

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年4月20日提出
【計算期間】	第7期(自 平成27年1月21日至 平成28年1月20日)
【ファンド名】	世界経済インデックスファンド
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【電話番号】	03-6737-0522
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

?

DR(預託証券)とは

ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

＜信託金限度額＞

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。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MR F	特殊型
	内外	不動産投信	E T F	
		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	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回	(日本を含む)	ファンド・	なし	TOPIX	条件付運用型
大型株	年4回	日本	オブ・ファンズ		その他 ()	ロング・
中小型株	年6回 (隔月)	北米				ショート型/絶対 収益追求型
債券	年12回 (毎月)	欧州				その他 ()
一般	日々	アジア				
公債	その他 ()	オセアニア				
社債		中南米				
その他債券		アフリカ				
クレジット属性 ()		中近東 (中東)				
不動産投信		エマージ ング				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券)資産 配分固定型))						
資産複合 ()						
資産配分 固定型						
資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

＜商品分類表定義＞

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

- (1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)特殊型…目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊

型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

- ①一般…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。
- ②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。
- ③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

- ①一般…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。
- ②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。
- ③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。
- ④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。
- ⑤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①から④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①から④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。

- ①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。
- ②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＞

特色 1 世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

世界の債券及び株式に分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)への連動を目指す運用を行います。
原則として、為替ヘッジは行いません。



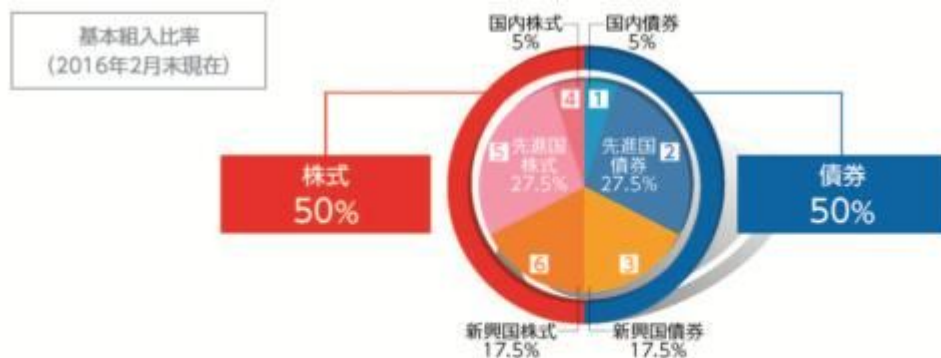
ファミリーファンド方式とは
投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

特色 2 世界経済全体の発展を享受します。

基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定します。
※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。



(出所) IMF「世界経済見通し2015年10月データ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※上記のファンドの地域別構成比は、2016年2月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



●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回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合があります。

資産	インデックス
① 国内債券	NOMURA-BPI総合 ^{※1}
② 先進国債券	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース） ^{※2}
③ 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） ^{※3}
④ 国内株式	TOPIX（東証株価指数） ^{※4}
⑤ 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース） ^{※5}
⑥ 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース） ^{※6}

*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。

※1「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。

※2「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。

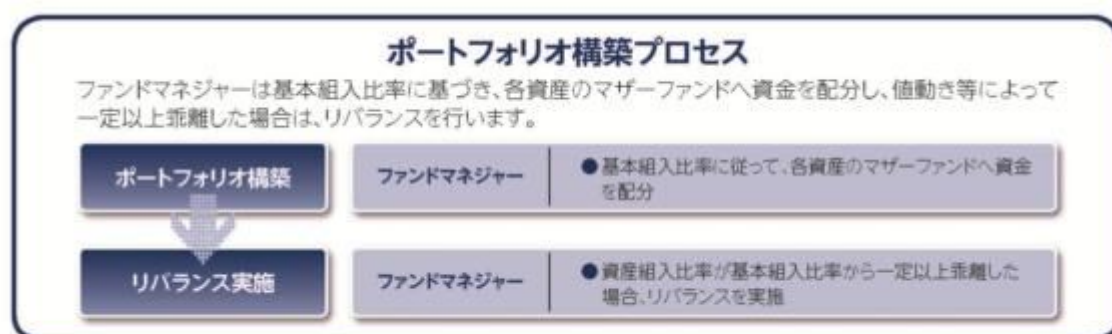
※3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

※4「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。

※5「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。

※6「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。「円換算ベース」は、米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。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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



信託報酬を抑えたファンドです。

運用管理費用（信託報酬）は純資産総額に対して **年率0.54%（税抜0.5%）** です。

（注）ご換金時には信託財産留保額として換金申込受付日の翌営業日の基準価額の **0.1%** ががかかります。

なお、一部のマザーファンドの換金に伴う信託財産留保額をファンドが負担します。詳しくは後記「4手数料等及び税金（2）換金（解約）手数料」をご覧ください。

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

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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。

〈ご参考情報〉

新興国は世界経済における存在感を増しています。



世界人口が増加し人々が生活水準の向上を目指し生産と消費を拡大することで、世界経済は長期にわたり持続的な成長を実現しました。世界経済における新興国の人口やGDPの割合は年々増加しています。

世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects(The 2015 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2016年1月改訂のデータ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成21年 1月16日

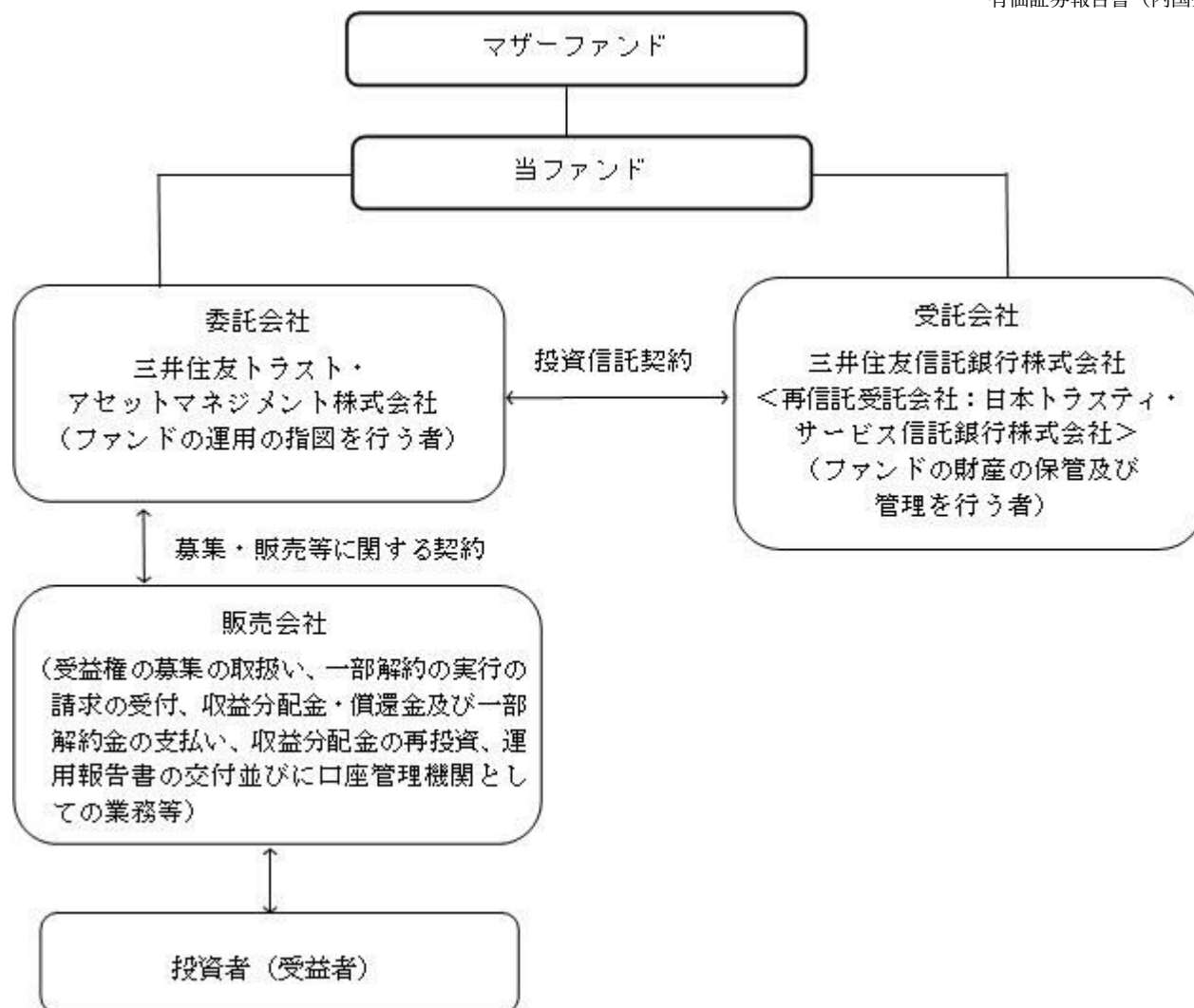
当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

平成24年 4月 1日

当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 新興国債券インデックス マザーファンド」の名称を「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の名称を「新興国株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（平成28年 2月29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

ハ. 大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、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」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「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、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）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指して運用を行うことを基本とします。

②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。

③投資態度

- イ. 主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）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指して運用を行うことを基本とします。
- ロ. 株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。
- ハ. 各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、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。
- ニ. 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回見直しを行う場合があります。
- ホ. 実質組入外貨建資産については、原則として、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。
- ヘ. 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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（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。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
- ト. ただし、資金動向及び市況動向の急激な変化が生じたとき等並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】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ. 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。）

1.有価証券

2.デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第21条、第22条及び第23条に定めるものに限り。）

3.金銭債権

4.約束手形

ロ.次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる1.から6.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会社とし、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並びに7.から28.までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.国内債券インデックス 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.新興国債券インデックス マザーファンド

6.新興国株式インデックス マザーファンド

7.株券又は新株引受権証券

8.国債証券

9.地方債証券

10.特別の法律により法人の発行する債券

11.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

12.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

13.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

14.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

15.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

16.コマーシャル・ペーパー

17.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

18.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7.から17.の証券又は証書の性質を有するもの

19.証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

20.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

21.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

22.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り。）

23.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

24.外国法人が発行する譲渡性預金証書

25.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。）

26.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

27.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28.外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

1.預金

2.指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ. 当ファンドの設定、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、信託金を上記イ.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

①NOMURA-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。

②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。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。

④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及び金利に係るオプション取引並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及び金利に

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。

- ⑤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、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①同一銘柄の転換社債、並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号及び第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。
- ②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。
- ③外貨建資産への投資は、行いません。
- ④一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。
- ⑤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

- ①原則として東京証券取引所市場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。
- ②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。
- ③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。
- ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。
- ⑤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

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券及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。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

- ⑤同一銘柄の転換社債並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。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券及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。
- ⑦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。
- ⑧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。
- ⑨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、新株予約権証券又は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。

「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

- ①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。
- ②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。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。
- ④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及び金利に係るオプション取引並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及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並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。
- ⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又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。
- ⑥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、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①同一銘柄の転換社債並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。

- ②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。
- ③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ④一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。
- ⑤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。

「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目指して、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

- ①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。
- ②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。
- ③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。
- ④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。
- ⑤有価証券等の価格変動リスク及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、及び通貨に係る選択権取引並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、及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。
- ⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。
- ⑦投資信託財産に属する資産の効率的な運用並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。
- ⑧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

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③新株引受権証券及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。

- ④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。
- ⑤同一銘柄の転換社債並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。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券及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。
- ⑦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。
- ⑧一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。
- ⑨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、新株予約権証券又は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。

「新興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、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、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（円換算ベース）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

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

- ①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、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（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。
- ②組入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。
- ③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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡し取引及び為替先渡し取引を行うことができます。
- ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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

- ①株式への投資は行いません。
- ②同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ④一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

スポン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。

- ⑤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。

「新興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、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）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

取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。なお、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

(2)投資態度

- ①主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。
- ②株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。
- ③組入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。
- ④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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡し取引及び為替先渡し取引を行うことができます。
- ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。

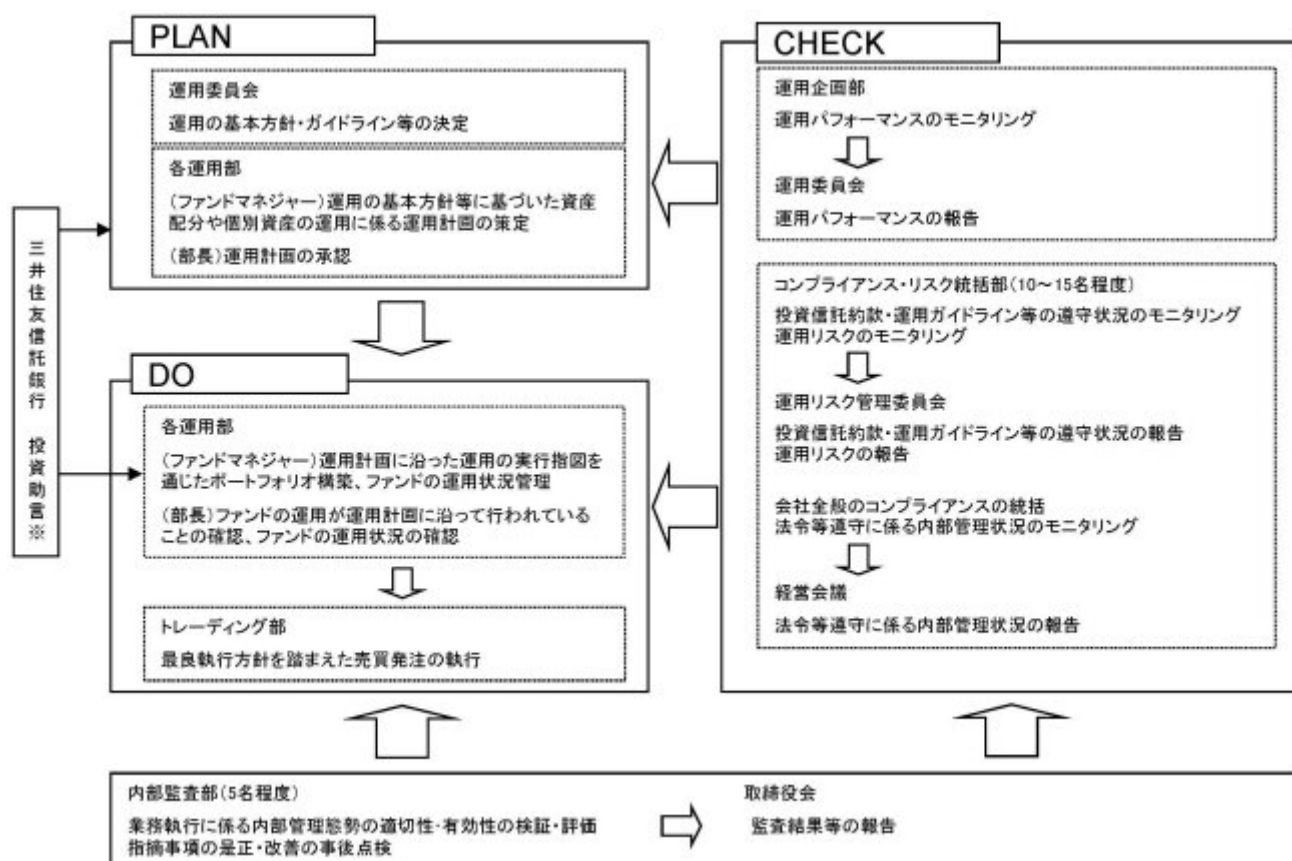
3. 運用制限

- ①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④一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。

