	13,475	28.50	384,037.50
	REPSOL SA	88,586	12.63	1,119,284.11
	SAIPEM	590,236	0.39	231,608.60
	TECHNIP S.A.	9,226	62.20	573,857.20
	TENARIS SA	41,874	13.74	575,348.76
	TOTAL SA	181,007	43.49	7,872,899.46

VOPAK	6,360	43.66	277,709.40
AIR LIQUIDE	31,297	93.40	2,923,139.80
AKZO NOBEL	19,791	59.06	1,168,856.46
ARCELORMITTAL	152,837	6.48	990,383.76
ARKEMA	5,986	86.14	515,634.04
BASF SE	74,455	80.13	5,966,079.15
COVESTRO AG	6,408	58.38	374,099.04
CRH	66,778	32.20	2,150,251.60
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	26.56	357,338.24
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	38.21	220,166.02
HEIDELBERGCEMENT AG	11,619	92.13	1,070,458.47
IMERYS SA	3,000	65.39	196,170.00
K+S AG	14,355	19.08	273,893.40
KONINKLIJKE DSM NV	15,765	57.20	901,758.00
LANXESS	7,293	57.00	415,701.00
LINDE AG	14,971	151.50	2,268,106.50
OCI NV	5,400	11.50	62,127.00
SOLVAY SA	6,515	100.50	654,757.50
STORA ENSO OYJ R	48,306	8.76	423,402.09
SYMRISE AG	10,842	58.58	635,124.36
THYSSEN KRUPP	29,964	21.25	636,884.82
UMICORE	8,516	55.28	470,764.48
UPM KYMMENE CORP	44,370	21.68	961,941.60
VOESTALPINE AG	10,429	34.07	355,316.03
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,977	28.32	509,198.52
AIRBUS GROUP SE	47,173	54.26	2,559,606.98
ALSTOM	11,216	25.88	290,270.08
ANDRITZ AG	5,242	48.68	255,206.77
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	28.72	168,098.16
BOUYGUES ORD	16,815	29.88	502,432.20
BRENTAG AG	13,573	45.45	616,892.85
CNH INDUSTRIAL NV	85,910	7.10	609,961.00
EIFFAGE	4,952	66.42	328,911.84
FERROVIAL SA	42,255	17.02	719,180.10
GEA GROUP AG	16,161	34.00	549,474.00
HOCHTIEF AG	1,912	129.05	246,743.60
KONE OYJ-B	26,924	42.00	1,130,808.00
KONINKLIJKE PHILIPS	74,990	27.39	2,053,976.10
LEGRAND SA	21,312	51.57	1,099,059.84
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	36,520	11.59	423,266.80
MAN SE	3,262	93.39	304,638.18
METSO OYJ	9,561	25.45	243,327.45

OSRAM LICHT AG	7,897	49.80	393,310.08
PRYSMIAN SPA	14,715	22.82	335,796.30
REXEL SA	24,339	13.50	328,576.50
SAFRAN SA	25,106	62.52	1,569,627.12
SAINT-GOBAIN	39,744	40.93	1,626,721.92
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,157	61.70	2,786,186.90
SIEMENS	62,032	104.50	6,482,344.00
THALES SA	9,227	89.49	825,724.23
VINCI S.A.	40,767	64.22	2,618,056.74
WARTSILA OYJ	11,462	40.40	463,064.80
ZARDOYA OTIS SA	13,496	7.44	100,410.24
ZODIAC AEROSPACE	17,832	21.90	390,520.80
BUREAU VERITAS SA	19,558	17.01	332,779.37
ELENRED	18,941	19.95	377,872.95
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	47.28	453,368.58
RELX NV	79,547	14.72	1,170,931.84
SOCIETE BIC SA	2,424	123.20	298,636.80
WOLTERS KLUWER	26,240	32.83	861,590.40
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	55,946	13.06	730,654.76
ADP	2,382	89.59	213,403.38
AENA SA	5,610	130.70	733,227.00
ATLANTIA SPA	33,587	20.91	702,304.17
BOLLORE	61,805	2.86	177,256.74
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,178	12.31	260,807.07
DEUTSCHE POST AG-REG	78,198	28.74	2,247,410.52
FRAPORT AG	3,561	53.12	189,160.32
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	8.61	314,221.49
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	5.03	303,393.82
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,666	76.84	2,049,015.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	67.22	335,495.02
CONTINENTAL AG	8,828	168.90	1,491,049.20
DAIMLER AG	78,000	63.89	4,983,420.00
FERRARI NV	10,924	49.45	540,191.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	80,794	6.26	506,174.41
MICHELIN	14,594	96.27	1,404,964.38
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,080	33.00	365,640.00
PEUGEOT SA	40,815	13.62	556,104.37
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,859	45.77	588,556.43
RENAULT SA	15,635	75.40	1,178,879.00
SCHAEFFLER AG	15,247	12.32	187,919.27
VALEO SA	19,350	50.84	983,754.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,927	116.40	1,737,502.80

VOLKSWAGEN STAMM	2,594	126.00	326,844.00
ADIDAS AG	15,166	139.70	2,118,690.20
CHRISTIAN DIOR	4,454	175.35	781,008.90
HERMES INTERNATIONAL	2,148	374.65	804,748.20
HUGO BOSS AG	4,852	59.94	290,828.88
KERING	6,060	199.65	1,209,879.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	48.30	643,307.70
LVMH	22,564	165.60	3,736,598.40
ACCOR	14,931	33.85	505,414.35
PADDY POWER PLC	6,543	102.45	670,330.35
SODEXO	8,216	102.50	842,140.00
ALTICE NV -A	28,394	16.06	456,007.64
ALTICE NV -B	10,461	16.13	168,735.93
AXEL SPRINGER SE	3,827	42.60	163,049.33
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	18.16	217,544.04
JC DECAUX SA	4,674	24.99	116,826.63
LAGADERE S.C.A	9,057	22.84	206,907.16
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	34.53	662,174.09
PUBLICIS GROUPE	16,440	59.19	973,083.60
RTL GROUP	3,513	67.93	238,662.68
SES	32,137	20.56	660,897.40
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	47.35	236,680.29
VIVENDI	93,515	18.07	1,690,283.62
INDITEX	88,079	31.17	2,745,862.82
ZALANDO SE	6,805	37.50	255,187.50
CARREFOUR	44,198	23.57	1,041,967.85
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	46.16	170,191.92
COLRUYT SA	6,317	48.04	303,500.26
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	4.71	217,991.43
JERONIMO MARTINS	20,234	15.59	315,549.23
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,216	20.32	2,097,865.20
METRO STAMM	13,712	27.23	373,377.76
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,216	102.70	6,697,683.20
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	35.09	599,196.84
DANONE (GROUPE)	47,690	60.74	2,896,690.60
HEINEKEN HOLDING NV	8,878	67.34	597,844.52
HEINEKEN NV	18,465	72.08	1,330,957.20
KERRY GROUP PLC-A	13,457	65.90	886,816.30
PERNOD-RICARD	17,080	105.05	1,794,254.00
REMY COINTREAU	1,575	72.61	114,360.75
BEIERSDORF AG	8,846	79.92	706,972.32
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	96.96	835,601.28

HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	113.55	1,625,354.70
LOREAL	20,487	163.90	3,357,819.30
UNILEVER NV-CVA	131,976	37.88	4,999,910.76
ESSILOR INTERNATIONAL	16,529	103.70	1,714,057.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,540	77.37	1,357,069.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	32,998	70.74	2,334,278.52
BAYER	67,042	93.48	6,267,086.16
GRIFOLS SA	27,339	18.60	508,642.09
MERCK KGAA	10,480	97.49	1,021,695.20
ORION OYJ-CLASS B	7,975	39.63	316,049.25
QIAGEN N.V.	18,223	25.86	471,246.78
SANOFI	93,933	77.15	7,246,930.95
UCB (GROUPE)	10,465	63.00	659,295.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	20,336	21.42	435,597.12
BANCO BILBAO VIZCAYA	537,061	6.12	3,286,813.32
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.24	552,815.32
BANCO SANTANDER SA	1,199,208	4.42	5,302,897.77
BANKINTER SA	58,881	7.09	417,937.33
BNP PARIBAS	86,617	54.80	4,746,611.60
CAIXABANK	256,871	2.85	732,339.22
COMMERZBANK AG	89,792	6.40	574,668.80
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	10.67	990,538.78
ERSTE GROUP BANK AG	25,921	27.56	714,512.36
ING GROEP NV-CVA	316,761	12.91	4,089,384.51
INTESA SANPAOLO	1,031,998	2.14	2,208,475.72
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	1.99	129,610.00
KBC GROEP NV	20,232	58.42	1,181,953.44
MEDIOBANCA	41,923	6.86	287,591.78
NATIXIS	69,996	4.47	313,302.09
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	15.20	139,794.40
SOCIETE GENERALE	62,451	38.87	2,427,782.62
UNICREDIT SPA	459,572	2.23	1,024,845.56
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,534	2.36	154,660.24
DEUTSCHE BANK NAMEN	111,629	13.36	1,491,363.44
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	15,552	72.58	1,128,764.16
EURAZEO	2,901	51.96	150,735.96
EXOR SPA	9,778	36.21	354,061.38
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	75.37	470,836.39
WENDEL	2,712	104.30	282,861.60
AEGON	153,883	4.10	630,920.30
AGEAS	16,065	32.56	523,076.40
ALLIANZ SE-REG	37,388	145.50	5,439,954.00

ASSICURAZIONI GENERALI	94,259	11.76	1,108,485.84
AXA	158,508	21.28	3,373,050.24
CNP ASSURANCES	11,830	16.34	193,302.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	100.45	472,717.70
MAPFRE SA	90,939	2.72	248,081.59
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,111	175.05	2,295,080.55
NN GROUP NV	26,436	28.04	741,265.44
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.06	278,972.10
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	42.46	1,537,603.98
SCOR SE	13,354	29.46	393,475.61
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.67	159,639.32
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	27,553	28.60	788,015.80
VONOVIA SE	37,270	32.17	1,199,162.25
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,210	42.08	1,481,812.85
ATOS SE	7,723	97.53	753,224.19
CAP GEMINI SA	13,366	74.01	989,217.66
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	70.85	741,728.65
GEMALTO	6,158	48.25	297,154.29
SAP SE	79,688	78.53	6,257,898.64
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	39.89	379,473.57
INGENICO GROUP	4,681	71.97	336,891.57
NOKIA OYJ	469,433	4.01	1,883,365.19
DEUTSCHE TELEKOM	260,911	14.55	3,796,255.05
ELISA A	12,839	30.51	391,717.89
ILIAD SA	2,053	179.20	367,897.60
KPN (KON.)	297,939	2.86	854,489.05
ORANGE	160,144	14.06	2,251,624.64
PROXIMUS	13,141	25.91	340,483.31
SFR GROUP SA	7,526	23.42	176,258.92
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.74	635,577.51
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.61	291,256.06
TELEFONICA	361,968	8.85	3,203,416.80
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.55	238,201.61
E.ON SE	162,253	6.40	1,038,581.45
ELECTRICITE DE FRANCE	22,799	10.21	232,891.78
ENAGAS	18,299	25.02	457,932.47
ENDESA	24,774	18.72	463,769.28
ENEL	614,977	3.77	2,322,153.15
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	2.84	548,807.28
ENGIE	117,274	12.75	1,495,243.50
FORTUM OYJ	39,219	15.04	589,853.76
GAS NATURAL SDG SA	31,393	17.05	535,407.61



	IBERDROLA SA	437,697	5.92	2,591,603.93
	INNOGY SE	11,000	33.76	371,415.00
	ITALGAS SPA	40,122	3.57	143,235.54
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	37,798	17.75	670,914.50
	RWE STAMM	43,232	13.47	582,551.20
	SNAM SPA	200,612	3.75	752,295.00
	SUEZ	28,043	13.32	373,672.97
	TERNA SPA	133,339	4.17	556,823.66
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	17.21	633,654.99
	ASML HOLDING NV	29,745	94.33	2,805,845.85
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	15.88	1,441,452.55
	STMICROELECTRONICS	53,368	8.60	458,964.80
	ユーロ 小計	16,240,398		266,646,267.20 (30,781,645,085)
イギリスポンド	BP PLC	1,512,867	4.58	6,930,443.72
	PETROFAC LTD	16,711	7.75	129,593.80
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	346,907	20.73	7,191,382.11
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	303,834	21.63	6,573,448.59
	ANGLO AMERICAN PLC	114,934	11.93	1,371,162.62
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	6.41	163,056.47
	BHP BILLITON PLC	170,274	13.38	2,278,266.12
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	32.61	334,024.23
	FRESNILLO PLC	17,743	17.71	314,228.53
	GLENCORE PLC	987,792	2.70	2,669,507.88
	JOHNSON MATTHEY PLC	17,033	33.23	566,006.59
	MONDI PLC	32,473	16.19	525,737.87
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	71.15	518,968.10
	RIO TINTO PLC REG	99,978	30.68	3,067,824.93
	ASHTREAD GROUP PLC	44,308	13.85	613,665.80
	BAE SYSTEMS PLC	254,789	5.85	1,490,515.65
	BUNZL PLC	27,712	21.61	598,856.32
	COBHAM PLC	151,109	1.57	238,147.78
	DCC PLC	7,320	61.90	453,108.00
	IMI PLC	23,923	9.69	231,813.87
	MEGGITT PLC	66,268	4.48	297,410.78
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	147,055	7.58	1,114,676.90
	SMITHS GROUP PLC	35,025	14.53	508,913.25
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	13.57	251,791.35
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	17.25	320,608.50
	WOLSELEY LTD	20,276	45.40	920,530.40
	AGGREKO PLC	19,830	8.13	161,217.90
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	9.62	189,545.12

CAPITA GROUP PLC	53,334	5.77	308,003.85
EXPERIAN PLC	76,879	14.67	1,127,814.93
G4S PLC	132,555	2.46	327,013.18
INTERTEK GROUP PLC	12,430	32.72	406,709.60
RELX PLC	87,723	13.73	1,204,436.79
EASYJET PLC	11,633	10.34	120,285.22
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.93	370,781.35
NEW GKN	152,024	3.06	465,801.53
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	89,602	4.71	422,025.42
BURBERRY GROUP PLC	39,180	14.51	568,501.80
PERSIMMON PLC	27,358	17.17	469,736.86
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.46	395,611.35
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	24.15	255,965.85
CARNIVAL PLC	15,765	39.43	621,613.95
COMPASS GROUP PLC	132,359	13.98	1,850,378.82
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,585	31.00	452,135.00
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.44	289,100.21
TUI AG-DI	42,055	10.41	437,792.55
WHITBREAD PLC	14,664	35.44	519,692.16
WILLIAM HILL	70,325	2.92	205,349.00
ITV PLC	295,435	1.66	490,422.10
PEARSON	66,305	7.44	493,640.72
SKY PLC	90,020	8.04	723,760.80
WPP PLC	103,971	16.85	1,751,911.35
DIXONS CARPHONE PLC	83,240	3.21	267,616.60
KINGFISHER PLC	187,310	3.62	679,186.06
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.26	441,768.95
NEXT PLC	11,202	50.60	566,821.20
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.18	366,512.50
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.38	354,075.64
TESCO	656,079	1.99	1,309,861.72
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,038	25.73	798,607.74
BRITISH AMERICAN TOBACCO	151,258	44.80	6,776,358.40
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	17.12	239,662.88
DIAGEO	203,894	20.67	4,214,488.98
IMPERIAL BRANDS PLC	77,521	36.10	2,798,895.70
TATE & LYLE	40,576	6.59	267,395.84
RECKITT BENCKISER PLC	51,376	70.66	3,630,228.16
UNILEVER PLC	103,867	33.11	3,439,036.37
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	9.20	276,248.40
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	11.28	801,184.56
ASTRAZENECA	102,461	45.75	4,688,103.05

	GLAXOSMITHKLINE	395,118	15.99	6,319,912.41
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,207	17.64	215,331.48
	SHIRE PLC	72,693	48.97	3,559,776.21
	BARCLAYS	1,378,866	1.92	2,659,832.51
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,624,302	6.22	10,108,031.34
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,243,689	0.57	3,015,645.54
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	1.92	568,292.65
	STANDARD CHARTERED PLC	266,744	6.53	1,743,438.78
	3I GROUP PLC	86,537	6.55	567,250.03
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	74,245	3.10	230,307.99
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	12.07	247,060.83
	ICAP PLC	43,892	4.98	218,626.05
	INVESTEC PLC	54,280	5.10	276,828.00
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,018	27.89	725,642.02
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	28.50	316,749.00
	SCHRODERS PLC	9,867	28.59	282,097.53
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	19.01	309,007.55
	AVIVA PIC	329,019	4.44	1,461,173.37
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.63	413,581.45
	LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.21	1,076,173.92
	OLD MUTUAL PLC	397,509	2.01	800,185.61
	PRUDENTIAL	209,945	14.25	2,992,765.97
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.37	465,141.75
	ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	9.56	427,810.00
	STANDARD LIFE PLC	164,930	3.53	583,357.41
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.86	308,838.60
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.81	608,276.01
	WORLDPAY GROUP PLC	160,401	2.81	451,208.01
	BT GROUP PLC	681,472	3.62	2,472,380.41
	INMARSAT PLC	33,632	7.61	255,939.52
	VODAFONE GROUP PLC	2,152,260	2.16	4,661,795.16
	CENTRICA PLC	440,558	2.07	915,038.96
	NATIONAL GRID PLC	303,031	10.05	3,046,976.70
	SEVERN TRENT PLC	18,112	22.32	404,259.84
	SSE PLC	80,824	15.27	1,234,182.48
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	60,086	9.10	546,782.60
	イギリスポンド 小計	24,297,528		140,708,688.01 (18,489,121,604)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	501.50	337,008.00
	GIVAUDAN-REG	740	1,848.00	1,367,520.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	56.20	2,057,144.80
	SIKA AG-BR	188	4,933.00	927,404.00

	SYNGENTA AG	7,505	387.20	2,905,936.00
	ABB LTD	158,961	20.78	3,303,209.58
	GEBERIT AG-REG	3,021	410.40	1,239,818.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,881	183.00	344,223.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,893	185.40	721,762.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	57.65	762,363.60
	SGS SA	437	1,989.00	869,193.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,775	129.50	618,362.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	42,136	66.85	2,816,791.60
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	299.60	743,906.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	57.90	228,010.20
	DUFREY AG-REG	3,918	126.50	495,627.00
	ARYZTA AG	7,596	42.19	320,475.24
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	208	1,243.00	258,544.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,210.00	390,750.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	62,430.00	499,440.00
	NESTLE SA - REGISTERED	259,066	70.45	18,251,199.70
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	130.90	541,926.00
	ACTELION LTD-REG	8,195	143.50	1,175,982.50
	GALENICA AG-REG	291	1,022.00	297,402.00
	LONZA GROUP AG-REG	4,626	182.90	846,095.40
	NOVARTIS	181,338	72.45	13,137,938.10
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,055	236.20	13,476,391.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	150,934	13.00	1,962,142.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,803	41.60	782,204.80
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	63.40	215,369.80
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,482	503.00	745,446.00
	UBS GROUP AG	298,764	14.04	4,194,646.56
	BALOISE HOLDING AG	3,877	121.80	472,218.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,848	266.80	759,846.40
	SWISS RE LTD	27,159	91.85	2,494,554.15
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,273	259.70	3,187,298.10
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	82.45	517,538.65
	SWISSCOM	2,064	448.40	925,497.60
	スイスフラン 小計	1,334,852		85,191,187.28 (9,145,273,954)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	158.30	2,246,435.30
	BOLIDEN AB	23,983	218.80	5,247,480.40
	ALFA LAVAL AB	25,732	130.60	3,360,599.20
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	171.70	13,786,651.50
	ATLAS COPCO A	53,833	278.00	14,965,574.00
	ATLAS COPCO B	34,020	246.70	8,392,734.00