- ⑤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、新株予約権証券又は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。

（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＞

- イ. 株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- ロ. 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ. 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ニ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ホ. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
 6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- ヘ. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができま

す。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

- ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及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、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。
- リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ヌ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付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。
- ル．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ヲ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資

信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- ワ. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並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、又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又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、解約代金及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。
- カ. 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。
- コ. 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、新株予約権証券又は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。

<関連法令に基づく投資制限>

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑥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。

※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＞

①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。

②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。

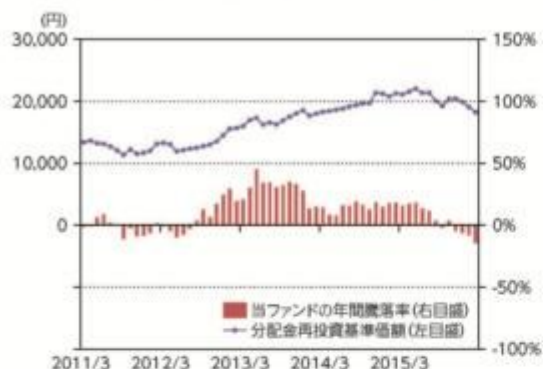
③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ①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。
- ②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。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2011年3月～2016年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{*1}
 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{*2}
 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{*3}
 日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}
 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{*5}
 新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)^{*6}

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

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

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

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

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

※5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売却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認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

- ①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（※1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

※1：「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（以下同じ。）。

- ②「分配金再投資コース」（※2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※2：収益分配金の受取方法により、「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。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。

- ③上記①及び②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、下記に記載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0.1%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。また、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

※「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

- ①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 0.54%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.216% (税抜 0.2%)	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 0.27% (税抜 0.25%)	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 0.054% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

- ②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。
- ③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

- ①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。）。
- ②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。
- ③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。
- ④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。
- ⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①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（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ. 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。

②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。）

③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。

ニ. 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「④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。）

④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。

※上記は、平成28年 2月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成28年 2月29日現在の状況について記載してあります。

【世界経済インデックスファンド】

（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	16,577,089,224	98.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	275,135,178	1.63
合計(純資産総額)		16,852,224,402	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】

①【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	外国債券インデックス マザーファンド	1,810,221,598	2.7264	4,935,533,760	2.6822	4,855,376,370	28.81
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	2,589,038,118	1.7891	4,632,078,237	1.7816	4,612,630,311	27.37
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	1,932,950,355	1.4208	2,746,370,931	1.4233	2,751,168,240	16.33
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	1,435,247,613	1.8924	2,716,093,649	1.8999	2,726,826,939	16.18
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	780,677,954	1.1402	890,197,154	1.1059	863,351,749	5.12
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	554,882,636	1.3496	748,881,036	1.3836	767,735,615	4.56

(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	98.37
合計	98.37

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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22年 1月20日）	473,632,486	473,632,486	13,329	13,329
第2期計算期間末（平成23年 1月20日）	1,022,019,787	1,022,019,787	12,972	12,972
第3期計算期間末（平成24年 1月20日）	1,737,011,301	1,737,011,301	12,000	12,000
第4期計算期間末（平成25年 1月21日）	2,751,494,290	2,755,095,142	15,282	15,302
第5期計算期間末（平成26年 1月20日）	4,684,090,831	4,689,249,062	18,162	18,182
第6期計算期間末（平成27年 1月20日）	10,344,646,326	10,354,724,017	20,530	20,550
第7期計算期間末（平成28年 1月20日）	16,216,119,873	16,216,119,873	18,276	18,276
平成27年 2月末日	11,442,626,306	—	21,186	—
3月末日	12,043,316,813	—	21,040	—
4月末日	12,834,729,890	—	21,503	—
5月末日	13,787,274,828	—	21,946	—
6月末日	14,185,274,366	—	21,273	—
7月末日	15,051,458,268	—	21,292	—
8月末日	14,835,828,128	—	20,009	—
9月末日	14,910,480,976	—	19,163	—
10月末日	16,376,258,082	—	20,319	—
11月末日	16,855,308,135	—	20,352	—
12月末日	17,113,664,519	—	19,847	—
平成28年 1月末日	17,092,978,255	—	19,011	—
2月末日	16,852,224,402	—	18,170	—

②【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21年 1月16日～平成22年 1月20日	0
第2期計算期間	平成22年 1月21日～平成23年 1月20日	0
第3期計算期間	平成23年 1月21日～平成24年 1月20日	0
第4期計算期間	平成24年 1月21日～平成25年 1月21日	20
第5期計算期間	平成25年 1月22日～平成26年 1月20日	20

第6期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	20
第7期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成21年 1月16日～平成22年 1月20日	33.3
第2期計算期間	平成22年 1月21日～平成23年 1月20日	△2.7
第3期計算期間	平成23年 1月21日～平成24年 1月20日	△7.5
第4期計算期間	平成24年 1月21日～平成25年 1月21日	27.5
第5期計算期間	平成25年 1月22日～平成26年 1月20日	19.0
第6期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	13.1
第7期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	△11.0

(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21年 1月16日～平成22年 1月20日	440,530,128	85,183,261	355,346,867
第2期計算期間	平成22年 1月21日～平成23年 1月20日	627,431,255	194,904,418	787,873,704
第3期計算期間	平成23年 1月21日～平成24年 1月20日	911,791,372	252,161,321	1,447,503,755
第4期計算期間	平成24年 1月21日～平成25年 1月21日	907,508,119	554,585,762	1,800,426,112
第5期計算期間	平成25年 1月22日～平成26年 1月20日	1,918,803,387	1,140,113,813	2,579,115,686
第6期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	3,411,351,368	951,621,550	5,038,845,504
第7期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	5,409,151,344	1,574,902,402	8,873,094,446

(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	271,948,843,500	81.10
	ポーランド	201,638,000	0.06
	メキシコ	101,018,000	0.03
	小計	272,251,499,500	81.19

地方債証券	日本	19,607,599,785	5.85
特殊債券	日本	26,016,364,929	7.76
	アメリカ	209,746,000	0.06
	小計	26,226,110,929	7.82
社債券	日本	13,956,166,190	4.16
	オランダ	403,676,000	0.12
	オーストラリア	403,066,000	0.12
	スウェーデン	402,195,000	0.12
	フランス	201,330,000	0.06
	アメリカ	100,808,000	0.03
	小計	15,467,241,190	4.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,759,265,355	0.52
合計(純資産総額)		335,311,716,759	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の 種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
債券先物取引	買建	日本	304,320,000	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。

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125回利付国債（5年）	4,830,000,000	100.27	4,843,469,800	101.54	4,904,430,300	0.100	2020/9/20	1.46
日本	国債証券	第113回利付国債（5年）	4,390,000,000	100.93	4,430,827,000	101.29	4,446,894,400	0.300	2018/6/20	1.33
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	4,340,000,000	100.06	4,342,604,000	101.41	4,401,237,400	0.100	2020/3/20	1.31
日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	4,260,000,000	100.13	4,265,538,000	101.32	4,316,402,400	0.100	2019/12/20	1.29
日本	国債証券	第118回利付国債（5年）	4,250,000,000	100.62	4,276,350,000	101.51	4,314,345,000	0.200	2019/6/20	1.29
日本	国債証券	第116回利付国債（5年）	4,250,000,000	100.66	4,278,361,900	101.29	4,305,165,000	0.200	2018/12/20	1.28
日本	国債証券	第117回利付国債（5年）	4,220,000,000	100.64	4,247,008,000	101.41	4,279,628,600	0.200	2019/3/20	1.28

日本	国債証券	第355回利付国債（2年）	3,940,000,000	100.18	3,947,238,500	100.46	3,958,399,800	0.100	2017/8/15	1.18
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	3,480,000,000	99.95	3,478,504,800	104.64	3,641,646,000	0.400	2025/6/20	1.09
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	3,580,000,000	100.62	3,602,196,000	101.61	3,637,745,400	0.200	2019/9/20	1.08
日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	3,480,000,000	101.27	3,524,328,800	101.60	3,535,749,600	0.100	2020/12/20	1.05
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	3,410,000,000	102.20	3,485,199,200	103.60	3,532,760,000	0.300	2025/12/20	1.05
日本	国債証券	第105回利付国債（5年）	3,500,000,000	100.42	3,514,700,000	100.54	3,518,935,000	0.200	2017/6/20	1.05
日本	国債証券	第106回利付国債（5年）	3,260,000,000	100.47	3,275,354,600	100.65	3,281,320,400	0.200	2017/9/20	0.98
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	3,210,000,000	100.08	3,212,846,500	101.47	3,257,411,700	0.100	2020/6/20	0.97
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	3,020,000,000	104.39	3,152,806,400	106.74	3,223,729,200	0.800	2022/9/20	0.96
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	3,040,000,000	100.83	3,065,494,700	104.62	3,180,448,000	0.400	2025/9/20	0.95
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	2,830,000,000	103.02	2,915,542,000	106.17	3,004,667,600	0.600	2023/12/20	0.90
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,840,000,000	101.28	2,876,352,000	105.54	2,997,336,000	0.500	2024/9/20	0.89
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	2,860,000,000	100.08	2,862,288,000	104.66	2,993,304,600	0.400	2025/3/20	0.89
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,700,000,000	104.80	2,829,725,600	107.40	2,900,043,000	0.800	2023/6/20	0.86
日本	国債証券	第115回利付国債（5年）	2,850,000,000	100.64	2,868,408,300	101.18	2,883,687,000	0.200	2018/9/20	0.86
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,600,000,000	102.32	2,660,320,000	106.34	2,765,074,000	0.600	2024/6/20	0.82
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,490,000,000	103.83	2,585,591,100	103.15	2,568,435,000	1.500	2017/12/20	0.77
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,160,000,000	105.60	2,281,024,800	105.91	2,287,656,000	1.300	2019/12/20	0.68
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	104.93	2,203,614,000	104.51	2,194,710,000	1.500	2018/9/20	0.65
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	2,060,000,000	102.39	2,109,234,000	106.28	2,189,429,800	0.600	2024/3/20	0.65
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	103.92	2,172,011,600	102.98	2,152,365,600	1.700	2017/9/20	0.64
日本	国債証券	第324回利付国債（10年）	2,020,000,000	104.41	2,109,161,200	106.48	2,150,956,600	0.800	2022/6/20	0.64
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	1,990,000,000	104.21	2,073,779,000	107.58	2,140,961,400	0.800	2023/9/20	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.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	81.19
地方債証券	5.85
特殊債券	7.82
社債券	4.61
合計	99.48

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建		2円	304,260,648	304,320,000	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。

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	136,503,296,060	98.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,813,669,119	1.31
合計(純資産総額)		138,316,965,179	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	1,764,560,000	1.28

(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	884,600	8,324.33	7,363,707,970	5,897.00	5,216,486,200	3.77
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,632,300	881.20	4,963,223,393	486.60	2,740,677,180	1.98
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	542,600	4,370.39	2,371,374,420	4,806.00	2,607,735,600	1.89
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	397,700	7,126.33	2,834,141,862	5,574.00	2,216,779,800	1.60
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	471,100	4,489.31	2,114,914,245	4,490.00	2,115,239,000	1.53
日本	株式	KDDI	情報・通信業	713,100	2,816.38	2,008,362,000	2,878.00	2,052,301,800	1.48
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	640,100	4,129.81	2,643,493,428	2,887.00	1,847,968,700	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	562,100	5,397.15	3,033,741,196	3,164.00	1,778,484,400	1.29
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,894,200	264.86	2,620,606,476	166.10	1,643,426,620	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	296,700	5,957.41	1,767,563,818	5,371.00	1,593,575,700	1.15
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	541,400	2,258.24	1,222,612,832	2,641.50	1,430,108,100	1.03
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	834,100	1,784.27	1,488,259,998	1,624.00	1,354,578,400	0.98
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	293,700	5,139.07	1,509,345,936	4,495.00	1,320,181,500	0.95
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	130,000	11,216.67	1,458,167,542	9,916.00	1,289,080,000	0.93
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	63,700	21,395.76	1,362,910,464	20,215.00	1,287,695,500	0.93
日本	株式	キャノン	電気機器	382,900	4,155.47	1,591,130,518	3,163.00	1,211,112,700	0.88
日本	株式	ファナック	電気機器	72,800	26,167.31	1,904,980,526	16,600.00	1,208,480,000	0.87
日本	株式	ソニー	電気機器	501,800	3,669.22	1,841,216,274	2,387.00	1,197,796,600	0.87
日本	株式	花王	化学	200,400	5,651.54	1,132,569,010	5,699.00	1,142,079,600	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	284,400	5,002.19	1,422,625,302	3,936.00	1,119,398,400	0.81
日本	株式	三菱地所	不動産業	522,000	2,708.83	1,414,011,250	2,093.50	1,092,807,000	0.79
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	998,400	1,267.13	1,265,104,760	1,024.50	1,022,860,800	0.74
日本	株式	村田製作所	電気機器	74,600	19,454.05	1,451,272,725	13,565.00	1,011,949,000	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	251,400	4,966.39	1,248,552,214	3,953.00	993,784,200	0.72
日本	株式	三井不動産	不動産業	372,000	3,514.11	1,307,251,940	2,623.00	975,756,000	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	526,700	2,658.36	1,400,160,660	1,807.00	951,746,900	0.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,100	65,401.89	1,052,970,550	58,410.00	940,401,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	759,000	1,594.46	1,210,198,100	1,144.00	868,296,000	0.63
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,815,000	803.90	1,459,079,200	477.90	867,388,500	0.63
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	224,800	4,621.94	1,039,014,256	3,696.00	830,860,800	0.60

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	3.10
		食料品	5.05

	繊維製品	0.73
	パルプ・紙	0.25
	化学	5.92
	医薬品	5.76
	石油・石炭製品	0.49
	ゴム製品	0.97
	ガラス・土石製品	0.83
	鉄鋼	1.14
	非鉄金属	0.85
	金属製品	0.65
	機械	4.48
	電気機器	11.22
	輸送用機器	9.72
	精密機器	1.60
	その他製品	1.56
	電気・ガス業	2.21
	陸運業	4.79
	海運業	0.21
	空運業	0.70
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	8.25
	卸売業	4.17
	小売業	4.80
	銀行業	7.27
	証券、商品先物取引業	1.07
	保険業	2.42
	その他金融業	1.35
	不動産業	2.80
	サービス業	3.75
	小計	98.69
	合計	98.69

(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	137	円	1,793,706,320	1,764,560,000	1.28