	SANDVIK AB	87,313	107.30	9,368,684.90	
	SKANSKA B	28,530	203.80	5,814,414.00	
	SKF AB-B	33,479	152.60	5,108,895.40	
	VOLVO B	123,214	96.75	11,920,954.50	
	SECURITAS B	22,844	133.30	3,045,105.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	219.40	3,986,498.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	67.95	2,630,480.40	
	HENNES & MAURITZ B	76,436	255.60	19,537,041.60	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	287.50	1,647,375.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	296.70	4,494,708.30	
	SCA SV CELLULOSA B	48,571	246.10	11,953,323.10	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	147.20	2,332,384.00	
	NORDEA BANK AB	247,281	94.95	23,479,330.95	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	91.90	11,256,279.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	122,737	124.70	15,305,303.90	
	SWEDBANK AB-A	73,402	213.80	15,693,347.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	157.80	2,018,577.60	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	313.30	11,514,401.60	
	KINNEVIK AB - B	18,104	220.40	3,990,121.60	
	ERICSSON (LM) B	248,169	44.66	11,083,227.54	
	HEXAGON AB-B SHS	21,517	307.60	6,618,629.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	368.90	2,284,966.60	
	TELE2 AB-B SHS	21,310	71.50	1,523,665.00	
	TELIA CO AB	226,054	35.06	7,925,453.24	
	スウェーデンクローナ 小計	1,902,843		242,532,643.23 (2,832,781,272)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	89,391	136.30	12,183,993.30	
	NORSK HYDRO	106,150	39.41	4,183,371.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	303.60	4,089,492.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	178.90	1,247,111.90	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	187.90	1,126,460.50	
	MARINE HARVEST	32,238	146.00	4,706,748.00	
	ORKLA	71,839	77.90	5,596,258.10	
	DNB ASA	80,217	119.70	9,601,974.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	142.00	2,637,508.00	
	TELENOR ASA	60,821	128.60	7,821,580.60	
	ノルウェークローネ 小計	485,666		53,194,498.80 (675,570,134)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	380.90	2,819,040.90	
	NOVOZYMES A/S	20,167	242.50	4,890,497.50	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	431.00	7,637,320.00	
	ISS A/S	14,253	241.70	3,444,950.10	

	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,675.00	2,593,825.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,115.00	4,630,420.00
	DSV A/S	16,640	302.00	5,025,280.00
	PANDORA A/S	9,443	789.00	7,450,527.00
	CARLSBERG AS-B	9,351	604.50	5,652,679.50
	COLOPLAST-B	10,121	458.10	4,636,430.10
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	124.00	920,080.00
	GENMAB A/S	4,512	1,226.00	5,531,712.00
	NOVO NORDISK A/S-B	154,877	234.50	36,318,656.50
	DANSKE BANK A/S	55,801	204.90	11,433,624.90
	TRYG A/S	9,828	129.10	1,268,794.80
	TDC A/S	72,376	35.24	2,550,530.24
	デンマーククローネ 小計	410,717		106,804,368.54 (1,656,535,756)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	29.05	599,272.45
	OIL SEARCH LTD	121,189	6.42	778,033.38
	ORIGIN ENERGY LIMITED	154,987	5.20	805,932.40
	SANTOS	128,132	3.44	440,774.08
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,670	27.88	1,691,479.60
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.56	266,766.77
	AMCOR	100,473	14.33	1,439,778.09
	BHP BILLITON LTD	260,140	22.56	5,868,758.40
	BORAL LIMITED	68,971	5.83	402,100.93
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	136,041	5.43	738,702.63
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.04	457,820.96
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	18.14	677,764.82
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	25.35	1,550,380.65
	ORICA LTD	29,211	16.22	473,802.42
	RIO TINTO LTD	34,814	53.73	1,870,556.22
	SOUTH32 LTD	455,699	2.48	1,130,133.52
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	28.47	262,493.40
	BRAMBLES LTD	129,297	11.00	1,422,267.00
	SEEK LTD	26,358	13.90	366,376.20
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.86	775,106.82
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	2.93	100,074.15
	TRANSURBAN GROUP	162,844	10.20	1,661,008.80
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	14.30	625,267.50
	CROWN RESORTS LTD	30,328	10.51	318,747.28
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	71.36	394,121.28
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	29.53	96,356.39
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.62	289,817.22
	TATTS GROUP LTD	124,218	3.97	493,145.46

	REA GROUP LTD	3,593	51.79	186,081.47
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.73	213,620.99
	WESFARMERS LTD	90,949	40.46	3,679,796.54
	WOOLWORTHS LTD	102,821	22.73	2,337,121.33
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.35	431,315.50
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	10.12	590,755.00
	COCHLEAR LIMITED	5,007	122.80	614,859.60
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.29	321,238.91
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,467	70.78	882,414.26
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	20.62	655,241.74
	CSL LIMITED	36,947	97.15	3,589,401.05
	AUST AND NZ BANKING GROUP	236,424	26.47	6,258,143.28
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	9.91	352,796.00
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.45	443,435.30
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,214	70.89	9,868,880.46
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	214,209	25.79	5,524,450.11
	WESTPAC BANKING	270,573	29.66	8,025,195.18
	AMP LTD	244,230	4.42	1,079,496.60
	ASX LTD	15,814	45.50	719,537.00
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	10.10	445,086.80
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,553	74.10	1,819,377.30
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	4.78	96,685.06
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	202,082	5.20	1,050,826.40
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.45	525,554.40
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	9.39	1,061,943.27
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	11.47	1,180,503.87
	COMPUTERSHARE LIMITED	42,996	10.23	439,849.08
	TELSTRA CORP	342,339	4.84	1,656,920.76
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.07	222,528.25
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	41,989	5.44	228,420.16
	AGL ENERGY LTD	59,029	19.28	1,138,079.12
	AUSNET SERVICES	120,230	1.47	177,339.25
	オーストラリアドル 小計	5,913,204		81,813,732.86 (6,621,185,400)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,607	9.50	594,766.50
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.49	551,325.50
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	8.30	301,431.10
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.43	498,890.07
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	4.52	266,512.76
	MERCURY NZ LTD	61,741	2.95	182,444.65
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.54	280,781.76
		560,571		2,676,152.34

	ニュージーランドドル 小計			(206,438,391)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	218,496	94.05	20,549,548.80
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	13.40	1,326,600.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	10.40	894,400.00
	MTR CORP	114,000	42.10	4,799,400.00
	LI & FUNG	554,800	3.64	2,019,472.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	28.90	3,439,100.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	76,000	29.00	2,204,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	206,000	32.25	6,643,500.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	14.68	986,496.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	34.65	7,027,020.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.46	829,080.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.39	711,480.00
	WYNN MACAU LTD	102,800	11.20	1,151,360.00
	WH GROUP LTD	476,500	6.28	2,992,420.00
	BANK EAST ASIA	109,160	30.40	3,318,464.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	302,000	26.50	8,003,000.00
	HANG SENG BANK	61,100	138.60	8,468,460.00
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.56	711,680.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	93,300	202.40	18,883,920.00
	AIA GROUP LTD	977,400	47.45	46,377,630.00
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	216,496	51.80	11,214,492.80
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	16.24	2,809,520.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	94,996	42.55	4,042,079.80
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	34.75	2,050,250.00
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	22.40	862,400.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	507,500	8.82	4,476,150.00
	SINO LAND CO	235,400	11.50	2,707,100.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	104.30	12,203,100.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	79.65	3,225,825.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.00	2,116,400.00
	WHARF HOLDINGS	119,000	56.70	6,747,300.00
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	44.00	2,860,000.00
	PCCW LTD	357,000	4.55	1,624,350.00
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	50,000	64.70	3,235,000.00
	CLP HOLDINGS	133,500	78.10	10,426,350.00
	HONG KONG & CHINA GAS	609,846	15.12	9,220,871.52
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	73.20	8,125,200.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	74.80	1,772,760.00
	香港ドル 小計	7,271,194		231,056,179.92 (3,146,985,170)
	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.34	599,682.00



シンガポールドル	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	2.58	147,060.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	1.35	82,215.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.07	334,630.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	0.80	107,065.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	206,400	2.45	505,680.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.82	425,530.06	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.86	367,625.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	3.71	471,541.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	41.96	415,404.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.37	155,030.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	155,000	3.32	514,600.00	
	DBS GROUP	141,300	15.12	2,136,456.00	
	OCBC BANK	248,000	8.45	2,095,600.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	18.41	1,910,958.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	76,900	7.04	541,376.00	
	CAPITALAND LTD	229,700	3.03	695,991.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	43,900	8.50	373,150.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	2.04	507,960.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	5.70	185,250.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.86	2,474,039.98		
STARHUB LTD	38,000	3.10	117,800.00		
シンガポールドル 小計		3,661,976		15,164,643.04 (1,144,627,256)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	14.47	473,979.32	
	BANK HAPOLIM BM	95,896	22.35	2,143,275.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	15.40	1,783,227.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	52.26	428,532.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	162.40	702,055.20	
	NICE LTD	4,894	261.00	1,277,334.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	7.00	1,082,242.00	
イスラエルシェケル 小計		416,469		7,890,645.72 (218,255,260)	
合 計		91,129,541		249,156,600,766 (249,156,600,766)	

## (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	472,900	203,347.00	
	アメリカドル 小計		472,900	203,347.00 (21,479,543)	

オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	704,028.06	
	DUET GROUP	177,921	414,555.93	
	LENDLEASE GROUP	44,009	565,515.65	
	SYDNEY AIRPORT	89,860	552,639.00	
オーストラリアドル 小計		401,361	2,236,738.64 (181,019,258)	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,678,005.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,948,540.00	
香港ドル 小計		407,500	3,626,545.00 (49,393,542)	
投資信託受益証券合計		1,281,761	251,892,343 (251,892,343)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	532,130.04
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,956	649,561.36
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,344	3,751,051.68
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	836,369.40
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,027	1,866,871.10
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,449,175.60
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	590,956.60
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	567,785.52
		CROWN CASTLE INTL CORP	27,204	2,332,198.92
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,652	1,245,471.96
		DUKE REALTY CORP	29,929	738,947.01
		EQUINIX INC	5,582	1,942,145.26
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,367	1,799,609.76
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,616	1,217,436.48
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	766,891.08
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,114	850,090.56
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	49,205	1,221,760.15
		HCP INC	39,974	1,152,450.42
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	956,740.68
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	671,629.42
		KIMCO REALTY CORP	36,105	919,955.40
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	450,654.64
		MACERICH CO/THE	10,128	685,969.44
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,929	555,843.75
		PROLOGIS INC	42,281	2,054,010.98
		PUBLIC STORAGE	11,880	2,583,424.80
		REALTY INCOME CORP	22,062	1,227,088.44
REGENCY CENTERS CORP	8,492	583,060.72		
SIMON PROPERTY GROUP	25,046	4,527,815.88		
SL GREEN REALTY CORP	8,067	802,101.81		

	UDR INC	20,960	722,491.20	
	VENTAS INC	27,151	1,643,178.52	
	VEREIT INC	77,798	680,732.50	
	VORNADO REALTY TRUST	14,547	1,314,903.33	
	WELLTOWER INC	28,695	1,800,611.25	
アメリカドル 小計		851,973	45,691,115.66 (4,826,352,547)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	212,075.65	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	405,838.00	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5,631	175,687.20	
カナダドル 小計		30,576	793,600.85 (62,496,066)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	178,054.80	
	GECINA SA	3,549	455,691.60	
	ICADE	2,845	183,388.70	
	KLEPIERRE	19,272	695,815.56	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,964	1,690,757.20	
ユーロ 小計		35,940	3,203,707.86 (369,836,035)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	86,531	517,022.72	
	HAMMERSON PLC	61,184	338,041.60	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	199,155.19	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	62,454	621,417.30	
	SEGRO PLC	64,553	269,056.90	
イギリスポンド 小計		348,211	1,944,693.71 (255,532,753)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	663,846.40	
	GOODMAN GROUP	140,271	937,010.28	
	GPT GROUP	136,015	625,669.00	
	MIRVAC GROUP	306,089	621,360.67	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,821,851.01	
	STOCKLAND	210,651	910,012.32	
	VICINITY CENTERS	297,425	844,687.00	
	WESTFIELD CORP	161,441	1,396,464.65	
オーストラリアドル 小計		1,752,645	7,820,901.33 (632,945,544)	
香港ドル	LINK REIT	179,500	9,845,575.00	
香港ドル 小計		179,500	9,845,575.00 (134,096,731)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	462,150.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	222,365.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	404,606.00	

	SUNTEC REIT	173,000	288,910.00	
	シンガポールドル 小計	713,800	1,378,031.00 (104,013,779)	
	投資証券合計	3,912,645	6,385,273,455 (6,385,273,455)	
	合計		6,637,165,798 (6,637,165,798)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 590銘柄	97.1%			64.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			2.9%	1.9%
カナダドル	株式 87銘柄	99.4%			3.9%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	98.8%			12.0%
	投資証券 5銘柄			1.2%	0.1%
イギリスポンド	株式 106銘柄	98.6%			7.2%
	投資証券 5銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.6%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	89.1%			2.6%
	投資信託受 益証券 4銘柄		2.4%		0.1%
	投資証券 8銘柄			8.5%	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	94.5%			1.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.5%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.0%	0.1%
シンガポールドル	株式 22銘柄	91.7%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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28年11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	19,069,078
コール・ローン	617,377,256
投資証券	67,540,108,800
未収入金	117,827,064
未収配当金	594,124,516
前払金	40,758,840
差入委託証拠金	58,680,000
流動資産合計	68,987,945,554
<b>資産合計</b>	68,987,945,554
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,760,784
未払解約金	140,471,279
未払利息	1,265
その他未払費用	12
流動負債合計	181,233,340
<b>負債合計</b>	181,233,340
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	45,008,650,396
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	23,798,061,818
元本等合計	68,806,712,214
<b>純資産合計</b>	68,806,712,214
<b>負債純資産合計</b>	68,987,945,554

### 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11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11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> <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28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	45,008,650,396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) 1.5287円 (15,287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28年11月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

平成28年11月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成28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	9,309,876,125円
期中一部解約元本額	7,473,015,339円
期末元本額	45,008,650,396円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,678,169,224円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,139,514円
SMT J-REITインデックス・オープン	8,652,756,361円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	20,913,129,723円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,522,208,639円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,192,417,316円
分散投資コア戦略ファンドA	822,580,321円
分散投資コア戦略ファンドS	1,453,854,530円
コア投資戦略ファンド（切替型）	585,176,568円
J-REITインデックス・オープン	333,326,745円
SMT インデックスバランス・オープン	37,663,966円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	869,127,500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）	936,099,989円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成28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	333,710,308
合計	333,710,308

(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28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	不動産投信指数先物取引 買建	1,297,880,784	-	1,257,120,000	40,760,784
	合計	1,297,880,784	-	1,257,120,000	40,760,784

(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	2,890	1,345,295,000	
	MCUBS MidCity投資法人	1,587	521,329,500	
	森ヒルズリート投資法人	10,441	1,520,209,600	
	産業ファンド投資法人	2,103	1,114,590,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	8,052	2,335,080,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	2,082	618,354,000	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	3,576	1,782,636,000	
	GLP投資法人	17,016	2,205,273,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,063	741,246,000	
	日本プロロジスリート投資法人	10,986	2,633,344,200	
	星野リゾート・リート投資法人	975	562,575,000	
	SIA不動産投資法人	565	198,880,000	

イオンリート投資法人	7,810	980,936,000	
ヒューリックリート投資法人	6,233	1,113,837,100	
日本リート投資法人	2,337	612,060,300	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,864	399,820,800	
日本ヘルスケア投資法人	445	78,275,500	
積水ハウス・リート投資法人	5,332	765,142,000	
トーセイ・リート投資法人	1,093	109,409,300	
ケネディクス商業リート投資法人	2,520	611,604,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	719	77,148,700	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,688	137,065,600	
ジャパン・シニアリビング投資法人	505	73,124,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	24,949	4,183,947,300	
いちごホテルリート投資法人	1,536	203,366,400	
ラサールロジポート投資法人	6,561	705,963,600	
スターアジア不動産投資法人	2,056	181,339,200	
マリモ地方創生リート投資法人	543	41,213,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,336	432,196,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,051	78,825,000	
さくら総合リート投資法人	1,986	151,531,800	
日本ビルファンド投資法人	8,422	5,011,090,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	7,809	4,544,838,000	
日本リテールファンド投資法人	15,222	3,496,493,400	
オリックス不動産投資法人	15,057	2,595,826,800	
日本プライムリアルティ投資法人	5,207	2,322,322,000	
プレミア投資法人	7,855	1,047,071,500	
東急リアル・エステート投資法人	5,831	793,599,100	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,156	453,152,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	17,613	3,034,719,900	
森トラスト総合リート投資法人	7,873	1,279,362,500	
インヴィンシブル投資法人	21,923	1,183,842,000	
フロンティア不動産投資法人	2,958	1,410,966,000	
平和不動産リート投資法人	6,053	473,344,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,249	1,167,902,500	
福岡リート投資法人	4,455	769,824,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,415	1,475,565,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	6,569	771,200,600	
いちごオフィスリート投資法人	9,139	663,491,400	
大和証券オフィス投資法人	2,969	1,716,082,000	
阪急リート投資法人	3,564	526,402,800	
スターツプロシード投資法人	1,036	162,755,600	
大和ハウスリート投資法人	9,061	2,585,103,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	22,437	1,678,287,600	

	日本賃貸住宅投資法人	9,782	752,235,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	7,788	1,109,011,200	
	合計	344,343	67,540,108,800	

(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28年11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	118,630,614
金銭信託	753,888
コール・ローン	24,407,745
投資証券	59,751,154,138
派生商品評価勘定	110
未収入金	2,634,241
未収配当金	121,225,796
流動資産合計	60,018,806,532
資産合計	60,018,806,532
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,000
未払解約金	43,065,683
未払利息	50
流動負債合計	43,091,733
負債合計	43,091,733
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	40,584,757,626
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	19,390,957,173
元本等合計	59,975,714,799
純資産合計	59,975,714,799
負債純資産合計	60,018,806,532

### 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28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	40,584,757,626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 1.4778円 (1万口当たり純資産額) (14,778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28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28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 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。

## （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28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	8,382,134,445円
期中一部解約元本額	3,547,514,542円
期末元本額	40,584,757,626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）	222,628,423円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,621,774,587円
SBI資産設計オープン（分配型）	11,177,934円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,087,772,504円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	20,351,519,285円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,708,801,019円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,226,804,962円
分散投資コア戦略ファンドA	560,476,301円
分散投資コア戦略ファンドS	995,484,732円
コア投資戦略ファンド（切替型）	398,576,864円
グローバルREITインデックス・オープン	44,317,660円
SMT インデックスバランス・オープン	188,422,612円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,091,750,454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）	422,763,768円
FOFs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）	652,486,521円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