(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	90,044,262,920	42.76
	フランス	20,335,153,324	9.66
	イタリア	20,170,279,749	9.58
	イギリス	16,109,838,814	7.65
	ドイツ	15,523,699,808	7.37
	スペイン	11,373,854,910	5.40
	ベルギー	5,402,720,672	2.57
	オランダ	5,095,058,612	2.42
	カナダ	4,293,095,789	2.04
	オーストラリア	3,724,913,306	1.77
	オーストリア	3,268,135,299	1.55
	メキシコ	1,918,659,995	0.91
	アイルランド	1,689,519,898	0.80
	デンマーク	1,318,324,853	0.63
	フィンランド	1,303,818,349	0.62
	ポーランド	1,146,589,221	0.54
	スウェーデン	1,006,327,888	0.48
	マレーシア	968,836,001	0.46
	南アフリカ	819,600,150	0.39
	シンガポール	751,869,338	0.36
	スイス	613,908,980	0.29
	ノルウェー	585,780,052	0.28
小計		207,464,247,928	98.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,130,674,540	1.49
合計(純資産総額)		210,594,922,468	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	221,274,947	0.11
	買建	ドイツ	333,329,673	0.16

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

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

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	—	710,718,400	0.34

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,450,000	11,331.62	1,410,786,760	11,721.94	1,459,382,107	2.125	2025/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/30/17	11,600,000	11,410.51	1,323,619,826	11,384.19	1,320,566,209	0.875	2017/4/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	10,300,000	11,260.44	1,159,826,142	11,986.91	1,234,651,730	2.875	2043/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/45	10,580,000	10,404.94	1,100,842,662	11,033.78	1,167,374,885	2.500	2045/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	10,000,000	11,244.78	1,124,478,961	11,452.76	1,145,276,284	1.375	2020/4/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	11,427.90	1,142,790,846	11,385.07	1,138,507,906	0.875	2017/1/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	11,244.06	1,124,406,244	11,313.62	1,131,362,276	0.625	2018/4/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	11,847.10	1,125,474,890	11,624.96	1,104,371,974	3.000	2017/2/28	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	9,500,000	11,155.27	1,059,751,124	11,593.23	1,101,357,270	2.000	2025/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	11,918.56	1,084,589,007	11,763.22	1,070,453,077	2.750	2017/12/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,224.85	1,010,237,142	11,363.55	1,022,719,807	1.000	2019/6/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	11,618.53	987,575,280	11,982.24	1,018,491,230	2.375	2024/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	11,747.02	986,749,756	12,102.30	1,016,593,646	2.500	2024/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.875% 08/15/17	8,800,000	11,402.83	1,003,449,232	11,380.64	1,001,496,393	0.875	2017/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	11,236.71	943,884,262	11,611.20	975,341,593	2.000	2025/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	8,520,000	11,256.14	959,023,719	11,412.37	972,334,302	1.250	2020/1/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	8,150,000	11,482.49	935,823,697	11,858.19	966,443,292	2.250	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	7,800,000	11,988.04	935,067,603	12,323.10	961,202,561	2.750	2024/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	8,000,000	11,842.00	947,360,006	11,648.49	931,879,281	2.750	2017/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 05/31/19	8,000,000	11,424.83	913,986,549	11,546.18	923,695,096	1.500	2019/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	7,900,000	11,652.92	920,581,419	11,549.51	912,411,876	1.875	2017/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	11,489.82	861,736,688	11,590.79	869,309,506	1.625	2019/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	6,900,000	12,006.88	828,474,873	12,327.99	850,631,440	2.750	2023/11/15	0.40

フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000	16,115.59	829,952,921	16,320.52	840,507,143	4.250	2023/10/25	0.40
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 03/01/20	5,800,000	14,280.29	828,257,331	14,354.37	832,553,833	4.250	2020/3/1	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	7,150,000	11,123.22	795,310,266	11,451.43	818,777,339	1.625	2022/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	6,500,000	11,694.90	760,168,929	12,554.34	816,032,379	3.125	2044/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	7,000,000	11,157.48	781,023,880	11,562.16	809,351,656	1.750	2022/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	7,000,000	11,052.88	773,702,033	11,523.33	806,633,208	1.750	2023/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	7,000,000	11,244.16	787,091,458	11,407.49	798,524,470	1.250	2020/2/29	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	98.51
合計	98.51

(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	8	アメリカ ドル	969,344.52	110,136,924	967,062.48	109,877,639	0.05
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	5	アメリカ ドル	653,129.39	74,208,561	651,875	74,066,037	0.04
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	2	アメリカ ドル	331,351.75	37,648,186	328,562.5	37,331,271	0.02
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	5	ユーロ	559,325	69,417,826	559,500	69,439,545	0.03
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	6	ユーロ	796,784	98,888,861	798,660	99,121,692	0.05
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	8	ユーロ	1,321,852	164,055,052	1,327,600	164,768,436	0.08

(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	3,250,000.00	367,292,010	369,070,000	0.18
	カナダドル	買建	490,000.00	40,237,705	41,042,400	0.02
	ユーロ	買建	1,750,000.00	219,646,645	217,157,500	0.10
	イギリスポンド	買建	530,000.00	85,972,670	83,448,500	0.04

(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	142,562,671,788	58.00
	イギリス	18,443,077,383	7.50
	スイス	9,941,229,462	4.04
	フランス	8,885,194,549	3.62
	ドイツ	8,730,551,602	3.55
	カナダ	8,585,909,501	3.49
	オーストラリア	5,693,126,980	2.32
	アイルランド	4,346,866,320	1.77
	オランダ	4,070,906,462	1.66
	スペイン	2,938,502,773	1.20
	スウェーデン	2,845,208,179	1.16
	香港	2,129,681,339	0.87
	デンマーク	1,961,249,901	0.80
	イタリア	1,880,909,061	0.77
	シンガポール	1,569,794,489	0.64
	ベルギー	1,407,201,029	0.57
	ジャージー	1,071,724,234	0.44
	フィンランド	989,165,391	0.40
	バミューダ	957,904,920	0.39
	キュラソー	797,952,718	0.32
	イスラエル	703,214,670	0.29
	ノルウェー	576,035,113	0.23
	ケイマン	559,034,221	0.23
	ルクセンブルク	200,799,678	0.08
	パナマ	168,352,763	0.07
	ニュージーランド	167,632,885	0.07
	ポルトガル	160,686,612	0.07
	オーストリア	157,718,163	0.06

	リベリア	111,846,105	0.05
	英ヴァージン諸島	89,486,385	0.04
	パプアニューギニア	54,706,489	0.02
	マン島	26,033,800	0.01
	モーリシャス	12,664,275	0.01
	小計	232,797,039,240	94.72
投資信託受益証券	オーストラリア	187,855,048	0.08
	香港	50,470,871	0.02
	シンガポール	23,641,595	0.01
	小計	261,967,514	0.11
投資証券	アメリカ	4,643,517,743	1.89
	オーストラリア	614,219,423	0.25
	フランス	380,407,380	0.15
	イギリス	304,505,382	0.12
	香港	112,437,303	0.05
	シンガポール	100,849,379	0.04
	カナダ	52,240,409	0.02
	小計	6,208,177,019	2.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,519,245,863	2.65
合計(純資産総額)		245,786,429,636	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	4,249,044,299	1.73
	買建	カナダ	376,139,280	0.15
	買建	ドイツ	1,151,884,025	0.47
	買建	イギリス	603,364,608	0.25
	買建	オーストラリア	274,995,245	0.11

(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	—	212,967,000	0.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	427,536	14,638.30	6,258,403,864	11,010.91	4,707,562,213	1.92
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	581,738	5,387.45	3,134,084,456	5,828.70	3,390,779,771	1.38
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	318,846	9,489.38	3,025,653,382	9,288.43	2,961,580,346	1.20
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	211,951	11,428.58	2,422,300,769	12,018.72	2,547,380,486	1.04
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	722,989	3,112.76	2,250,493,424	3,340.42	2,415,092,699	0.98
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	174,120	9,623.23	1,675,597,969	12,261.87	2,135,036,874	0.87
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	371,816	6,325.39	2,351,882,819	5,461.71	2,030,752,430	0.83
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	471,373	3,921.45	1,848,469,566	4,218.71	1,988,586,272	0.81
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	244,547	8,369.26	2,046,678,888	8,027.77	1,963,168,904	0.80
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	30,530	51,069.73	1,559,158,941	63,085.23	1,925,992,151	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	208,455	8,915.42	1,858,464,583	9,214.58	1,920,825,691	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	23,850	63,989.64	1,526,152,935	80,110.05	1,910,624,774	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	282,107	7,455.53	2,103,259,670	6,537.69	1,844,329,467	0.75
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	22,345	65,952.60	1,473,710,932	82,358.59	1,840,302,765	0.75
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	311,799	5,579.31	1,739,624,509	5,796.89	1,807,465,253	0.74
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	473,152	3,878.00	1,834,887,070	3,434.73	1,625,150,599	0.66
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	53,915	31,828.83	1,716,051,394	29,638.39	1,597,954,066	0.65
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	316,666	4,665.45	1,477,390,496	4,901.56	1,552,159,552	0.63
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	174,656	11,039.23	1,928,068,025	8,210.09	1,433,942,789	0.58

アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,262	12,872.60	1,252,015,368	14,345.66	1,395,287,700	0.57
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	144,279	11,275.99	1,626,889,096	9,583.84	1,382,747,861	0.56
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	90,921	16,180.65	1,471,161,181	14,988.75	1,362,792,175	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	120,395	12,402.68	1,493,221,356	10,829.12	1,303,772,167	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	190,391	6,670.01	1,269,911,092	6,579.73	1,252,722,174	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	111,745	11,003.23	1,229,556,867	11,175.66	1,248,824,484	0.51
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,422	7,965.09	1,190,160,215	8,263.58	1,234,761,039	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	118,803	9,568.41	1,136,756,602	10,390.54	1,234,428,393	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	214,289	6,670.04	1,429,317,931	5,753.71	1,232,958,219	0.50
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	362,362	3,767.50	1,365,200,964	3,385.87	1,226,912,799	0.50
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	389,719	3,269.83	1,274,316,517	3,000.70	1,169,431,440	0.48

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.56
		素材	4.26
		資本財	7.05
		商業・専門サービス	0.92
		運輸	1.84
		自動車・自動車部品	1.52
		耐久消費財・アパレル	1.86
		消費者サービス	1.88
		メディア	2.99
		小売	3.88
		食品・生活必需品小売り	2.21
		食品・飲料・タバコ	6.51
		家庭用品・パーソナル用品	2.33
		ヘルスケア機器・サービス	3.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.77
		銀行	8.06
		各種金融	3.72
		保険	4.10
		不動産	0.66

		ソフトウェア・サービス	8.49
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.92
		電気通信サービス	3.37
		公益事業	3.43
		半導体・半導体製造装置	1.70
		小計	94.72
投資信託受益証券	—	—	0.11
投資証券	—	—	2.53
合計			97.35

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	77	アメリカドル	36,346,796.5	4,129,723,018	37,396,975	4,249,044,299	1.73
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	30	カナダドル	4,390,895	368,000,910	4,488,000	376,139,280	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	34	スイスフラン	2,671,458	304,412,639	2,673,080	304,597,466	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	233	ユーロ	6,748,198.5	837,518,916	6,826,900	847,286,559	0.34
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	3,416,521	276,567,375	3,397,100	274,995,245	0.11
	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	63	イギリスポンド	3,672,836.25	578,545,166	3,830,400	603,364,608	0.25

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

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

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	300,000.00	33,903,000	34,083,000	0.01
	イギリスポンド	買建	1,000,000.00	157,512,000	157,510,000	0.06
	ノルウェークローネ	買建	300,000.00	3,926,850	3,924,000	0.00
	デンマーククローネ	買建	600,000.00	9,980,100	9,978,000	0.00

	ニュージーランドドル	買建	100,000.00	7,472,200	7,472,000	0.00
--	------------	----	------------	-----------	-----------	------

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

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

新興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	ブラジル	1,707,870,139	10.15
	ポーランド	1,704,796,676	10.13
	インドネシア	1,678,336,925	9.98
	メキシコ	1,647,553,785	9.79
	マレーシア	1,644,636,236	9.77
	トルコ	1,613,870,745	9.59
	タイ	1,569,089,734	9.33
	南アフリカ	1,453,376,410	8.64
	ハンガリー	952,245,591	5.66
	コロンビア	915,035,942	5.44
	ロシア	833,280,129	4.95
	ペルー	286,290,603	1.70
	フィリピン	61,131,838	0.36
	チリ	16,939,001	0.10
	小計	16,084,453,754	95.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	740,713,506	4.40
合計(純資産総額)		16,825,167,260	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(％)
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	14,500,000,000	3.47	504,373,581	3.31	480,593,655	7.750	2021/4/14	2.86
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	93,700,000	339.87	318,464,763	341.93	320,392,411	3.875	2019/6/13	1.90
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	34,000,000,000	0.83	284,814,140	0.85	289,667,589	8.375	2024/3/15	1.72

南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	35,800,000	791.09	283,211,839	753.26	269,667,432	10.500	2026/12/21	1.60
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	75,200,000	339.01	254,939,134	351.20	264,106,581	3.650	2021/12/17	1.57
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	8,950,000,000	2.83	253,971,269	2.67	239,835,566	4.375	2023/3/21	1.43
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/17	9,300,000	2,240.35	208,353,087	2,373.47	220,733,580	0.000	2017/7/1	1.31
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	9,250,000	2,320.57	214,653,325	2,345.56	216,964,760	10.000	2021/1/1	1.29
インドネシア	国債証券	INDOGB 9% 03/15/29	24,000,000,000	0.85	206,059,805	0.87	209,244,840	9.000	2029/3/15	1.24
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	5,330,000,000	3.95	210,772,486	3.65	194,606,721	9.850	2027/6/28	1.16
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/18	9,100,000	1,939.73	176,515,990	2,054.17	186,929,804	0.000	2018/7/1	1.11
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	23,250,000	792.75	184,315,707	792.22	184,191,786	10.000	2024/12/5	1.09
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/19	10,400,000	1,682.75	175,006,158	1,765.67	183,629,990	0.000	2019/7/1	1.09
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	5,700,000	3,078.17	175,456,065	3,103.72	176,912,176	4.000	2023/10/25	1.05
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	42,650,000	389.23	166,009,536	409.41	174,617,050	4.875	2029/6/22	1.04
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	8,150,000	2,091.17	170,430,588	2,113.27	172,231,554	10.000	2025/1/1	1.02
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/19	8,800,000	1,808.58	159,155,145	1,904.15	167,565,362	0.000	2019/1/1	1.00
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000	0.67	160,958,295	0.69	165,880,560	6.625	2033/5/15	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 12/13/18	23,600,000	687.08	162,152,662	679.89	160,456,134	8.500	2018/12/13	0.95
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	7,200,000	2,181.53	157,070,171	2,202.21	158,559,597	10.000	2023/1/1	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 5.25% 10/25/17	5,250,000	3,034.43	159,307,919	3,018.83	158,488,827	5.250	2017/10/25	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/18	5,400,000	2,891.06	156,117,412	2,907.42	157,000,766	2.500	2018/7/25	0.93
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	41,900,000	350.96	147,056,342	367.16	153,843,878	3.850	2025/12/12	0.91
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	47,100,000	326.71	153,884,484	325.62	153,368,179	3.250	2017/6/16	0.91
ポーランド	国債証券	POLGB 5.25% 10/25/20	4,650,000	3,228.61	150,130,564	3,247.14	150,992,121	5.250	2020/10/25	0.90
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/19	5,950,000	2,471.94	147,080,754	2,537.59	150,986,833	10.000	2019/1/1	0.90
トルコ	国債証券	TURKGB 9.4% 07/08/20	4,000,000	3,662.11	146,484,651	3,652.64	146,105,911	9.400	2020/7/8	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 4.75% 06/14/18	23,200,000	624.60	144,907,511	622.66	144,459,127	4.750	2018/6/14	0.86
ハンガリー	国債証券	HGB 6.5% 06/24/19	312,000,000	45.52	142,048,538	45.78	142,847,688	6.500	2019/6/24	0.85
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	40,000,000	340.31	136,127,532	354.25	141,701,436	3.625	2023/6/16	0.84