平成28年11月10日現在
---------------

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	53,417,277
合計	53,417,277

(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28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	371,435,790	-	371,409,900	25,890
	アメリカドル	237,645,000	-	237,622,500	22,500
	カナダドル	8,661,290	-	8,661,400	110
	ユーロ	103,898,700	-	103,896,000	2,700
	イギリスポンド	13,139,200	-	13,139,000	200
	オーストラリアドル	8,091,600	-	8,091,000	600
合計		371,435,790	-	371,409,900	25,890

(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	43,900	1,439,920.00	
		AGREE REALTY CORP	11,660	533,328.40	
		ALEXANDER'S INC	1,790	690,045.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	43,590	4,753,925.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	21,510	850,075.20	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	73,330	3,533,039.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	118,010	2,448,707.50	
		APARTMENT INVEST & MGMT	88,020	3,831,510.60	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	86,130	1,517,610.60	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	15,370	207,956.10	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	14,500	180,235.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	280,783.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	76,140	12,890,502.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	112,320.00	
		BOSTON PROPERTIES	85,300	10,048,340.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	96,660	1,406,403.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	145,530	3,499,996.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	49,100	3,930,946.00	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	48,505	1,196,133.30	
		CARETRUST REIT INC	29,800	399,916.00	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	99,170	1,073,019.40	
		CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	202,243.50	
		CHATHAM LODGING TRUST	18,110	336,121.60	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	34,200	778,050.00	
		CITY OFFICE REIT INC	8,000	98,560.00	
		COLONY STARWOOD HOMES	27,140	785,160.20	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	70,840	1,481,264.40	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	7,200	161,856.00	
		CORESITE REALTY CORP	18,730	1,315,595.20	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	54,460	1,471,509.20	
		CORRECTIONS CORP OF AMERICA	62,680	1,273,030.80	
		COUSINS PROPERTIES INC	188,293	1,400,899.92	
		CUBESMART	97,530	2,559,187.20	
CYRUSONE INC	40,650	1,704,048.00			
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	49,117	2,207,317.98			
DDR CORPORATION	166,890	2,508,356.70			
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	117,180	1,122,584.40			
DIGITAL REALTY TRUST INC	81,670	7,450,754.10			



DOUGLAS EMMETT INC-W/I	77,860	2,796,731.20	
DUKE REALTY CORP	195,880	4,836,277.20	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	41,440	1,660,500.80	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	10,600	198,326.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	18,990	1,252,580.40	
EDUCATION REALTY TRUST INC	41,706	1,737,471.96	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	70,830	1,353,561.30	
EPR PROPERTIES	34,580	2,373,225.40	
EQUITY COMMONWEALTH	71,210	2,077,195.70	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	43,410	3,086,451.00	
EQUITY ONE INC	50,790	1,396,217.10	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	202,740	12,423,907.20	
ESSEX PROPERTY TRUST	36,430	7,897,295.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	70,210	5,335,257.90	
FARMLAND PARTNERS INC	6,000	61,260.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,530	5,496,251.20	
FELCOR LODGING TRUST INC	64,920	426,524.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	66,680	1,722,344.40	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	26,460	219,618.00	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	117,650	2,145,936.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	32,686	599,461.24	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	609,554.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	104,300	3,237,472.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	324,570	8,059,073.10	
GEO GROUP INC/THE	40,000	1,158,400.00	
GETTY REALTY CORP	13,132	296,783.20	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,150	177,523.50	
GLOBAL NET LEASE INC	93,000	700,290.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	42,110	781,140.50	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	230,310	1,953,028.80	
HCP INC	259,720	7,487,727.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	63,310	1,827,126.60	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	75,120	2,126,647.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	23,920	442,041.60	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	53,560	2,540,886.40	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	89,310	2,421,194.10	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	413,620	6,663,418.20	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	60,400	1,983,536.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	31,000	264,430.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	392,923.50	
IRON MOUNTAIN INC	136,850	4,485,943.00	

ISTAR INC	35,000	392,000.00
KILROY REALTY CORPORATION	49,830	3,456,707.10
KIMCO REALTY CORP	233,970	5,961,555.60
KITE REALTY GROUP TRUST	46,390	1,130,524.30
LASALLE HOTEL PROPERTIES	62,320	1,587,290.40
LEXINGTON CORP PROPERTIES	118,750	1,143,562.50
LIBERTY PROPERTY TRUST	79,460	3,029,015.20
LIFE STORAGE INC	25,330	2,091,498.10
LTC PROPERTIES INC	22,190	995,665.30
MACERICH CO/THE	67,360	4,562,292.80
MACK-CALI REALTY CORP	51,700	1,342,132.00
MANULIFE US REAL ESTATE INV	270,000	225,450.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	174,060	2,104,385.40
MID-AMERICA APARTMENT COMM	42,400	3,975,000.00
MONMOUTH REIT -CL A	33,500	454,595.00
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	97,600	1,016,992.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	82,610	3,490,272.50
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	16,000	322,240.00
NATL HEALTH INVESTORS INC	22,360	1,564,976.40
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	396,400.00
NEW YORK REIT INC	93,720	891,277.20
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	184,900.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	302,454.60
NORTHSTAR REALTY FINANCE	103,770	1,433,063.70
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	104,626	3,049,847.90
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	194,160.00
PARKWAY INC	20,326	348,184.38
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,320	1,047,110.40
PENN REAL ESTATE INVEST TST	39,470	753,877.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	74,240	1,345,228.80
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	82,960	1,593,661.60
POST PROPERTIES	30,420	2,023,538.40
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	14,000	182,280.00
PROLOGIS INC	291,970	14,183,902.60
PS BUSINESS PARKS INC	10,860	1,144,752.60
PUBLIC STORAGE	82,590	17,960,021.40
QTS REALTY TRUST INC	27,430	1,246,967.80
QUALITY CARE PROPERTIES	51,944	739,682.56
RAMCO-GERSHENSON PRYS	39,850	673,863.50
REALTY INCOME CORP	143,660	7,990,369.20
REGENCY CENTERS CORP	58,470	4,014,550.20
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	60,440	1,175,558.00

RETAIL PROPERTISE OF AME-A	134,750	2,023,945.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	37,500	775,500.00	
RLJ LODGING TRUST	71,440	1,477,379.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	29,330	1,585,286.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	38,400	810,624.00	
SAUL CENTERS INC	5,300	326,904.00	
SELECT INCOME REIT	35,920	867,108.80	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	128,910	2,369,365.80	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	13,810	614,545.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	17,380	295,807.60	
SIMON PROPERTY GROUP	173,730	31,406,909.40	
SL GREEN REALTY CORP	55,950	5,563,108.50	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	259,660	2,861,453.20	
STAG INDUSTRIAL INC	41,910	931,659.30	
STORE CAPITAL CORP	83,470	2,130,989.10	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	49,380	651,322.20	
SUN COMMUNITIES INC	33,950	2,548,287.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,060	1,647,516.80	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	52,580	1,794,555.40	
TAUBMAN CENTERS INC	32,870	2,326,538.60	
TERRENO REALTY CORP	26,010	674,179.20	
TIER REIT INC	28,000	421,960.00	
UDR INC	149,160	5,141,545.20	
UMH PROPERTIES INC	14,000	171,780.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	326,208.60	
URBAN EDGE PROPERTIES	52,705	1,317,625.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	12,770	272,767.20	
VENTAS INC	194,780	11,788,085.60	
VEREIT INC	538,860	4,715,025.00	
VORNADO REALTY TRUST	95,460	8,628,629.40	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	103,000	1,005,280.00	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	40,940	1,174,568.60	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	64,030	2,245,532.10	
WELLTOWER INC	198,380	12,448,345.00	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	32,000	51,200.00	
WHITESTONE REIT	13,600	176,256.00	
WP CAREY INC	59,460	3,435,598.80	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,380	881,095.80	
アメリカドル 小計	11,874,826	407,993,078.04 (43,096,308,833)	
カナダドル			
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	67,520.00	

ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	24,900	851,829.00	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	34,460	401,459.00	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,610	653,280.00	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	7,307	188,082.18	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	37,790	1,131,432.60	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	20,730	947,153.70	
CHOICE PROPERTIES REIT	25,100	321,531.00	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	52,190	724,397.20	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,550	360,814.50	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	218,854.00	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	33,000	300,300.00	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	13,650	102,784.50	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	25,290	431,194.50	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,510	630,894.80	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	77,320	1,734,287.60	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18,000	130,860.00	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	218,700.00	
MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	16,970	307,326.70	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	105,094.80	
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	195,416.20	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	11,403	226,805.67	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	13,390	137,113.60	
ONEREIT	25,000	88,500.00	
PLAZA RETAIL REIT	25,650	127,480.50	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	70,000	373,100.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	87,820	2,300,884.00	
SLATE OFFICE REI	9,400	76,986.00	
SLATE RETAIL REIT	7,000	95,830.00	
SMART REAL ESTATE INVSTMENT	36,010	1,123,512.00	
カナダドル 小計	787,520	14,573,424.05 (1,147,657,143)	
ユーロ			
AEDIFICA	8,160	591,436.80	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	58,000	671,930.00	
ALTAREA	1,300	222,300.00	
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	33,600	425,040.00	
BEFIMMO S.C.A.	13,560	704,035.20	

	BENI STABILI SPA	547,000	280,337.50
	COFINIMMO	11,260	1,178,359.00
	EUROCOMMERCIAL	26,100	916,762.50
	FONCIERE DES REGIONS	26,820	2,067,285.60
	GECINA SA	22,500	2,889,000.00
	GREEN REIT PLC	337,170	441,692.70
	HAMBORNER REIT AG	47,000	415,010.00
	HIBERNIA REIT PLC	383,290	494,060.81
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	62,080	672,326.40
	ICADE	24,970	1,609,566.20
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	157,540	107,521.05
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,900	165,634.50
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	244,020.00
	KLEPIERRE	115,860	4,183,125.30
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	52,000	338,000.00
	MERCIALYS	31,020	579,298.50
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	176,560	1,709,100.80
	MONTEA	2,900	131,631.00
	NSI NV	83,000	289,089.00
	RETAIL ESTATES	2,600	196,950.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	55,040	11,684,992.00
	VASTNED RETAIL	11,300	394,483.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,820	643,977.00
	WERELDHAVE BELGIUM	1,000	113,400.00
	WERELDHAVE NV	22,600	903,435.00
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,800	64,116.00
	ユーロ 小計	2,540,750	35,327,915.86 (4,078,254,606)
イギリスポ ンド	ASSURA PLC	904,900	527,556.70
	BIG YELLOW GROUP PLC	82,640	571,455.60
	BRITISH LAND CO PLC	572,800	3,422,480.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	220,000	124,850.00
	DERWENT LONDON PLC	60,900	1,487,178.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	240,000	266,400.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	197,730	1,204,175.70
	HAMMERSON PLC	441,430	2,438,900.75
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	433,580	460,028.38
	INTU PROPERTIES PLC	495,970	1,344,078.70
	LAND SECURITIES GROUP PLC	446,880	4,446,456.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	351,380	516,879.98
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	39,967	75,837.38
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	28,000	129,465.00

	NEWRIVER REIT PL	130,000	406,250.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	296,040	328,604.40	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	722,000	288,944.40	
	REGIONAL REIT LTD	92,000	97,060.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	114,990	407,639.55	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	141,250.00	
	SEGRE PLC	451,990	1,883,894.32	
	SHAFTESBURY PLC	152,970	1,397,380.95	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	628,110	846,064.17	
	WORKSPACE GROUP PLC	59,490	401,260.05	
	イギリスポンド 小計	7,413,767	23,214,090.03 (3,050,331,429)	
オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	110,000	101,200.00	
	360 CAPITAL OFFICE FUND	22,000	48,400.00	
	ABACUS PROPERTY GROUP	122,010	335,527.50	
	ALE PROPERTY GROUP	92,000	393,760.00	
	ARENA REIT	114,000	210,900.00	
	ASPEN GROUP	70,000	74,900.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	21,820	146,194.00	
	BWP TRUST	232,960	680,243.20	
	CHARTER HALL GROUP	235,340	1,075,503.80	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	189,170	788,838.90	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	731,940	662,405.70	
	DEXUS PROPERTY GROUP	538,720	4,826,931.20	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	254,310.00	
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	208,910.92	
	GENERATION HEALTHCARE REIT	69,000	127,650.00	
	GOODMAN GROUP	880,890	5,884,345.20	
	GPT GROUP	1,007,070	4,632,522.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	85,200	262,416.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	216,060.00	
	INDUSTRIA REIT	75,000	157,500.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,000	238,500.00	
	INVESTA OFFICE FUND	328,190	1,391,525.60	
	MIRVAC GROUP	2,082,280	4,227,028.40	
NATIONAL STORAGE REIT	233,217	332,334.22		
SCENTRE GROUP	2,956,330	12,623,529.10		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	402,000	872,340.00		
STOCKLAND	1,329,530	5,743,569.60		
VICINITY CENTERS	1,829,740	5,196,461.60		
WESTFIELD CORP	1,063,500	9,199,275.00		
	オーストラリアドル 小計	15,310,195	60,913,081.94 (4,929,695,721)	

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	425,375.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	622,180	759,059.60	
	INVESTORE PROPERTY LTD	102,000	147,900.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	742,000	1,061,060.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	580,000	716,300.00	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	220,000	349,800.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	174,000	316,680.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	177,460	363,793.00	
ニュージーランドドル 小計		3,032,640	4,139,967.60	(319,357,100)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,251,000	5,667,030.00	
	FORTUNE REIT	742,000	6,997,060.00	
	LINK REIT	1,246,500	68,370,525.00	
	PROSPERITY REIT	592,000	1,977,280.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	447,000	916,350.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	393,000	1,253,670.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	582,000	2,758,680.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	599,000	2,701,490.00	
香港ドル 小計		5,852,500	90,642,085.00	(1,234,545,197)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	280,000	378,000.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	430,000	316,050.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,278,266	2,991,142.44	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	501,000	571,140.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	565,200	466,290.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	521,000	286,550.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,184,300	1,841,586.50	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,472,100	2,973,642.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	356,560	506,315.20	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	339,000	450,870.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	231,455.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	258,000	335,400.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	353,800	718,214.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	340,000	448,800.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	658,200	635,163.00	
	KEPPEL DC REIT	469,460	568,046.60	
	KEPPEL REIT	1,012,800	1,088,760.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	1,234,000	481,260.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	999,230	1,543,810.35	

	MAPLETREE GREATER CHINA COM	1,086,000	1,102,290.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	679,560	1,148,456.40	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	886,320	912,909.60	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	240,000	168,000.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	732,000	486,780.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	495,000.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	337,000	171,870.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	210,386.00	
	SPH REIT	375,000	363,750.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	746,300	582,114.00	
	SUNTEC REIT	1,395,800	2,330,986.00	
	シンガポールドル 小計	19,639,096	24,805,037.09 (1,872,284,199)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	72,370	821,399.50	
	イスラエルシェケル 小計	72,370	821,399.50 (22,719,910)	
	合計	66,523,664	59,751,154,138 (59,751,154,138)	

## 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 159銘柄	100.0%	72.1%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	6.8%
イギリスポンド	投資証券 24銘柄	100.0%	5.1%
オーストラリアドル	投資証券 29銘柄	100.0%	8.3%
ニュージーランドドル	投資証券 8銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 8銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.1%
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10期中間計算期間(平成28年11月11日から平成29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9期 （平成28年11月10日現在）	第10期中間計算期間 （平成29年 5月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	13,063,672	-
コール・ローン	422,947,264	490,514,482
親投資信託受益証券	23,226,586,700	25,591,457,575
未収入金	47,830,000	15,560,000
流動資産合計	23,710,427,636	26,097,532,057
資産合計		
	23,710,427,636	26,097,532,057
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	17,543,277	104,352,548
未払受託者報酬	4,951,955	5,364,025
未払委託者報酬	79,231,226	85,824,323
未払利息	866	762
その他未払費用	1,189,399	671,699
流動負債合計	102,916,723	196,213,357
負債合計		
	102,916,723	196,213,357
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	18,252,171,405	18,165,584,145
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,355,339,508	7,735,734,555
（分配準備積立金）	2,933,550,481	2,588,065,238
元本等合計	23,607,510,913	25,901,318,700
純資産合計		
	23,607,510,913	25,901,318,700
負債純資産合計		
	23,710,427,636	26,097,532,057

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第10期中間計算期間 自 平成28年11月11日 至 平成29年 5月10日
営業収益		
受取利息	59,488	229
有価証券売買等損益	1,009,666,437	2,506,970,875
営業収益合計	1,009,606,949	2,506,971,104
営業費用		
支払利息	15,485	135,524
受託者報酬	4,564,163	5,364,025
委託者報酬	73,026,661	85,824,323
その他費用	582,948	672,896
営業費用合計	78,189,257	91,996,768
営業利益又は営業損失（ ）	1,087,796,206	2,414,974,336
経常利益又は経常損失（ ）	1,087,796,206	2,414,974,336
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,087,796,206	2,414,974,336
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（ ）	63,098,940	202,320,681
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,868,956,733	5,355,339,508
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,038,615,089	844,504,443
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,038,615,089	844,504,443
剰余金減少額又は欠損金増加額	430,161,969	676,763,051
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	430,161,969	676,763,051
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,452,712,587	7,735,734,555

## ( 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9期 (平成28年11月10日現在)	第10期中間計算期間 (平成29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	18,252,171,405口	18,165,584,145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) 1.2934円 (12,934円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4258円 (14,258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10期中間計算期間 (平成29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10期中間計算期間 (平成29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9期 自 平成27年11月11日 至 平成28年11月10日	第10期中間計算期間 自 平成28年11月11日 至 平成29年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,848,925,687円	18,252,171,405円
期中追加設定元本額	5,479,073,321円	2,197,117,295円
期中一部解約元本額	2,075,827,603円	2,283,704,555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29年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	583,004,305
国債証券	245,674,164,750

	平成29年 5月10日現在
項目	金額（円）
地方債証券	16,991,590,242
特殊債券	22,339,611,758
社債券	12,450,289,110
未収入金	307,015,900
未収利息	656,439,528
前払費用	9,715,487
流動資産合計	299,011,831,080
資産合計	299,011,831,080
負債の部	
流動負債	
未払金	60,367,200
未払解約金	460,357,761
未払利息	906
その他未払費用	5,247
流動負債合計	520,731,114
負債合計	520,731,114
純資産の部	
元本等	
元本	216,063,047,401
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,428,052,565
元本等合計	298,491,099,966
純資産合計	298,491,099,966
負債純資産合計	299,011,831,080

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29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>
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29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	216,063,047,401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 104,897,000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 1.3815円 (1万口当たり純資産額) (13,815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29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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29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28年11月11日