(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	95.60
合計	95.60

(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。

新興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	韓国	3,385,965,575	15.18
	台湾	2,828,326,381	12.68
	中国	2,425,069,878	10.87
	インド	1,807,812,877	8.11
	ケイマン	1,771,181,085	7.94
	南アフリカ	1,327,589,366	5.95
	ブラジル	1,162,655,296	5.21
	香港	1,028,730,935	4.61
	メキシコ	974,271,579	4.37
	ロシア	792,949,236	3.56
	マレーシア	773,520,702	3.47
	インドネシア	650,560,352	2.92
	タイ	531,778,432	2.38
	フィリピン	325,504,237	1.46
	トルコ	325,112,071	1.46
	ポーランド	320,042,170	1.44
	チリ	300,872,662	1.35
	バミューダ	223,308,308	1.00
	カタール	212,046,104	0.95
	アラブ首長国連邦	199,914,064	0.90
	コロンビア	112,015,888	0.50
	オランダ	95,611,255	0.43
	ハンガリー	71,104,283	0.32
	チェコ	59,642,992	0.27
	エジプト	38,576,651	0.17
	アメリカ	25,734,644	0.12
	マルタ共和国	22,129,952	0.10
	マン島	13,128,918	0.06
	ペルー	9,964,179	0.04

	小計	21,815,120,072	97.82
投資信託受益証券	ブラジル	45,832,909	0.21
投資証券	南アフリカ	68,965,828	0.31
	メキシコ	32,517,363	0.15
	トルコ	13,056,625	0.06
	小計	114,539,816	0.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	326,302,187	1.46
合計(純資産総額)		22,301,794,984	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	426,252,247	1.91

(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	—	343,335,836	1.54
	売建	—	205,469,722	△0.92

(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 （%）
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	1,471,389	484.08	712,277,162	508.08	747,598,037	3.35
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	6,650	122,003.60	811,323,987	107,355.20	713,912,080	3.20

ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	311,500	2,211.17	688,782,433	2,086.27	649,874,351	2.91
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	367,500	1,324.32	486,688,908	1,234.65	453,737,182	2.03
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	4,960,620	81.09	402,268,243	66.95	332,161,131	1.49
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	23,773	14,631.88	347,843,811	13,075.79	310,850,993	1.39
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,382,515	70.60	309,435,838	56.57	247,960,069	1.11
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	30,300	9,370.66	283,931,067	7,602.31	230,350,120	1.03
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	849,829	291.13	247,414,797	265.97	226,037,517	1.01
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	112,535	1,864.27	209,796,665	1,849.89	208,178,215	0.93
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,735,200	51.76	245,098,509	42.98	203,532,154	0.91
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	8,081	23,920.91	193,304,882	19,747.15	159,576,768	0.72
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	89,002	1,962.45	174,662,214	1,738.60	154,739,322	0.69
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	370,616	472.09	174,964,655	413.00	153,067,632	0.69
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	313,000	660.58	206,764,310	488.30	152,840,404	0.69
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,953,040	81.86	159,889,401	76.07	148,568,925	0.67
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	273,600	529.58	144,893,633	500.86	137,037,567	0.61
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,086,000	126.34	137,206,868	119.73	130,035,251	0.58
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	9,430	15,013.82	141,580,335	13,465.20	126,976,836	0.57
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	180,129	774.87	139,578,190	701.72	126,401,383	0.57
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	79,350	1,584.94	125,765,552	1,568.07	124,426,950	0.56
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	31,398	4,405.24	138,315,960	3,897.16	122,363,218	0.55
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	463,000	403.29	186,723,308	253.80	117,510,882	0.53
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	165,287	696.70	115,156,818	680.58	112,491,654	0.50
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,226	103,468.51	126,852,396	89,035.19	109,157,155	0.49
メキシコ	株式	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	食品・飲料・タバコ	101,440	1,009.44	102,397,979	1,059.45	107,470,872	0.48
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	34,130	3,142.50	107,253,715	3,052.70	104,188,897	0.47
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,599,400	77.44	123,865,934	64.76	103,587,700	0.46
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	28,073	4,064.01	114,089,119	3,647.32	102,391,355	0.46
韓国	株式	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	銀行	27,104	3,960.74	107,352,048	3,558.66	96,453,921	0.43

(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	7.32
		素材	6.46
		資本財	4.92
		商業・専門サービス	0.15
		運輸	1.57
		自動車・自動車部品	3.34
		耐久消費財・アパレル	1.57
		消費者サービス	0.76
		メディア	2.17
		小売	1.63
		食品・生活必需品小売り	1.77
		食品・飲料・タバコ	4.74
		家庭用品・パーソナル用品	1.58
		ヘルスケア機器・サービス	0.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.03
		銀行	17.17
		各種金融	3.11
		保険	3.68
		不動産	2.44
		ソフトウェア・サービス	8.00
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.29
		電気通信サービス	7.12
		公益事業	3.15
		半導体・半導体製造装置	5.15
小計			97.82
投資信託受益証券	—	—	0.21
投資証券	—	—	0.51
合計			98.54

(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	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	102	アメリカドル	3,742,669	425,242,052	3,751,560	426,252,247	1.91

(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。

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	258,630.73	29,229,694	29,383,036	0.13
	メキシコペソ	買建	7,400,000.00	46,024,300	45,954,000	0.21
	トルコリラ	買建	140,000.00	5,321,610	5,324,200	0.02
	ポーランドズロチ	買建	240,000.00	6,822,000	6,813,600	0.03
	香港ドル	買建	11,000,000.00	160,759,500	160,710,000	0.72
	マレーシアリングット	買建	1,500,000.00	40,393,500	40,395,000	0.18
	南アフリカランド	買建	7,800,000.00	54,810,600	54,756,000	0.25
	アメリカドル	売建	1,800,000.00	204,501,240	204,498,000	△0.92
	ブラジルリアル	売建	34,203.55	977,194	971,722	△0.00

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

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

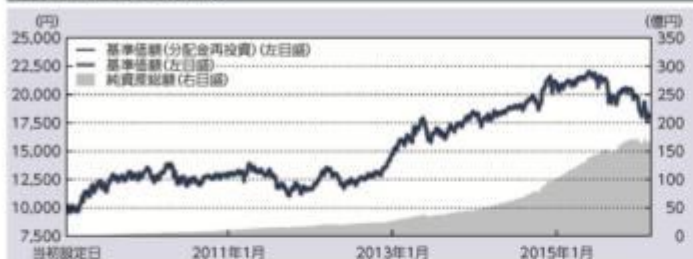
《参考情報》

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2009年1月16日
作成基準日：2016年2月29日

基準価額・純資産の推移



基準価額	18,170円
純資産総額	168.52億円

※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して計算しております。
※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（1万円当たり、税引前）

設定来分配金合計額：60円

決算期	2012年1月	2013年1月	2014年1月	2015年1月	2016年1月
分配金	0円	20円	20円	20円	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	28.8%	T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.2%
		T 0.875% 04/30/17	アメリカ	国債	-	0.875%	2017/04/30	0.2%
外国株式 インデックス マザーファンド	27.4%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
新興国債券 インデックス マザーファンド	16.3%	COLOM 7.75% 04/14/21	コロンビア	国債	-	7.750%	2021/04/14	0.5%
		THAIGB 3.875% 06/13/19	タイ	国債	-	3.875%	2019/06/13	0.3%
新興国株式 インデックス マザーファンド	16.2%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.5%
		SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	5.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	4.6%	第125回利付国債（5年）	日本	国債	-	0.1%	2020/09/20	0.1%
		第113回利付国債（5年）	日本	国債	-	0.3%	2018/06/20	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※収益率は分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。
※2009年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2016年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

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

<申込コース>

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（※）の2つの申込方法があ

ります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

<申込みの受付>

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

<申込単位>

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

<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>

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

<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休業日

ロンドンの銀行休業日

<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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖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、およ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ます。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。

<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0.1%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、6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。

<受付不可日>

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖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、およ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に基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

イ. マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ. マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

（ロ）外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

（ハ）公社債等

計算日（※）における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

＜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21年 1月16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1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は平成21年1月16日から平成22年1月20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）

①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

②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。

③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。

④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）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。

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②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。

③上記①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。

④上記①から③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①から③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。

- ①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④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。
- ⑤上記①から④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。
- ⑥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>

- ①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。
- ②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

<運用報告書>

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

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

- ①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。
- ②上記①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。
- ③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。
- ④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

- ①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。
- ②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。
- ③上記②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。
- ④上記②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。
- ⑤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

- ①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。
- ②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③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。

④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7期計算期間(平成27年 1月21日から平成28年 1月20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】

【世界経済インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 (平成27年 1月20日現在)	第7期 (平成28年 1月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	190,807,887	337,962,521
親投資信託受益証券	10,194,709,558	15,941,264,767
未収利息	286	509
流動資産合計	10,385,517,731	16,279,227,797
資産合計	10,385,517,731	16,279,227,797
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,077,691	-
未払解約金	7,801,209	19,031,787
未払受託者報酬	2,261,934	4,330,588
未払委託者報酬	20,357,346	38,975,221
その他未払費用	373,225	770,328
流動負債合計	40,871,405	63,107,924
負債合計	40,871,405	63,107,924
純資産の部		
元本等		
元本	5,038,845,504	8,873,094,446
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,305,800,822	7,343,025,427
（分配準備積立金）	1,340,456,792	1,403,825,005
元本等合計	10,344,646,326	16,216,119,873
純資産合計	10,344,646,326	16,216,119,873
負債純資産合計	10,385,517,731	16,279,227,797

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自 平成26年 1月21日 至 平成27年 1月20日	第7期 自 平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20日
営業収益		
受取利息	68,268	154,198
有価証券売買等損益	930,699,654	△1,987,844,791
営業収益合計	930,767,922	△1,987,690,593
営業費用		
受託者報酬	3,733,434	7,704,484
委託者報酬	33,600,738	69,340,175
その他費用	373,225	770,328
営業費用合計	37,707,397	77,814,987
営業利益又は営業損失（△）	893,060,525	△2,065,505,580
経常利益又は経常損失（△）	893,060,525	△2,065,505,580
当期純利益又は当期純損失（△）	893,060,525	△2,065,505,580
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（△）	103,161,677	△3,087,419
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,104,975,145	5,305,800,822
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,217,428,466	5,783,128,904
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,217,428,466	5,783,128,904
剰余金減少額又は欠損金増加額	796,423,946	1,683,486,138
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	796,423,946	1,683,486,138
分配金	10,077,691	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,305,800,822	7,343,025,427

（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6期 (平成27年 1月20日現在)	第7期 (平成28年 1月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,038,845,504口	8,873,094,446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 2.0530円 (1万口当たり純資産額) (20,530円)	1口当たり純資産額 1.8276円 (1万口当たり純資産額) (18,276円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期 自 平成26年 1月21日 至 平成27年 1月20日	第7期 自 平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20日																																																												
分配金の計算過程	分配金の計算過程																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>206,559,836円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>583,339,012円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>3,965,344,030円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>560,635,635円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>5,315,878,513円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>5,038,845,504口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>10,549円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>20円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>10,077,691円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	206,559,836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	583,339,012円	収益調整金額	C	3,965,344,030円	分配準備積立金額	D	560,635,635円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,315,878,513円	当ファンドの期末残存口数	F	5,038,845,504口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,549円	1万口当たり分配金額	H	20円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	10,077,691円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>341,878,487円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>5,939,200,422円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,061,946,518円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>7,343,025,427円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>8,873,094,446口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>8,275円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>－円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	341,878,487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	5,939,200,422円	分配準備積立金額	D	1,061,946,518円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,343,025,427円	当ファンドの期末残存口数	F	8,873,094,446口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,275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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	206,559,836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	583,339,012円																																																											
収益調整金額	C	3,965,344,030円																																																											
分配準備積立金額	D	560,635,635円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,315,878,513円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	5,038,845,504口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,549円																																																											
1万口当たり分配金額	H	20円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	10,077,691円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	341,878,487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	5,939,200,422円																																																											
分配準備積立金額	D	1,061,946,518円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,343,025,427円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	8,873,094,446口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,275円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円																																																											

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第7期 (平成28年 1月20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6期 自 平成26年 1月21日 至 平成27年 1月20日	第7期 自 平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,579,115,686円	5,038,845,504円
期中追加設定元本額	3,411,351,368円	5,409,151,344円
期中一部解約元本額	951,621,550円	1,574,902,402円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第6期 (平成27年 1月20日現在)	第7期 (平成28年 1月20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	921,663,620	△1,983,154,442
合計	921,663,620	△1,983,154,442

（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	新興国株式インデックス マザーファンド	1,344,021,169	2,542,753,649	
	国内株式インデックス マザーファンド	748,156,369	853,347,154	
	外国株式インデックス マザーファンド	2,470,275,024	4,421,298,237	
	国内債券インデックス マザーファンド	533,252,566	719,411,036	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,759,161,993	4,795,123,760	
	新興国債券インデックス マザーファンド	1,837,945,292	2,609,330,931	
合計		8,692,812,413	15,941,264,767	

(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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,577,521,080
国債証券	267,986,585,750
地方債証券	19,567,271,368
特殊債券	26,533,249,766
社債券	16,444,253,050
派生商品評価勘定	38,704
未収入金	2,193,214,708
未収利息	780,188,761
前払費用	15,980,038
差入委託証拠金	100,000
流動資産合計	335,098,403,225
資産合計	335,098,403,225
負債の部	
流動負債	
前受金	40,000
未払金	100,506,480
未払解約金	2,631,318,149
流動負債合計	2,731,864,629
負債合計	2,731,864,629
純資産の部	

	平成28年 1月20日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	246,359,831,966
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	86,006,706,630
元本等合計	332,366,538,596
純資産合計	332,366,538,596
負債純資産合計	335,098,403,225

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 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。 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	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 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	246,359,831,966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 105,813,000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 1.3491円 (1万口当たり純資産額) (13,491円)

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成28年 1月20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 1月20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 1月20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。 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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年 1月21日
期首元本額	229,010,770,480円
期中追加設定元本額	53,574,861,794円
期中一部解約元本額	36,225,800,308円
期末元本額	246,359,831,966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）	2,666,918,004円
S B I 資産設計オープン（分配型）	24,242,386円
SMT 国内債券インデックス・オープン	7,765,008,036円
世界経済インデックスファンド	533,252,566円
マイセレクション25	72,134,685円
マイセレクション50	76,322,340円
マイセレクション75	24,265,615円
DCマイセレクション25	14,203,398,090円
DCマイセレクション50	16,212,929,905円

区分	平成28年 1月20日現在
DCマイセレクション75	4,880,520,385円
DC日本債券インデックス・オープン	411,147,638円
DC日本債券インデックス・オープンS	59,994,150,976円
DC日本債券インデックス・オープンP	24,947,699,210円
DCマイセレクションS25	5,625,663,307円
DCマイセレクションS50	6,182,461,607円
DCマイセレクションS75	1,280,325,636円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,302,332,142円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	722,507,875円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	191,496,810円
DC世界経済インデックスファンド	524,642,387円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,332,527,807円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	19,374,990円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	161,958,481円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	24,076,590円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	975,740円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	616,736,632円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	855,094,625円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	351,581,319円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	296,743,741円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	8,349,215,961円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,542,662,485円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,494,698,026円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,292,297,254円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,051,283,382円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,103,223,410円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,702,437,647円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,177,982,210円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,034,403,414円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	217,581,023円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,328,513,550円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,262,821,088円
コア投資戦略ファンド（安定型）	7,820,445,724円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,688,717,396円
分散投資コア戦略ファンドA	1,332,740,617円
分散投資コア戦略ファンドS	867,838,011円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	15,782,581円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	227,817,105円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	32,764,214,120円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,474,830,688円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	49,372,067円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,338,806円
SMT インデックスバランス・オープン	63,362,975円

区分	平成28年 1月20日現在
債券コア戦略ファンド	192,248円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,163,343,413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 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,298,494,050
地方債証券	119,147,706
特殊債券	91,322,103
社債券	18,522,150
合計	4,527,486,009

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成28年 1月20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	598,321,296	—	598,360,000	38,704
合計		598,321,296	—	598,360,000	38,704

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
----	-----	---------	--------	----

国債証券	第 3 4 9 回利付国債（2 年）	730,000,000	730,927,100	
	第 3 5 0 回利付国債（2 年）	1,030,000,000	1,031,411,100	
	第 3 5 1 回利付国債（2 年）	130,000,000	130,191,100	
	第 3 5 3 回利付国債（2 年）	1,600,000,000	1,602,672,000	
	第 3 5 4 回利付国債（2 年）	550,000,000	550,973,500	
	第 3 5 5 回利付国債（2 年）	3,940,000,000	3,947,052,600	
	第 3 5 6 回利付国債（2 年）	1,090,000,000	1,092,060,100	
	第 3 5 7 回利付国債（2 年）	740,000,000	741,531,800	
	第 1 0 3 回利付国債（5 年）	2,500,000,000	2,509,375,000	
	第 1 0 4 回利付国債（5 年）	810,000,000	812,106,000	
	第 1 0 5 回利付国債（5 年）	3,500,000,000	3,510,815,000	
	第 1 0 6 回利付国債（5 年）	3,260,000,000	3,271,638,200	
	第 1 0 7 回利付国債（5 年）	1,120,000,000	1,124,491,200	
	第 1 0 8 回利付国債（5 年）	590,000,000	591,239,000	
	第 1 0 9 回利付国債（5 年）	1,190,000,000	1,192,820,300	
	第 1 1 0 回利付国債（5 年）	700,000,000	704,676,000	
	第 1 1 1 回利付国債（5 年）	1,590,000,000	1,604,055,600	
	第 1 1 2 回利付国債（5 年）	900,000,000	908,883,000	
	第 1 1 3 回利付国債（5 年）	4,390,000,000	4,422,749,400	
	第 1 1 4 回利付国債（5 年）	1,210,000,000	1,219,970,400	
	第 1 1 5 回利付国債（5 年）	2,850,000,000	2,865,903,000	
	第 1 1 6 回利付国債（5 年）	4,250,000,000	4,275,330,000	
	第 1 1 7 回利付国債（5 年）	4,520,000,000	4,549,244,400	
	第 1 1 8 回利付国債（5 年）	4,350,000,000	4,379,623,500	
	第 1 1 9 回利付国債（5 年）	1,000,000,000	1,003,400,000	
	第 1 2 0 回利付国債（5 年）	4,240,000,000	4,270,231,200	
	第 1 2 1 回利付国債（5 年）	630,000,000	632,186,100	
	第 1 2 2 回利付国債（5 年）	4,660,000,000	4,677,288,600	
	第 1 2 3 回利付国債（5 年）	4,540,000,000	4,557,887,600	
	第 1 2 4 回利付国債（5 年）	3,210,000,000	3,223,417,800	
	第 1 2 5 回利付国債（5 年）	5,130,000,000	5,151,494,700	
	第 1 2 6 回利付国債（5 年）	880,000,000	883,669,600	
	第 1 回利付国債（4 0 年）	150,000,000	195,160,500	
	第 2 回利付国債（4 0 年）	300,000,000	375,159,000	
	第 3 回利付国債（4 0 年）	420,000,000	526,209,600	
	第 4 回利付国債（4 0 年）	530,000,000	665,150,000	
	第 5 回利付国債（4 0 年）	490,000,000	587,363,000	
	第 6 回利付国債（4 0 年）	690,000,000	806,858,400	
	第 7 回利付国債（4 0 年）	1,090,000,000	1,208,908,100	
	第 8 回利付国債（4 0 年）	840,000,000	852,936,000	
	第 2 8 5 回利付国債（1 0 年）	1,990,000,000	2,029,680,600	
	第 2 8 6 回利付国債（1 0 年）	870,000,000	892,298,100	

第287回利付国債（10年）	540,000,000	554,601,600	
第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,149,523,200	
第289回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,561,811,600	
第290回利付国債（10年）	470,000,000	484,339,700	
第291回利付国債（10年）	840,000,000	863,822,400	
第292回利付国債（10年）	1,110,000,000	1,151,058,900	
第293回利付国債（10年）	370,000,000	386,128,300	
第294回利付国債（10年）	180,000,000	187,414,200	
第295回利付国債（10年）	100,000,000	103,637,000	
第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,184,084,000	
第297回利付国債（10年）	560,000,000	582,892,800	
第298回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,723,030,200	
第299回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,363,749,300	
第300回利付国債（10年）	830,000,000	869,292,200	
第301回利付国債（10年）	640,000,000	672,716,800	
第302回利付国債（10年）	200,000,000	209,542,000	
第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,460,959,500	
第304回利付国債（10年）	480,000,000	502,747,200	
第305回利付国債（10年）	2,160,000,000	2,268,885,600	
第306回利付国債（10年）	1,370,000,000	1,449,103,800	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	737,513,000	
第308回利付国債（10年）	990,000,000	1,046,271,600	
第309回利付国債（10年）	1,780,000,000	1,865,475,600	
第310回利付国債（10年）	1,590,000,000	1,662,933,300	
第311回利付国債（10年）	610,000,000	632,295,500	
第312回利付国債（10年）	1,670,000,000	1,767,077,100	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,650,000,000	1,759,230,000	
第314回利付国債（10年）	910,000,000	960,869,000	
第315回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,436,440,500	
第316回利付国債（10年）	720,000,000	762,213,600	
第317回利付国債（10年）	620,000,000	658,229,200	
第318回利付国債（10年）	1,010,000,000	1,066,560,000	
第319回利付国債（10年）	750,000,000	798,277,500	
第320回利付国債（10年）	720,000,000	762,098,400	
第321回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,739,351,200	
第322回利付国債（10年）	950,000,000	1,001,708,500	
第323回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,278,546,500	
第324回利付国債（10年）	2,020,000,000	2,121,505,000	
第325回利付国債（10年）	3,210,000,000	3,376,534,800	
第326回利付国債（10年）	720,000,000	753,516,000	
第327回利付国債（10年）	1,580,000,000	1,664,451,000	
第328回利付国債（10年）	2,020,000,000	2,102,961,400	

第329回利付国債（10年）	2,300,000,000	2,429,099,000	
第330回利付国債（10年）	1,990,000,000	2,102,275,800	
第331回利付国債（10年）	680,000,000	708,267,600	
第332回利付国債（10年）	2,600,000,000	2,707,328,000	
第333回利付国債（10年）	2,060,000,000	2,145,057,400	
第334回利付国債（10年）	2,600,000,000	2,707,250,000	
第335回利付国債（10年）	3,040,000,000	3,139,012,800	
第336回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,352,090,300	
第337回利付国債（10年）	1,550,000,000	1,572,506,000	
第338回利付国債（10年）	3,480,000,000	3,556,942,800	
第339回利付国債（10年）	3,480,000,000	3,554,089,200	
第340回利付国債（10年）	3,400,000,000	3,467,728,000	
第341回利付国債（10年）	500,000,000	504,365,000	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	52,434,400	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	201,710,400	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	149,770,800	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	147,051,300	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	61,965,500	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	241,176,500	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	225,997,200	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	58,858,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	267,014,400	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	169,932,800	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	104,288,400	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	232,354,800	
第13回利付国債（30年）	290,000,000	349,441,300	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	381,540,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	438,011,800	
第16回利付国債（30年）	370,000,000	476,378,700	
第17回利付国債（30年）	330,000,000	419,476,200	
第18回利付国債（30年）	445,000,000	557,260,150	
第19回利付国債（30年）	280,000,000	350,263,200	
第20回利付国債（30年）	420,000,000	540,376,200	
第21回利付国債（30年）	270,000,000	337,238,100	
第22回利付国債（30年）	400,000,000	514,012,000	
第23回利付国債（30年）	390,000,000	501,040,800	
第24回利付国債（30年）	470,000,000	604,161,500	
第25回利付国債（30年）	350,000,000	436,996,000	
第26回利付国債（30年）	730,000,000	925,428,300	
第27回利付国債（30年）	730,000,000	941,714,600	
第28回利付国債（30年）	530,000,000	684,118,700	
第29回利付国債（30年）	940,000,000	1,197,494,200	
第30回利付国債（30年）	660,000,000	828,326,400	

第 3 1 回利付国債（3 0 年）	770,000,000	951,335,000	
第 3 2 回利付国債（3 0 年）	990,000,000	1,246,459,500	
第 3 3 回利付国債（3 0 年）	1,180,000,000	1,410,631,000	
第 3 4 回利付国債（3 0 年）	1,550,000,000	1,919,985,000	
第 3 5 回利付国債（3 0 年）	1,180,000,000	1,409,439,200	
第 3 6 回利付国債（3 0 年）	1,240,000,000	1,481,725,600	
第 3 7 回利付国債（3 0 年）	1,260,000,000	1,476,921,600	
第 3 8 回利付国債（3 0 年）	790,000,000	906,572,400	
第 3 9 回利付国債（3 0 年）	740,000,000	866,488,200	
第 4 0 回利付国債（3 0 年）	530,000,000	608,031,900	
第 4 1 回利付国債（3 0 年）	580,000,000	650,835,400	
第 4 2 回利付国債（3 0 年）	710,000,000	797,294,500	
第 4 3 回利付国債（3 0 年）	720,000,000	808,250,400	
第 4 4 回利付国債（3 0 年）	720,000,000	807,969,600	
第 4 5 回利付国債（3 0 年）	680,000,000	729,259,200	
第 4 6 回利付国債（3 0 年）	750,000,000	803,805,000	
第 4 7 回利付国債（3 0 年）	820,000,000	898,129,600	
第 4 8 回利付国債（3 0 年）	1,450,000,000	1,516,743,500	
第 4 9 回利付国債（3 0 年）	130,000,000	135,872,100	
第 3 4 回利付国債（2 0 年）	50,000,000	52,035,000	
第 3 5 回利付国債（2 0 年）	10,000,000	10,383,900	
第 3 6 回利付国債（2 0 年）	70,000,000	73,504,200	
第 3 7 回利付国債（2 0 年）	70,000,000	73,621,100	
第 3 8 回利付国債（2 0 年）	20,000,000	21,168,800	
第 3 9 回利付国債（2 0 年）	500,000,000	528,140,000	
第 4 0 回利付国債（2 0 年）	100,000,000	106,118,000	
第 4 1 回利付国債（2 0 年）	330,000,000	345,731,100	
第 4 2 回利付国債（2 0 年）	80,000,000	86,592,000	
第 4 3 回利付国債（2 0 年）	140,000,000	154,859,600	
第 4 4 回利付国債（2 0 年）	170,000,000	187,663,000	
第 4 5 回利付国債（2 0 年）	290,000,000	318,924,600	
第 4 6 回利付国債（2 0 年）	170,000,000	186,423,700	
第 4 7 回利付国債（2 0 年）	90,000,000	99,186,300	
第 4 8 回利付国債（2 0 年）	130,000,000	145,892,500	
第 4 9 回利付国債（2 0 年）	140,000,000	155,134,000	
第 5 0 回利付国債（2 0 年）	220,000,000	241,511,600	
第 5 1 回利付国債（2 0 年）	100,000,000	110,761,000	
第 5 2 回利付国債（2 0 年）	110,000,000	122,976,700	
第 5 3 回利付国債（2 0 年）	80,000,000	89,848,000	
第 5 4 回利付国債（2 0 年）	200,000,000	225,802,000	
第 5 5 回利付国債（2 0 年）	140,000,000	157,099,600	
第 5 6 回利付国債（2 0 年）	150,000,000	169,062,000	

第57回利付国債（20年）	240,000,000	268,960,800	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	337,512,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	223,106,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	383,194,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	256,713,600	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	337,836,800	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	225,998,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	365,033,600	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	251,666,800	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	374,906,400	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	149,111,300	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	222,548,900	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	453,651,900	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	476,908,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	235,118,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	737,547,300	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	419,475,600	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	234,804,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	152,895,600	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	312,676,200	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	338,456,100	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	197,142,200	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	315,605,700	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	259,197,400	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	456,959,100	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	709,044,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	343,371,600	
第84回利付国債（20年）	670,000,000	786,801,100	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	344,502,600	
第86回利付国債（20年）	210,000,000	253,644,300	
第87回利付国債（20年）	550,000,000	658,834,000	
第88回利付国債（20年）	550,000,000	666,402,000	
第89回利付国債（20年）	450,000,000	540,657,000	
第90回利付国債（20年）	630,000,000	758,740,500	
第91回利付国債（20年）	450,000,000	546,637,500	
第92回利付国債（20年）	1,080,000,000	1,292,176,800	
第93回利付国債（20年）	410,000,000	487,080,000	
第94回利付国債（20年）	610,000,000	731,286,300	
第95回利付国債（20年）	710,000,000	869,025,800	
第96回利付国債（20年）	420,000,000	504,504,000	
第97回利付国債（20年）	640,000,000	777,433,600	
第98回利付国債（20年）	580,000,000	697,618,200	
第99回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,204,890,000	