区分	平成29年 5月10日現在
期首元本額	224,832,108,590円
期中追加設定元本額	24,124,491,385円
期中一部解約元本額	32,893,552,574円
期末元本額	216,063,047,401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）	2,980,122,358円
S B I 資産設計オープン（分配型）	22,388,450円
S M T 国内債券インデックス・オープン	9,196,599,799円
世界経済インデックスファンド	790,704,141円
D C マイセレクション 2 5	15,747,291,995円
D C マイセレクション 5 0	18,229,765,901円
D C マイセレクション 7 5	4,953,964,932円
D C 日本債券インデックス・オープン	448,779,563円
D C 日本債券インデックス・オープン S	69,197,004,072円
D C 日本債券インデックス・オープン P	30,915,416,644円
D C マイセレクション S 2 5	6,433,063,131円
D C マイセレクション S 5 0	7,192,304,520円
D C マイセレクション S 7 5	1,391,943,085円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,271,581,805円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	886,435,255円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	259,035,725円
D C 世界経済インデックスファンド	865,890,647円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	191,805,880円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,329,705円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	104,648,926円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	18,012,890円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	929,660円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	398,747,460円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	585,675,138円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	104,991,528円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	238,140,619円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	6,298,958,280円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,231,649,591円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,682,122,753円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,066,651,663円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	523,630,640円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,666,883,091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）	1,596,667,834円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,826,533,196円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,584,506,810円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	190,713,407円

区分	平成29年 5月10日現在
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,686,337,684円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,987,747,107円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	28,098,952円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	352,769,369円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	59,653,783円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,983,312円
S M T インデックスバランス・オープン	85,569,811円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	3,106,018円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	6,719,663,031円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年 5月10日現在 金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,714,054,848
株式	161,217,219,794
派生商品評価勘定	109,178,800
未収入金	832,643,720
未収配当金	1,481,853,063
差入委託証拠金	91,905,600
流動資産合計	165,446,855,825
資産合計	165,446,855,825
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,900
前受金	109,122,500
未払解約金	739,490,451
未払利息	2,665
その他未払費用	8,286
流動負債合計	848,701,802
負債合計	848,701,802
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	118,085,954,543
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,512,199,480
元本等合計	164,598,154,023
純資産合計	164,598,154,023
負債純資産合計	165,446,855,825

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29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。
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29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	118,085,954,543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 1.3939円 (1万口当たり純資産額) (13,939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29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ぬ。

	平成29年 5月10日現在
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成29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28年11月11日
期首元本額	128,212,719,874円
期中追加設定元本額	7,301,772,429円
期中一部解約元本額	17,428,537,760円
期末元本額	118,085,954,543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)	841,731,940円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,989,987,121円
SBI資産設計オープン(分配型)	27,167,092円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,178,526,230円

区分	平成29年 5月10日現在
世界経済インデックスファンド	1,011,383,067円
日本株式インデックス・オープン	10,221,992,666円
DCマイセレクション25	5,589,707,345円
DCマイセレクション50	16,957,228,352円
DCマイセレクション75	15,656,645,185円
DC日本株式インデックス・オープン	4,923,819,993円
DCマイセレクションS25	2,289,781,165円
DCマイセレクションS50	6,702,714,822円
DCマイセレクションS75	4,349,225,083円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,978,061,736円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	432,523,238円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	574,566,753円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	315,612,503円
DC世界経済インデックスファンド	1,143,260,057円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	316,432,145円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	25,716,000円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	94,869,703円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	54,709,191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）	569,012,664円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,806,754円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	207,914,104円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	757,944,698円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	112,065,481円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	871,502,823円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,717,025,030円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,032,077,605円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,767,984,830円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	910,836,762円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	243,977,905円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,161,706,224円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,224,613,674円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	641,197,010円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	905,175,260円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	69,041,999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）	1,376,977,779円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,835,396,401円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,573,515,225円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	99,374,143円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	118,560,494円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	202,935,510円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	12,570,156円
SMT インデックスバランス・オープン	91,008,034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）	4,905,072,591円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成29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	3,093,609,100	-	3,202,710,000	109,100,900
	合計	3,093,609,100	-	3,202,710,000	109,100,900

## (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

項目	平成29年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	162,622,461
コール・ローン	2,715,449,827
国債証券	214,154,608,607
派生商品評価勘定	59,413,435
未収入金	14,824,850
未収利息	1,719,495,762
前払金	9,924,876
前払費用	106,570,646
差入委託証拠金	132,921,222
流動資産合計	219,075,831,686
資産合計	219,075,831,686
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,232,857
未払金	29,278,835
未払解約金	353,176,262
未払利息	4,221
その他未払費用	7,296
流動負債合計	392,699,471
負債合計	392,699,471
純資産の部	
元本等	
元本	81,974,445,245
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	136,708,686,970
元本等合計	218,683,132,215
純資産合計	218,683,132,215

	平成29年 5月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	219,075,831,686

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29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29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		81,974,445,245口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6677円 (26,677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29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29年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	



区分	平成29年 5月10日現在
期首	平成28年11月11日
期首元本額	74,103,205,642円
期中追加設定元本額	14,559,934,690円
期中一部解約元本額	6,688,695,087円
期末元本額	81,974,445,245円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,405,218,735円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	930,501,098円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	668,084,521円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,816,200,702円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,872,580円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,556,533,266円
世界経済インデックスファンド	3,094,646,091円
D C マイセレクション 2 5	1,389,996,371円
D C マイセレクション 5 0	1,188,476,086円
D C マイセレクション 7 5	695,471,662円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,592,228,609円
D C マイセレクション S 2 5	567,838,484円
D C マイセレクション S 5 0	468,864,319円
D C マイセレクション S 7 5	190,500,690円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	56,092,211円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	51,205,691円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	21,276,950円
D C 世界経済インデックスファンド	3,446,089,193円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	499,156,583円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	89,777,230円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,830,569円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,757,234円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	80,492,122円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	237,753,705円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	374,046,729円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	277,545,571円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	719,452,236円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,193,038,459円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	824,798,802円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,905,998,045円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,174,871,277円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	440,516,475円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	855,682,605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）	2,090,912,966円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	312,707,995円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	446,958,581円

区分	平成29年 5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）	1,434,387,955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）	907,949,697円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	665,809,229円
外国債券ファンド・シリーズ1	573,950,823円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,358,935,279円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,751,411,170円
分散投資コア戦略ファンドA	932,213,780円
分散投資コア戦略ファンドS	2,054,640,441円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	95,948,757円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,095,036,967円
コア投資戦略ファンド（切替型）	580,556,375円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	197,003,614円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	113,018,548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）	624,277,255円
S M T インデックスバランス・オープン	266,537,224円
外国債券S M T Bセレクション（S M A専用）	22,033,019,266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）	1,209,774,692円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	1,010,570,042円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	383,009,688円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（平成29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	1,740,536,004	-	1,730,611,128	9,924,876
合計		1,740,536,004	-	1,730,611,128	9,924,876

（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29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	2,237,432,265	-	2,296,725,800	59,293,535
	アメリカドル	1,042,273,215	-	1,065,542,400	23,269,185
	カナダドル	98,584,970	-	99,648,000	1,063,030
	ユーロ	930,506,890	-	958,983,800	28,476,910
	イギリスポンド	166,067,190	-	172,551,600	6,484,410
	売建	66,789,843	-	66,977,924	188,081
	ユーロ	66,289,384	-	66,475,317	185,933
	マレーシアリン ギット	500,459	-	502,607	2,148
	合計	2,304,222,108	-	2,363,703,724	59,105,454

## (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29年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,802,021,691
コール・ローン	107,931,443
株式	295,683,860,277
投資信託受益証券	269,689,724
投資証券	7,497,801,106
派生商品評価勘定	134,219,138
未収入金	103,112,322
未収配当金	416,848,083
差入委託証拠金	1,326,129,326
流動資産合計	311,341,613,110
資産合計	311,341,613,110
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,856,296
前受金	133,091,172
未払解約金	455,080,153
未払利息	167
その他未払費用	870
流動負債合計	591,028,658
負債合計	591,028,658
純資産の部	
元本等	
元本	138,331,124,760
剰余金	

	平成29年 5月10日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	172,419,459,692
元本等合計	310,750,584,452
純資産合計	310,750,584,452
負債純資産合計	311,341,613,110

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

平成29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29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	138,331,124,760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 2,2464円 (1万口当たり純資産額) (22,464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29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29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29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28年11月11日
期首元本額	141,784,624,521円
期中追加設定元本額	13,357,211,319円
期中一部解約元本額	16,810,711,080円
期末元本額	138,331,124,760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）	2,536,565,829円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,809,148円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,670,934,791円
世界経済インデックスファンド	3,857,697,698円
外国株式インデックス・オープン	937,410,214円
D C マイセレクション 2 5	913,396,787円
D C マイセレクション 5 0	4,630,469,687円
D C マイセレクション 7 5	4,952,365,371円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,942,578,617円
D C マイセレクション S 2 5	373,043,487円

区分	平成29年 5月10日現在
DCマイセレクションS50	1,825,592,565円
DCマイセレクションS75	1,378,452,839円
DCターゲット・イヤーフンド2025	135,738,916円
DCターゲット・イヤーフンド2035	183,233,736円
DCターゲット・イヤーフンド2045	99,044,006円
DC世界経済インデックスファンド	4,317,239,003円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,737,895,586円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	25,962,386円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	17,457,829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）	103,153,748円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	127,438,212円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	474,972,062円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	69,414,529円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	539,785,218円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,153,049,015円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	570,072,739円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,672,476,468円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	2,816,143,579円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	452,687,477円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	552,826,301円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	556,276,977円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	174,455,171円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,589,968,281円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	3,012,225,327円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,368,075,593円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,677,093,880円
コア投資戦略ファンド（成長型）	11,129,244,616円
分散投資コア戦略ファンドA	1,848,735,138円
分散投資コア戦略ファンドS	3,406,719,886円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	375,735,328円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	466,098,541円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,176,791,320円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	778,700,332円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	47,738,143円
SMT インデックスバランス・オープン	341,320,370円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	3,447,607,275円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,611,066,359円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	2,239,364,380円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