第100回利付国債（20年）	600,000,000	731,556,000	
第101回利付国債（20年）	385,000,000	478,701,300	
第102回利付国債（20年）	580,000,000	722,680,000	
第103回利付国債（20年）	360,000,000	444,272,400	
第104回利付国債（20年）	300,000,000	362,862,000	
第105回利付国債（20年）	620,000,000	751,074,200	
第106回利付国債（20年）	430,000,000	526,117,900	
第107回利付国債（20年）	250,000,000	303,287,500	
第108回利付国債（20年）	480,000,000	570,134,400	
第109回利付国債（20年）	340,000,000	404,246,400	
第110回利付国債（20年）	850,000,000	1,032,537,500	
第111回利付国債（20年）	330,000,000	405,589,800	
第112回利付国債（20年）	800,000,000	973,064,000	
第113回利付国債（20年）	1,210,000,000	1,473,562,200	
第114回利付国債（20年）	810,000,000	987,535,800	
第115回利付国債（20年）	720,000,000	887,256,000	
第116回利付国債（20年）	550,000,000	678,540,500	
第117回利付国債（20年）	820,000,000	1,000,728,000	
第118回利付国債（20年）	850,000,000	1,026,179,500	
第119回利付国債（20年）	380,000,000	448,198,600	
第120回利付国債（20年）	330,000,000	380,061,000	
第121回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,301,100,300	
第122回利付国債（20年）	280,000,000	330,394,400	
第123回利付国債（20年）	1,260,000,000	1,540,791,000	
第124回利付国債（20年）	340,000,000	411,046,400	
第125回利付国債（20年）	630,000,000	780,336,900	
第126回利付国債（20年）	430,000,000	520,136,600	
第127回利付国債（20年）	460,000,000	549,566,600	
第128回利付国債（20年）	770,000,000	920,265,500	
第129回利付国債（20年）	420,000,000	495,629,400	
第130回利付国債（20年）	630,000,000	743,538,600	
第131回利付国債（20年）	380,000,000	442,688,600	
第132回利付国債（20年）	530,000,000	616,909,400	
第133回利付国債（20年）	880,000,000	1,037,880,800	
第134回利付国債（20年）	420,000,000	494,957,400	
第135回利付国債（20年）	380,000,000	442,213,600	
第136回利付国債（20年）	610,000,000	700,353,200	
第137回利付国債（20年）	290,000,000	337,145,300	
第138回利付国債（20年）	630,000,000	712,561,500	
第139回利付国債（20年）	410,000,000	470,188,000	
第140回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,579,408,800	
第141回利付国債（20年）	360,000,000	417,906,000	

	第142回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,318,228,800	
	第143回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,201,179,000	
	第144回利付国債（20年）	590,000,000	665,348,900	
	第145回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,714,964,800	
	第146回利付国債（20年）	1,710,000,000	1,978,760,700	
	第147回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,673,874,300	
	第148回利付国債（20年）	1,530,000,000	1,713,370,500	
	第149回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,687,711,900	
	第150回利付国債（20年）	1,570,000,000	1,724,346,700	
	第151回利付国債（20年）	1,430,000,000	1,517,716,200	
	第152回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,503,112,600	
	第153回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,631,233,600	
	第154回利付国債（20年）	1,770,000,000	1,863,367,500	
	第155回利付国債（20年）	470,000,000	476,326,200	
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,563,000	
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,134,000	
	国債証券合計	248,070,000,000	267,986,585,750	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,534,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	115,511,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	122,088,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	118,507,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,510,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,266,000	
	第23回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,640,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	229,608,000	
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	227,236,000	
	第695回東京都公募公債	200,000,000	211,508,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	105,977,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	105,322,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	211,364,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	104,493,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	103,620,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	105,394,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	103,788,000	
	平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	113,165,800	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,911,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	105,800,000	
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	210,434,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,232,000	
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	126,650,000	
	第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	120,186,000	
	第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	114,306,000	

第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,532,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	103,052,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	210,496,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,886,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	231,398,000	
第91回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	100,021,000	
第307回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,973,000	
第311回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,192,000	
第322回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,388,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,250,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,231,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,608,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,573,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,443,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,792,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	105,031,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	115,698,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,844,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	106,708,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,833,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,886,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	102,940,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,542,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,353,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	102,696,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	102,654,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	104,088,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	105,490,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	109,289,083	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	105,328,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,927,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,644,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	122,071,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	211,168,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,708,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,915,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,308,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,659,000	

平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,405,000	
平成19年度第2回広島県公募公債	200,000,000	205,894,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	122,215,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,583,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,655,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,082,000	
平成20年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,263,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,796,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	204,551,050	
平成23年度第11回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	100,307,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,912,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	105,027,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,328,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,024,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,026,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	211,682,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	116,936,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	114,054,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	125,000,000	127,830,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	105,577,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,208,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	105,180,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,122,000	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,732,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	163,299,312	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,001,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,875,000	
第67回共同発行市場公募地方債	265,700,000	276,022,445	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	115,720,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,786,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,757,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,315,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,832,038	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,737,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,588,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,634,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	264,830,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	379,620,600	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,683,000	

第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,828,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,520,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,844,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,912,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,718,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,118,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,474,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,030,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,986,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,832,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,169,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,101,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,922,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,527,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,942,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,638,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,316,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	209,124,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,379,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	238,760,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	102,826,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	105,099,000	
平成26年度第1回大阪市公募公債（3年）	200,000,000	200,060,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	124,390,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	119,194,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	108,080,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	104,315,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	106,643,040	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	105,503,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,385,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,877,000	
平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,049,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,117,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,967,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	210,030,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,671,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,470,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,627,000	
平成25年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	100,567,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,260,000	

	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	116,477,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	104,717,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,282,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,356,000	
	平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	103,141,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	204,520,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,860,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,119,500	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	211,158,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	121,615,000	
	地方債証券合計	18,343,690,000	19,567,271,368	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,194,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,881,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	115,191,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,080,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,778,000	
	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	218,432,000	
	第14回道路債券	100,000,000	111,777,000	
	第17回道路債券	100,000,000	109,251,000	
	第21回道路債券	100,000,000	128,717,000	
	第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,772,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	303,000,000	309,487,230	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,237,000	
	第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	322,982,100	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,610,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,872,000	
	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,817,000	
	第42回道路債券	100,000,000	116,757,000	
	第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,865,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,283,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,818,000	
	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	102,685,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,364,000	

第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,944,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,522,000	
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	30,841,500	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	114,231,210	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,137,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	188,285,250	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,097,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,161,000	
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	125,039,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,012,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,717,000	
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	314,388,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,526,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,804,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	145,138,740	
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	121,381,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,282,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,083,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,709,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,310,000	
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	207,638,000	
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	210,704,000	
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	120,887,000	
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	105,446,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,239,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,447,000	
	300,000,000	315,402,000	

第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,210,000	
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	315,291,480	
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	209,988,000	
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	105,020,000	
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	104,535,000	
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	312,789,000	
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	113,846,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,994,000	
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	314,664,000	
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	207,768,000	
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	205,918,000	
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	310,272,000	
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	211,004,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,709,000	
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	220,044,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,682,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,274,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,702,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,021,000	
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	301,986,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	210,243,620	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,723,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,435,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,469,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,711,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	333,231,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	116,449,300	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	107,155,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,466,000	

第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	127,457,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	120,555,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,346,000	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,251,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,338,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,262,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,668,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,828,910	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,310,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,141,810	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,255,940	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,600,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	113,113,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,738,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,265,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,204,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,900,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,988,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,442,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,162,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,638,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,754,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,842,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,977,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	216,485,920	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	125,073,180	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	104,937,430	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	82,252,800	
第11回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	300,858,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	105,396,530	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,054,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,300,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	116,300,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,898,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,257,600	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,596,000	30,711,818	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,913,000	25,740,670	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,501,000	26,604,655	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,171,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,527,000	31,962,091	
	26,273,000	28,264,756	

第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券			
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,028,000	22,254,773	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,993,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,008,000	47,540,962	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,899,000	27,683,959	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,009,000	24,809,454	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,356,000	29,225,782	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	22,752,000	24,555,551	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,637,000	29,349,941	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,535,000	35,027,307	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,830,000	35,270,143	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,458,000	42,954,767	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,545,000	44,297,845	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,155,000	44,845,368	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,912,000	50,500,298	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,539,000	53,253,929	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,086,000	54,713,616	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,519,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,718,000	115,114,995	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,106,000	29,941,321	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,588,000	63,490,418	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,084,000	29,874,074	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,295,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,310,000	30,791,371	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,705,000	74,561,347	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,990,000	28,209,546	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,068,000	75,180,161	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,044,000	73,108,514	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,980,000	31,522,705	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,386,000	143,798,886	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,383,000	76,839,621	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,950,000	31,243,129	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,813,000	83,957,689	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,549,000	82,666,538	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,175,000	83,416,404	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,143,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,494,000	168,151,168	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,776,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,913,000	

第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,126,000	172,818,311	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,132,000	87,843,454	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,407,000	89,074,376	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,011,000	89,827,308	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,184,000	87,852,738	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,444,000	87,193,496	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,915,000	91,034,771	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	177,373,500	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,327,000	90,102,252	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,217,000	93,761,042	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,342,000	94,956,202	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,294,000	95,517,196	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,419,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,176,000	193,513,805	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,481,000	96,152,368	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,664,000	193,051,647	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,634,000	97,791,675	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,953,000	97,689,842	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,256,000	98,636,062	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,524,000	199,809,881	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,460,000	99,756,718	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,817,000	
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,444,000	
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,218,000	
第 1 4 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,934,000	
第 1 2 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	119,429,000	
第 1 1 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,491,000	
い第 7 4 1 号商工債	100,000,000	100,305,000	
い第 7 5 0 号商工債	100,000,000	100,231,000	
い第 7 5 2 号商工債	200,000,000	200,464,000	
い第 7 5 6 号商工債	100,000,000	100,285,000	
い第 7 4 3 号農林債	100,000,000	100,311,000	
い第 7 4 6 号農林債	100,000,000	100,214,000	
い第 7 4 8 号農林債	100,000,000	100,237,000	
い第 7 4 9 号農林債	300,000,000	300,492,000	
い第 7 5 2 号農林債	200,000,000	200,342,000	
い第 7 8 0 号農林債	100,000,000	100,252,000	
第 2 6 7 回信金中金債（５年）	200,000,000	200,610,000	
第 2 7 4 回信金中金債（５年）	100,000,000	100,204,000	
第 2 9 0 回信金中金債（５年）	100,000,000	100,337,000	
第 2 9 9 回信金中金債（５年）	100,000,000	100,037,000	

	第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,399,000	
	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,244,000	
	第175号商工債（3年）	100,000,000	99,957,000	
	第178号商工債（3年）	300,000,000	299,865,000	
	第179号商工債（3年）	200,000,000	199,886,000	
	第19回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,383,000	
	第20回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,305,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,361,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	209,770,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,578,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券	200,000,000	208,754,000	
	特殊債券合計	25,136,449,000	26,533,249,766	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラ グ・プブリクト円貨社債	100,000,000	101,431,000	
	第6回ノルデアバンク・アクツィエボラ グ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,147,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	100,156,000	
	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	100,288,000	
	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	100,101,000	
	第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	200,296,000	
	第9回JPモルガン・チェース・アンド・カ ンパニー円貨社債	100,000,000	101,161,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,683,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,410,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	100,814,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円 貨社債	100,000,000	100,333,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポ レーション円貨社債	100,000,000	101,191,000	
	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	100,041,000	
	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	100,574,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,512,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,590,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,127,000	
	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	100,414,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	103,362,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	105,443,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,656,000	

第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,803,000	
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	101,722,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	104,397,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,528,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,023,000	
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	102,848,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,309,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,395,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,793,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,367,000	
第5回東海ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,230,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,288,000	
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,119,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,659,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,525,000	
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	100,602,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,323,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,402,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,966,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,304,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,138,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,349,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,901,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,590,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,026,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,528,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,897,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,362,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,364,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,319,000	
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	100,394,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,946,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,615,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,854,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,944,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	114,672,000	

第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,321,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,211,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,671,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,768,000	
第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,380,000	
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,264,000	
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	200,328,000	
第33回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	200,970,000	
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	126,670,000	
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	104,740,000	
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	106,880,000	
第134回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,294,000	
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	100,617,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,026,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,465,000	
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	100,928,000	
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	106,765,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,136,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,450,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	207,020,000	
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,504,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,976,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,324,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,803,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,490,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,681,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,272,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,422,000	
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	100,400,000	
	100,000,000	101,349,000	

第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債			
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	103,811,000	
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	100,571,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,650,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,126,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,335,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,979,000	
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	104,953,000	
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	105,102,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,967,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,786,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,330,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,862,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,654,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,920,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,546,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	242,514,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	201,854,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,391,150	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	121,314,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,468,200	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,328,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,728,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,256,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,296,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	206,262,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,625,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	103,316,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	124,614,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,593,300	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,644,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,995,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,033,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,107,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,170,000	

第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,958,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,684,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,385,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,290,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,511,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,261,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,069,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,577,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,539,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,499,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,860,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,399,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	20,729,400	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,140,000	
第471回東北電力株式会社社債	226,000,000	237,602,840	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,286,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,666,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,759,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,496,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,562,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,142,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,212,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,741,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	32,409,880	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,139,280	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,706,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,577,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,603,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	104,502,000	
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	100,490,000	
社債券合計	15,947,000,000	16,444,253,050	
合計		330,531,359,934	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,831,378,350
株式	131,910,970,400
未収配当金	182,988,145
未収利息	4,269
前払金	126,147,000
差入委託証拠金	90,450,000
流動資産合計	135,141,938,164
資産合計	135,141,938,164
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	126,203,700
未払金	1,457,518,810
未払解約金	68,832,498
流動負債合計	1,652,555,008
負債合計	1,652,555,008
純資産の部	
元本等	
元本	117,031,123,296
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	16,458,259,860
元本等合計	133,489,383,156
純資産合計	133,489,383,156
負債純資産合計	135,141,938,164

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 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

	平成28年 1月20日現在
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 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,031,123,296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 1.1406円 (1万口当たり純資産額) (11,406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 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月20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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	平成28年 1月20日現在
期首	平成27年 1月21日
期首元本額	125,624,543,166円
期中追加設定元本額	22,617,930,204円
期中一部解約元本額	31,211,350,074円
期末元本額	117,031,123,296円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,079,292,988円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,443,006,921円
SBI資産設計オープン（分配型）	30,413,119円
SMT TOPIXインデックス・オープン	7,957,559,282円
世界経済インデックスファンド	748,156,369円
マイセクション25	27,450,311円
マイセクション50	73,126,095円
マイセクション75	72,321,553円
日本株式インデックス・オープン	14,860,368,868円
DCマイセクション25	4,932,509,754円
DCマイセクション50	16,195,854,678円
DCマイセクション75	14,661,769,471円
DC日本株式インデックス・オープン	4,616,120,363円
DCマイセクションS25	2,114,896,361円
DCマイセクションS50	6,175,923,807円
DCマイセクションS75	3,869,100,976円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,207,731,480円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	460,917,092円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	511,190,860円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	270,883,433円
DC世界経済インデックスファンド	743,143,626円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	350,335,390円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	65,565,114円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	150,243,286円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	79,904,907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）	896,735,133円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,951,623円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	316,626,364円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,079,769,850円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	374,041,690円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,082,804,106円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,691,933,276円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,219,480,485円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	6,872,972,980円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,100,163,917円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	952,493,313円

区分	平成28年 1月20日現在
バランスD（３５）VA１（適格機関投資家専用）	1,383,037,921円
グローバルバランスファンドVA３５（適格機関投資家専用）	2,667,808,739円
バランスE（２５）VA１（適格機関投資家専用）	749,328,987円
バランスF（２５）VA１（適格機関投資家専用）	1,071,746,782円
国内バランス２５VA１（適格機関投資家専用）	86,322,448円
F O F s用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,877,647,184円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,841,438,427円
日本株式ファンド・シリーズ２	679,414,006円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	54,022,422円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	81,320,139円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	173,587,399円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,832,250円
SMT インデックスバランス・オープン	65,857,751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 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△30,751,361,774
合計	△30,751,361,774