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	株価指数先物取引 買建	6,695,627,815	-	6,828,718,987	133,091,172
合計		6,695,627,815	-	6,828,718,987	133,091,172

## (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29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 売建	742,032,370	-	743,760,700	1,728,330
	アメリカドル	461,018,800	-	462,231,000	1,212,200
	カナダドル	15,715,850	-	15,777,600	61,750
	ユーロ	138,710,210	-	138,947,200	236,990
	イギリスポンド	66,150,200	-	66,366,000	215,800
	スウェーデンク ローナ	15,779,670	-	15,780,900	1,230
	オーストラリアド ル	30,128,760	-	30,128,400	360
	シンガポールドル	14,528,880	-	14,529,600	720
合計		742,032,370	-	743,760,700	1,728,330

## (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 - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表



	平成29年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	687,843,903
投資証券	67,311,952,550
派生商品評価勘定	2,240,700
未収入金	188,291,818
未収配当金	610,658,929
前払金	16,835,380
差入委託証拠金	30,135,000
流動資産合計	68,847,958,280
資産合計	68,847,958,280
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,076,080
未払解約金	207,202,683
未払利息	1,069
その他未払費用	2,619
流動負債合計	226,282,451
負債合計	226,282,451
純資産の部	
元本等	
元本	43,465,073,932
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,156,601,897
元本等合計	68,621,675,829
純資産合計	68,621,675,829
負債純資産合計	68,847,958,280

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29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29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29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	43,465,073,932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 1.5788円 (1万口当たり純資産額) (15,788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29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29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28年11月11日
期首元本額	45,008,650,396円
期中追加設定元本額	3,115,329,079円
期中一部解約元本額	4,658,905,543円
期末元本額	43,465,073,932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）	1,672,211,057円
S B I 資産設計オープン（分配型）	11,409,931円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	9,376,871,346円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	19,287,014,476円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,249,666,481円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,605,461,974円
分散投資コア戦略ファンドA	870,741,466円
分散投資コア戦略ファンドS	1,705,204,000円
コア投資戦略ファンド（切替型）	561,197,154円
J - R E I T インデックス・オープン	314,213,855円
S M T インデックスバランス・オープン	40,500,593円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	713,936,375円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	1,423,546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）	1,055,221,678円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（平成29年 5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	1,317,050,380	-	1,300,215,000	16,835,380
	合計	1,317,050,380	-	1,300,215,000	16,835,380

## (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29年 5月10日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	263,420,719
コール・ローン	9,967,475
投資証券	61,342,442,634
派生商品評価勘定	180
未収入金	46,953,291
未収配当金	124,332,623
流動資産合計	61,787,116,922
資産合計	61,787,116,922
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,350
未払解約金	27,688,721
未払利息	15
その他未払費用	159
流動負債合計	27,748,245
負債合計	27,748,245
純資産の部	
元本等	
元本	36,572,414,067
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,186,954,610
元本等合計	61,759,368,677
純資産合計	61,759,368,677
負債純資産合計	61,787,116,922

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成29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29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29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	36,572,414,067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 1.6887円 (1万口当たり純資産額) (16,887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29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29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28年11月11日
期首元本額	40,584,757,626円
期中追加設定元本額	965,429,292円
期中一部解約元本額	4,977,772,851円
期末元本額	36,572,414,067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）	207,802,884円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,616,313,487円

区分	平成29年 5月10日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	11,080,254円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	7,546,546,624円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	17,951,355,585円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,449,543,843円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,603,604,707円
分散投資コア戦略ファンドA	565,171,629円
分散投資コア戦略ファンドS	1,089,665,203円
コア投資戦略ファンド（切替型）	351,065,879円
グローバルR E I Tインデックス・オープン	35,241,606円
S M T インデックスバランス・オープン	214,942,714円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	849,366,540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）	405,945,516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）	674,767,596円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（平成29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				
	売建	50,331,430	-	50,390,600	59,170
	カナダドル	5,812,870	-	5,812,800	70
	ユーロ	21,031,210	-	21,090,200	58,990
	イギリスポンド	16,222,910	-	16,222,800	110
	シンガポールドル	7,264,440	-	7,264,800	360
合計		50,331,430	-	50,390,600	59,170

#### (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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29年 5月31日現在）

資産総額	25,594,784,080円
負債総額	22,338,246円
純資産総額（ - ）	25,572,445,834円
発行済口数	18,110,063,110口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4121円
（1万口当たり純資産額）	（14,121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29年 5月31日現在）

資産総額	310,620,835,485円
負債総額	7,941,521,590円
純資産総額（ - ）	302,679,313,895円
発行済口数	218,868,699,842口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3829円
（1万口当たり純資産額）	（13,829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29年 5月31日現在）

資産総額	164,256,185,342円
負債総額	1,516,607,258円
純資産総額（ - ）	162,739,578,084円
発行済口数	117,960,386,203口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3796円
（1万口当たり純資産額）	（13,796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29年 5月31日現在）

資産総額	219,862,138,300円
負債総額	172,212,666円
純資産総額（ - ）	219,689,925,634円
発行済口数	82,691,974,269口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6567円
（1万口当たり純資産額）	（26,567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29年 5月31日現在）

資産総額	306,056,643,188円
負債総額	277,782,824円
純資産総額（ - ）	305,778,860,364円
発行済口数	138,277,727,597口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2113円
（1万口当たり純資産額）	（22,113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29年 5月31日現在）

資産総額	69,881,516,981円
負債総額	935,982,169円
純資産総額（ - ）	68,945,534,812円
発行済口数	44,210,813,794口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5595円
（1万口当たり純資産額）	（15,595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29年 5月31日現在）

資産総額	60,791,607,626円
負債総額	17,974,685円
純資産総額（ - ）	60,773,632,941円
発行済口数	36,611,710,838口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6600円
（1万口当たり純資産額）	（16,600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、

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、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、

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、

###### 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29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29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29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	479	9,061,021
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	52	206,711
単位型公社債投資信託	0	0
合計	531	9,267,732

## 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28年4月1日 至 平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		16,534,066		20,260,630
前払費用		102,445		143,622
未収委託者報酬		5,528,610		5,252,944
繰延税金資産		121,367		61,677
その他		5,566		5,474
流動資産合計		22,292,056		25,724,348
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	55,487	1	47,993
器具備品	1	90,924	1	73,765
その他	1	3,748	1	2,830
有形固定資産合計		150,160		124,589
無形固定資産				
ソフトウェア		215,175		221,499
その他		5,886		6,656
無形固定資産合計		221,062		228,156
投資その他の資産				
投資有価証券		63,797		71,153
長期前払費用		8,021		9,828
長期貸付金		22,838		19,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		123,235		137,359
その他		235		145
貸倒引当金		22,838		19,838
投資その他の資産合計		220,289		243,485
固定資産合計		591,512		596,231
資産合計		22,883,569		26,320,580

( 単位：千円 )

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
負債の部				

流動負債		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
固定負債		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
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	68,500	71,500
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	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

前事業年度

当事業年度

（自 平成27年4月 1日  
至 平成28年3月31日）

（自 平成28年4月 1日  
至 平成29年3月31日）

営業収益		
委託者報酬	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612
旅費交通費	67,392	61,961
租税公課	73,989	106,691
不動産賃借料	125,339	113,697
減価償却費	126,985	134,710
業務委託費	1 209,510	1 486,690
諸経費	217,580	223,685
一般管理費合計	3,246,214	3,304,885
営業利益	6,525,812	6,261,346

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）	当事業年度 （自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日）
営業外収益		
受取利息	8,092	4,669
収益分配金	2,026	129
投資有価証券売却益	350	307



貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				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	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

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	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	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405

当期末残高	1,134	1,134	21,847,309
-------	-------	-------	------------

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28千円増加しております。

## 追加情報

「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）を当事業年度から適用しております。

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
建 物	54,302	千円	62,231	千円
器具備品	263,257	〃	298,576	〃

その他	841	〃	1,759	〃
計	318,401	〃	362,567	〃

## (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27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	業務委託費	39,733	千円	39,286
長期前払費用償却	27,866	〃	4,644	〃

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------------	-----	-------

平成28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日
----------------------	------	--------	--------	------------	------------

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

平成29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29年6月30日 定時株主総会	普通 株式	30,000	利益 剰余金	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

(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。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(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28年3月31日	平成29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	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499

(有価証券関係)

## 1. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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

（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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

（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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) 退職給付債務	389,941	437,197
(2) 退職給付引当金	389,941	437,197

- (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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) 退職給付費用	73,742	76,106

- (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14,434千円、当事業年度で14,321千円であります。

## 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28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	86,931	千円	28,688	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,993	"	6,074	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,437	"	30,265	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	119,400	"	133,869	"
その他	7,674	"	6,972	"
繰延税金資産 合計	251,436	"	205,870	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	244,602	"	199,037	"

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

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

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

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

(関連情報)

### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

### 2. 地域ごとの情報

#### (1) 営業収益

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



## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成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いません。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

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。

当事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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

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

## 2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（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）

当事業年度（平成29年3月31日）

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

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	5,848,968円06銭	7,282,436円46銭
1株当たり当期純利益金額	1,447,521円33銭	1,443,463円05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27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
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)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成29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29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29年3月末日現在）	事業の内容

株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
-----------	--------	-------------------------------

## 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29年3月末日現在）

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

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

## 第3【その他】

### (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書

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

### (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

### (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

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

## 独立監査人の監査報告書

平成29年 6月 2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第31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29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. X B R 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29年1月10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28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29年7月10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28年11月11日から平成29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29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28年11月11日から平成29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。