(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 1月20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	1,727,603,700	—	1,601,400,000	△126,203,700
合計		1,727,603,700	—	1,601,400,000	△126,203,700

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

※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	32,000	255.00	8,160,000	
日本水産	86,100	606.00	52,176,600	
マルハニチロ	15,300	1,918.00	29,345,400	
サカタのタネ	12,000	2,465.00	29,580,000	
ホクト	7,600	2,094.00	15,914,400	
住石ホールディングス	21,900	96.00	2,102,400	
日鉄鉱業	21,000	448.00	9,408,000	
三井松島産業	49,000	122.00	5,978,000	
国際石油開発帝石	393,500	935.20	368,001,200	
日本海洋掘削	2,200	2,119.00	4,661,800	
石油資源開発	11,800	2,670.00	31,506,000	
K & O エナジーグループ	5,000	1,380.00	6,900,000	
ショーボンドホールディングス	7,200	3,950.00	28,440,000	
ミライト・ホールディングス	23,000	833.00	19,159,000	
タマホーム	5,600	397.00	2,223,200	
サンヨーホームズ	1,600	418.00	668,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,197.00	2,034,900	
安藤・間	49,900	535.00	26,696,500	
東急建設	24,300	744.00	18,079,200	
コムシスホールディングス	32,400	1,570.00	50,868,000	
ミサワホーム	9,100	743.00	6,761,300	
高松コンストラクショングループ	5,600	2,089.00	11,698,400	
東建コーポレーション	2,800	8,180.00	22,904,000	
ヤマウラ	3,900	416.00	1,622,400	
大成建設	388,000	670.00	259,960,000	
大林組	224,000	954.00	213,696,000	
清水建設	229,000	838.00	191,902,000	
飛鳥建設	55,000	155.00	8,525,000	
長谷工コーポレーション	87,200	1,073.00	93,565,600	
松井建設	8,300	632.00	5,245,600	
銭高組	11,000	465.00	5,115,000	
鹿島建設	350,000	613.00	214,550,000	
不動テトラ	53,200	128.00	6,809,600	
大末建設	2,900	771.00	2,235,900	
鉄建建設	45,000	250.00	11,250,000	
西松建設	86,000	415.00	35,690,000	
三井住友建設	286,200	89.00	25,471,800	

大豊建設	29,000	508.00	14,732,000	
前田建設工業	46,000	679.00	31,234,000	
佐田建設	5,200	384.00	1,996,800	
ナカノフドー建設	5,700	609.00	3,471,300	
奥村組	71,000	580.00	41,180,000	
東鉄工業	9,000	2,657.00	23,913,000	
イチケン	8,000	363.00	2,904,000	
浅沼組	24,000	285.00	6,840,000	
戸田建設	87,000	537.00	46,719,000	
熊谷組	109,000	322.00	35,098,000	
青木あすなろ建設	5,000	708.00	3,540,000	
北野建設	16,000	281.00	4,496,000	
植木組	11,000	229.00	2,519,000	
三井ホーム	10,000	505.00	5,050,000	
矢作建設工業	10,200	698.00	7,119,600	
ピーエス三菱	9,300	351.00	3,264,300	
日本ハウスホールディングス	15,200	403.00	6,125,600	
大東建託	27,900	13,555.00	378,184,500	
新日本建設	8,900	533.00	4,743,700	
N I P P O	17,000	1,690.00	28,730,000	
東亜道路工業	14,000	380.00	5,320,000	
前田道路	23,000	1,747.00	40,181,000	
日本道路	22,000	507.00	11,154,000	
東亜建設工業	65,000	281.00	18,265,000	
若築建設	43,000	125.00	5,375,000	
東洋建設	23,400	483.00	11,302,200	
五洋建設	82,900	432.00	35,812,800	
大林道路	9,000	713.00	6,417,000	
世紀東急工業	11,700	516.00	6,037,200	
福田組	12,000	960.00	11,520,000	
住友林業	51,400	1,407.00	72,319,800	
日本基礎技術	8,300	422.00	3,502,600	
日成ビルド工業	21,000	360.00	7,560,000	
巴コーポレーション	9,900	331.00	3,276,900	
パナホーム	28,000	817.00	22,876,000	
大和ハウス工業	220,600	2,907.00	641,284,200	
ライト工業	14,400	968.00	13,939,200	
積水ハウス	249,700	1,707.50	426,362,750	
日特建設	8,200	410.00	3,362,000	
北陸電気工事	2,700	798.00	2,154,600	
ユアテック	12,000	965.00	11,580,000	
西部電気工業	6,000	420.00	2,520,000	

四電工	6,000	396.00	2,376,000	
中電工	10,800	2,427.00	26,211,600	
関電工	30,000	706.00	21,180,000	
きんでん	45,200	1,416.00	64,003,200	
東京エネシス	8,000	879.00	7,032,000	
トーエネック	11,000	688.00	7,568,000	
住友電設	5,900	1,393.00	8,218,700	
日本電設工業	12,200	2,139.00	26,095,800	
協和エクシオ	29,300	1,121.00	32,845,300	
新日本空調	6,300	932.00	5,871,600	
N D S	12,000	300.00	3,600,000	
九電工	14,000	2,343.00	32,802,000	
三機工業	16,600	913.00	15,155,800	
日揮	75,000	1,618.00	121,350,000	
中外炉工業	23,000	209.00	4,807,000	
ヤマト	7,100	414.00	2,939,400	
太平電業	11,000	1,180.00	12,980,000	
高砂熱学工業	22,300	1,493.00	33,293,900	
三晃金属工業	8,000	232.00	1,856,000	
朝日工業社	9,000	424.00	3,816,000	
明星工業	13,500	434.00	5,859,000	
大気社	9,100	2,443.00	22,231,300	
ダイダン	10,000	729.00	7,290,000	
日比谷総合設備	9,000	1,412.00	12,708,000	
東芝プラントシステム	12,100	1,290.00	15,609,000	
O S J Bホールディングス	15,200	210.00	3,192,000	
東洋エンジニアリング	40,000	276.00	11,040,000	
千代田化工建設	54,000	794.00	42,876,000	
新興プランテック	15,300	875.00	13,387,500	
日本製粉	49,000	781.00	38,269,000	
日清製粉グループ本社	81,900	1,726.00	141,359,400	
日東富士製粉	6,000	353.00	2,118,000	
昭和産業	31,000	431.00	13,361,000	
鳥越製粉	6,000	682.00	4,092,000	
中部飼料	7,000	799.00	5,593,000	
フィード・ワン	45,200	120.00	5,424,000	
東洋精糖	12,000	98.00	1,176,000	
日本甜菜製糖	38,000	190.00	7,220,000	
三井製糖	29,000	487.00	14,123,000	
塩水港精糖	8,100	225.00	1,822,500	
日新製糖	1,100	4,300.00	4,730,000	
森永製菓	67,000	587.00	39,329,000	

中村屋	17,000	440.00	7,480,000	
江崎グリコ	17,300	5,730.00	99,129,000	
名糖産業	3,300	1,244.00	4,105,200	
不二家	43,000	186.00	7,998,000	
山崎製パン	55,000	2,369.00	130,295,000	
第一屋製パン	11,000	100.00	1,100,000	
モロゾフ	11,000	413.00	4,543,000	
亀田製菓	4,200	4,530.00	19,026,000	
寿スピリッツ	1,800	4,675.00	8,415,000	
カルビー	27,700	4,470.00	123,819,000	
森永乳業	67,000	490.00	32,830,000	
六甲バター	3,400	1,448.00	4,923,200	
ヤクルト本社	40,100	4,890.00	196,089,000	
明治ホールディングス	44,200	8,720.00	385,424,000	
雪印メグミルク	17,600	2,731.00	48,065,600	
プリマハム	47,000	299.00	14,053,000	
日本ハム	55,000	2,137.00	117,535,000	
伊藤ハム	36,000	617.00	22,212,000	
丸大食品	38,000	415.00	15,770,000	
米久	2,400	2,214.00	5,313,600	
S Foods	4,700	2,257.00	10,607,900	
サッポロホールディングス	114,000	480.00	54,720,000	
アサヒグループホールディングス	140,100	3,413.00	478,161,300	
キリンホールディングス	302,700	1,522.00	460,709,400	
宝ホールディングス	54,100	810.00	43,821,000	
オエノンホールディングス	21,000	204.00	4,284,000	
養命酒製造	2,300	1,931.00	4,441,300	
コカ・コーラウエスト	25,300	2,259.00	57,152,700	
コカ・コーライーストジャパン	26,400	1,729.00	45,645,600	
サントリー食品インターナショナル	51,200	5,110.00	261,632,000	
ダイドードリンコ	3,800	5,120.00	19,456,000	
伊藤園	22,200	2,852.00	63,314,400	
キーコーヒー	6,600	1,770.00	11,682,000	
ユニカフェ	2,000	908.00	1,816,000	
ジャパンフーズ	1,000	1,106.00	1,106,000	
日清オイリオグループ	40,000	448.00	17,920,000	
不二製油グループ本社	20,000	1,734.00	34,680,000	
かどや製油	700	2,690.00	1,883,000	
J-オイルミルズ	31,000	308.00	9,548,000	
キッコーマン	57,000	3,455.00	196,935,000	
味の素	160,000	2,508.50	401,360,000	
キューピー	38,000	2,371.00	90,098,000	

ハウス食品グループ本社	25,500	2,083.00	53,116,500	
カゴメ	26,800	1,949.00	52,233,200	
焼津水産化学工業	3,500	1,002.00	3,507,000	
アリアケジャパン	6,100	5,610.00	34,221,000	
エバラ食品工業	1,800	1,944.00	3,499,200	
ニチレイ	80,000	784.00	62,720,000	
東洋水産	36,700	3,845.00	141,111,500	
イトアアンド	800	2,122.00	1,697,600	
日清食品ホールディングス	31,600	5,760.00	182,016,000	
永谷園ホールディングス	7,000	1,035.00	7,245,000	
一正蒲鉾	2,600	881.00	2,290,600	
フジッコ	7,300	1,909.00	13,935,700	
ロック・フィールド	3,900	2,766.00	10,787,400	
日本たばこ産業	441,600	3,955.00	1,746,528,000	
ケンコーマヨネーズ	2,400	2,253.00	5,407,200	
わらべや日洋	4,000	2,323.00	9,292,000	
なとり	3,800	1,588.00	6,034,400	
北の達人コーポレーション	1,100	469.00	515,900	
ユーグレナ	25,200	1,547.00	38,984,400	
ミヨシ油脂	26,000	121.00	3,146,000	
理研ビタミン	2,200	3,720.00	8,184,000	
片倉工業	8,900	1,064.00	9,469,600	
グンゼ	56,000	318.00	17,808,000	
東洋紡	277,000	151.00	41,827,000	
ユニチカ	203,000	47.00	9,541,000	
富士紡ホールディングス	34,000	192.00	6,528,000	
倉敷紡績	72,000	182.00	13,104,000	
シキボウ	43,000	107.00	4,601,000	
日本毛織	22,000	806.00	17,732,000	
トーア紡コーポレーション	3,000	531.00	1,593,000	
ダイドーリミテッド	7,800	485.00	3,783,000	
帝国繊維	7,400	1,225.00	9,065,000	
帝人	285,000	387.00	110,295,000	
東レ	507,000	999.00	506,493,000	
サカイオーバックス	19,000	195.00	3,705,000	
住江織物	19,000	285.00	5,415,000	
日本フェルト	3,700	477.00	1,764,900	
イチカワ	5,000	305.00	1,525,000	
芦森工業	20,000	167.00	3,340,000	
アツギ	57,000	111.00	6,327,000	
ダイニック	13,000	151.00	1,963,000	
セーレン	17,400	1,126.00	19,592,400	

東海染工	10,000	121.00	1,210,000	
小松精練	11,400	564.00	6,429,600	
ワコールホールディングス	42,000	1,332.00	55,944,000	
ホギメディカル	4,400	5,410.00	23,804,000	
レナウン	18,900	106.00	2,003,400	
クラウドシア	3,300	513.00	1,692,900	
T S I ホールディングス	31,200	804.00	25,084,800	
三陽商会	41,000	281.00	11,521,000	
オンワードホールディングス	47,000	713.00	33,511,000	
ルック	16,000	150.00	2,400,000	
ゴールドウイン	3,100	5,050.00	15,655,000	
デサント	15,900	1,551.00	24,660,900	
キング	3,500	396.00	1,386,000	
ヤマトインターナショナル	4,400	396.00	1,742,400	
特種東海製紙	41,000	320.00	13,120,000	
王子ホールディングス	286,000	435.00	124,410,000	
日本製紙	36,100	1,818.00	65,629,800	
三菱製紙	106,000	77.00	8,162,000	
北越紀州製紙	43,300	644.00	27,885,200	
中越パルプ工業	28,000	183.00	5,124,000	
巴川製紙所	11,000	201.00	2,211,000	
大王製紙	30,900	956.00	29,540,400	
レンゴー	62,000	474.00	29,388,000	
トーモク	22,000	243.00	5,346,000	
ザ・バック	4,900	2,445.00	11,980,500	
クラレ	110,200	1,326.00	146,125,200	
旭化成	435,000	717.80	312,243,000	
共和レザー	4,600	796.00	3,661,600	
昭和電工	465,000	126.00	58,590,000	
住友化学	514,000	549.00	282,186,000	
日本化成	13,000	115.00	1,495,000	
住友精化	14,000	629.00	8,806,000	
日産化学工業	42,000	2,405.00	101,010,000	
ラサ工業	26,000	112.00	2,912,000	
クレハ	53,000	406.00	21,518,000	
多木化学	4,000	681.00	2,724,000	
テイカ	12,000	517.00	6,204,000	
石原産業	125,000	81.00	10,125,000	
片倉コープアグリ	8,000	216.00	1,728,000	
日東エフシー	4,100	797.00	3,267,700	
日本曹達	45,000	606.00	27,270,000	
東ソー	188,000	523.00	98,324,000	

トクヤマ	116,000	223.00	25,868,000	
セントラル硝子	76,000	571.00	43,396,000	
東亜合成	43,700	925.00	40,422,500	
大阪ソーダ	30,000	405.00	12,150,000	
関東電化工業	17,000	892.00	15,164,000	
デンカ	145,000	476.00	69,020,000	
信越化学工業	125,200	5,747.00	719,524,400	
日本カーバイド工業	24,000	136.00	3,264,000	
堺化学工業	28,000	343.00	9,604,000	
エア・ウォーター	58,000	1,729.00	100,282,000	
大陽日酸	53,800	966.00	51,970,800	
日本化学工業	26,000	220.00	5,720,000	
日本パーカライジング	35,700	1,080.00	38,556,000	
高压ガス工業	10,000	605.00	6,050,000	
チタン工業	8,000	177.00	1,416,000	
四国化成工業	10,000	973.00	9,730,000	
戸田工業	14,000	250.00	3,500,000	
ステラ ケミファ	3,600	1,753.00	6,310,800	
保土谷化学工業	21,000	200.00	4,200,000	
日本触媒	10,100	7,390.00	74,639,000	
大日精化工業	27,000	471.00	12,717,000	
カネカ	94,000	1,066.00	100,204,000	
三菱瓦斯化学	120,000	537.00	64,440,000	
三井化学	296,000	464.00	137,344,000	
J S R	65,500	1,637.00	107,223,500	
東京応化工業	14,000	3,300.00	46,200,000	
大阪有機化学工業	5,000	608.00	3,040,000	
三菱ケミカルホールディングス	467,700	635.60	297,270,120	
日本合成化学工業	16,000	752.00	12,032,000	
ダイセル	98,200	1,532.00	150,442,400	
住友ベークライト	65,000	441.00	28,665,000	
積水化学工業	161,600	1,325.00	214,120,000	
日本ゼオン	60,000	818.00	49,080,000	
アイカ工業	21,000	2,066.00	43,386,000	
宇部興産	374,000	222.00	83,028,000	
積水樹脂	10,800	1,417.00	15,303,600	
タキロン	16,000	574.00	9,184,000	
旭有機材工業	23,000	199.00	4,577,000	
日立化成	34,500	1,658.00	57,201,000	
ニチバン	7,000	558.00	3,906,000	
リケンテクノス	11,300	365.00	4,124,500	
大倉工業	17,000	301.00	5,117,000	

積水化成品工業	18,000	385.00	6,930,000	
群栄化学工業	19,000	297.00	5,643,000	
タイガースポリマー	3,500	653.00	2,285,500	
ミライアル	2,500	962.00	2,405,000	
ダイキアクシス	1,300	833.00	1,082,900	
ダイキョーニシカワ	9,000	1,793.00	16,137,000	
日本化薬	45,000	1,178.00	53,010,000	
カーリットホールディングス	6,500	486.00	3,159,000	
日本精化	5,800	760.00	4,408,000	
A D E K A	34,300	1,494.00	51,244,200	
日油	53,000	791.00	41,923,000	
ハリマ化成グループ	6,000	553.00	3,318,000	
花王	187,800	5,629.00	1,057,126,200	
第一工業製薬	16,000	315.00	5,040,000	
ニイタカ	1,000	1,221.00	1,221,000	
三洋化成工業	22,000	847.00	18,634,000	
大日本塗料	40,000	195.00	7,800,000	
日本ペイントホールディングス	53,900	2,131.00	114,860,900	
関西ペイント	79,000	1,626.00	128,454,000	
神東塗料	5,000	194.00	970,000	
中国塗料	20,000	751.00	15,020,000	
日本特殊塗料	4,900	909.00	4,454,100	
藤倉化成	9,500	492.00	4,674,000	
太陽ホールディングス	5,100	4,045.00	20,629,500	
D I C	280,000	285.00	79,800,000	
サカタインクス	14,300	1,019.00	14,571,700	
東洋インキ S C ホールディングス	69,000	429.00	29,601,000	
T & K T O K A	5,100	983.00	5,013,300	
富士フイルムホールディングス	159,800	4,447.00	710,630,600	
資生堂	132,500	2,171.00	287,657,500	
ライオン	81,000	990.00	80,190,000	
高砂香料工業	4,600	2,450.00	11,270,000	
マンダム	6,500	4,565.00	29,672,500	
ミルボン	4,100	4,415.00	18,101,500	
ファンケル	16,200	1,420.00	23,004,000	
コーセー	11,300	9,330.00	105,429,000	
コタ	2,200	1,348.00	2,965,600	
シーズ・ホールディングス	9,500	1,958.00	18,601,000	
シーボン	800	2,470.00	1,976,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,100	7,030.00	49,913,000	
ノエビアホールディングス	4,400	3,000.00	13,200,000	
アジュバンコスメジャパン	1,300	975.00	1,267,500	

エステー	4,800	1,070.00	5,136,000	
アグロ カネショウ	2,700	846.00	2,284,200	
コニシ	5,500	2,251.00	12,380,500	
長谷川香料	8,800	1,380.00	12,144,000	
星光PMC	3,800	1,029.00	3,910,200	
小林製薬	10,600	9,310.00	98,686,000	
荒川化学工業	5,900	1,034.00	6,100,600	
メック	5,400	670.00	3,618,000	
日本高純度化学	2,000	2,097.00	4,194,000	
J C U	2,100	3,640.00	7,644,000	
新田ゼラチン	4,600	638.00	2,934,800	
デクセリアルズ	15,700	1,088.00	17,081,600	
アース製薬	5,000	4,465.00	22,325,000	
イハラケミカル工業	10,800	1,246.00	13,456,800	
北興化学工業	7,000	345.00	2,415,000	
大成ラミック	2,000	2,884.00	5,768,000	
クミアイ化学工業	14,400	1,139.00	16,401,600	
日本農薬	15,900	662.00	10,525,800	
アキレス	59,000	135.00	7,965,000	
有沢製作所	10,300	687.00	7,076,100	
日東電工	53,900	6,866.00	370,077,400	
レック	2,200	1,290.00	2,838,000	
きもと	11,500	229.00	2,633,500	
藤森工業	6,000	2,662.00	15,972,000	
前澤化成工業	4,900	1,021.00	5,002,900	
J S P	4,600	2,209.00	10,161,400	
エフピコ	6,200	4,120.00	25,544,000	
天馬	5,400	2,135.00	11,529,000	
信越ポリマー	13,700	608.00	8,329,600	
東リ	18,000	296.00	5,328,000	
ニフコ	13,400	5,020.00	67,268,000	
日本バルカー工業	27,000	293.00	7,911,000	
ユニ・チャーム	141,400	2,082.00	294,394,800	
協和発酵キリン	83,500	1,744.00	145,624,000	
武田薬品工業	278,000	5,374.00	1,493,972,000	
アステラス製薬	781,800	1,536.00	1,200,844,800	
大日本住友製薬	49,400	1,249.00	61,700,600	
塩野義製薬	101,800	4,908.00	499,634,400	
田辺三菱製薬	81,300	1,902.00	154,632,600	
わかもと製薬	8,000	261.00	2,088,000	
あすか製薬	8,900	1,143.00	10,172,700	
日本新薬	16,000	4,065.00	65,040,000	

バイオフェルミン製薬	1,100	3,605.00	3,965,500	
中外製薬	69,500	3,650.00	253,675,000	
科研製薬	12,000	7,220.00	86,640,000	
エーザイ	85,900	6,919.00	594,342,100	
ロート製薬	34,200	2,105.00	71,991,000	
小野薬品工業	31,700	17,450.00	553,165,000	
久光製薬	21,700	4,890.00	106,113,000	
有機合成薬品工業	5,000	259.00	1,295,000	
持田製薬	4,800	8,520.00	40,896,000	
参天製薬	128,500	1,789.00	229,886,500	
扶桑薬品工業	23,000	258.00	5,934,000	
日本ケミファ	10,000	510.00	5,100,000	
ツムラ	22,000	3,055.00	67,210,000	
日医工	16,300	2,518.00	41,043,400	
キッセイ薬品工業	12,400	2,698.00	33,455,200	
生化学工業	13,300	1,624.00	21,599,200	
栄研化学	5,900	2,292.00	13,522,800	
日水製薬	2,800	1,297.00	3,631,600	
鳥居薬品	4,800	2,530.00	12,144,000	
J C R ファーマ	5,400	2,281.00	12,317,400	
東和薬品	3,200	6,290.00	20,128,000	
富士製薬工業	1,900	2,075.00	3,942,500	
沢井製薬	11,800	7,390.00	87,202,000	
ゼリア新薬工業	14,300	1,351.00	19,319,300	
第一三共	234,800	2,265.00	531,822,000	
キョーリン製薬ホールディングス	18,600	2,167.00	40,306,200	
大幸薬品	3,400	1,468.00	4,991,200	
ダイト	3,100	2,558.00	7,929,800	
大塚ホールディングス	150,100	3,764.00	564,976,400	
大正製薬ホールディングス	16,800	7,500.00	126,000,000	
日本コークス工業	56,300	81.00	4,560,300	
昭和シェル石油	70,200	842.00	59,108,400	
ニチレキ	9,000	845.00	7,605,000	
東燃ゼネラル石油	105,000	902.00	94,710,000	
ユシロ化学工業	3,700	1,231.00	4,554,700	
ビーピー・カストロール	2,900	1,050.00	3,045,000	
富士石油	16,200	272.00	4,406,400	
MORESCO	2,200	1,457.00	3,205,400	
出光興産	36,400	1,622.00	59,040,800	
J X ホールディングス	826,400	411.30	339,898,320	
コスモエネルギーホールディングス	21,100	1,246.00	26,290,600	
横浜ゴム	42,100	1,627.00	68,496,700	

東洋ゴム工業	31,600	2,227.00	70,373,200	
ブリヂストン	235,600	3,868.00	911,300,800	
住友ゴム工業	65,300	1,378.00	89,983,400	
藤倉ゴム工業	5,800	502.00	2,911,600	
オカモト	22,000	829.00	18,238,000	
フコク	2,600	929.00	2,415,400	
ニッタ	7,500	2,710.00	20,325,000	
住友理工	15,100	897.00	13,544,700	
三ツ星ベルト	17,000	821.00	13,957,000	
バンドー化学	25,000	446.00	11,150,000	
日東紡績	47,000	319.00	14,993,000	
旭硝子	368,000	638.00	234,784,000	
日本板硝子	337,000	82.00	27,634,000	
石塚硝子	10,000	189.00	1,890,000	
日本山村硝子	28,000	163.00	4,564,000	
日本電気硝子	144,000	534.00	76,896,000	
オハラ	2,600	554.00	1,440,400	
住友大阪セメント	138,000	459.00	63,342,000	
太平洋セメント	436,000	320.00	139,520,000	
デイ・シイ	7,800	280.00	2,184,000	
日本ヒューム	6,700	634.00	4,247,800	
日本コンクリート工業	15,500	307.00	4,758,500	
三谷セキサン	3,500	1,439.00	5,036,500	
アジアパイルホールディングス	9,200	455.00	4,186,000	
東海カーボン	61,000	301.00	18,361,000	
日本カーボン	34,000	238.00	8,092,000	
東洋炭素	3,900	1,641.00	6,399,900	
ノリタケカンパニーリミテド	39,000	244.00	9,516,000	
TOTO	51,300	3,545.00	181,858,500	
日本碍子	88,000	2,272.00	199,936,000	
日本特殊陶業	60,200	2,666.00	160,493,200	
MARUWA	2,600	2,483.00	6,455,800	
品川リフラクトリーズ	18,000	241.00	4,338,000	
黒崎播磨	17,000	250.00	4,250,000	
ヨータイ	4,000	298.00	1,192,000	
イソライト工業	5,400	197.00	1,063,800	
東京窯業	9,000	178.00	1,602,000	
ニッカトー	2,500	376.00	940,000	
フジミインコーポレーテッド	6,200	1,513.00	9,380,600	
ニチアス	36,000	702.00	25,272,000	
ニチハ	9,300	1,559.00	14,498,700	
新日鐵住金	314,700	2,055.00	646,708,500	

神戸製鋼所	1,284,000	110.00	141,240,000	
合同製鐵	41,000	209.00	8,569,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	190,900	1,609.00	307,158,100	
日新製鋼	32,300	1,106.00	35,723,800	
東京製鐵	38,500	719.00	27,681,500	
共英製鋼	7,400	2,034.00	15,051,600	
大和工業	15,500	2,798.00	43,369,000	
東京鐵鋼	15,000	490.00	7,350,000	
大阪製鐵	4,400	1,948.00	8,571,200	
淀川製鋼所	10,400	2,088.00	21,715,200	
東洋鋼鈑	17,100	368.00	6,292,800	
丸一鋼管	23,400	3,215.00	75,231,000	
モリ工業	12,000	308.00	3,696,000	
大同特殊鋼	117,000	423.00	49,491,000	
日本高周波鋼業	32,000	82.00	2,624,000	
日本冶金工業	55,900	119.00	6,652,100	
山陽特殊製鋼	42,000	518.00	21,756,000	
愛知製鋼	41,000	460.00	18,860,000	
日立金属	79,900	1,288.00	102,911,200	
日本金属	18,000	115.00	2,070,000	
大平洋金属	49,000	279.00	13,671,000	
新日本電工	40,200	186.00	7,477,200	
栗本鐵工所	35,000	199.00	6,965,000	
虹技	10,000	160.00	1,600,000	
日本鑄鉄管	10,000	149.00	1,490,000	
三菱製鋼	50,000	195.00	9,750,000	
日亜鋼業	10,900	275.00	2,997,500	
日本精線	5,000	480.00	2,400,000	
シンニッタン	6,400	567.00	3,628,800	
新家工業	16,000	125.00	2,000,000	
大紀アルミニウム工業所	11,000	283.00	3,113,000	
日本軽金属ホールディングス	158,000	189.00	29,862,000	
三井金属鉱業	178,000	181.00	32,218,000	
東邦亜鉛	37,000	224.00	8,288,000	
三菱マテリアル	436,000	339.00	147,804,000	
住友金属鉱山	193,000	1,185.00	228,705,000	
DOWAホールディングス	90,000	740.00	66,600,000	
古河機械金属	109,000	199.00	21,691,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,900	2,104.00	14,517,600	
東邦チタニウム	11,800	825.00	9,735,000	
U A C J	98,000	235.00	23,030,000	
古河電気工業	219,000	243.00	53,217,000	

住友電気工業	279,400	1,466.00	409,600,400	
フジクラ	97,000	578.00	56,066,000	
昭和電線ホールディングス	83,000	63.00	5,229,000	
東京特殊電線	1,200	930.00	1,116,000	
タツタ電線	15,100	393.00	5,934,300	
沖電線	9,000	218.00	1,962,000	
カナレ電気	1,200	1,737.00	2,084,400	
平河ヒューテック	1,800	1,688.00	3,038,400	
リョービ	43,000	427.00	18,361,000	
アーレスティ	8,100	647.00	5,240,700	
アサヒホールディングス	10,500	1,638.00	17,199,000	
稲葉製作所	3,700	1,200.00	4,440,000	
宮地エンジニアリンググループ	25,000	162.00	4,050,000	
トーカロ	4,900	2,135.00	10,461,500	
アルファC O	2,800	1,202.00	3,365,600	
SUMCO	55,800	802.00	44,751,600	
川田テクノロジーズ	1,500	3,420.00	5,130,000	
東洋製罐グループホールディングス	49,600	2,004.00	99,398,400	
ホッカンホールディングス	21,000	290.00	6,090,000	
コロナ	3,700	1,045.00	3,866,500	
横河ブリッジホールディングス	13,400	1,147.00	15,369,800	
駒井ハルテック	16,000	209.00	3,344,000	
高田機工	7,000	195.00	1,365,000	
三和ホールディングス	70,800	814.00	57,631,200	
文化シャッター	19,500	896.00	17,472,000	
三協立山	9,600	1,369.00	13,142,400	
アルインコ	3,900	1,013.00	3,950,700	
東洋シャッター	2,500	664.00	1,660,000	
L I X I Lグループ	97,200	2,420.00	235,224,000	
日本ファイルコン	6,200	432.00	2,678,400	
ノーリツ	13,700	1,756.00	24,057,200	
長府製作所	7,500	2,358.00	17,685,000	
リンナイ	13,000	10,140.00	131,820,000	
ダイニチ工業	3,600	655.00	2,358,000	
日東精工	11,000	285.00	3,135,000	
三洋工業	10,000	159.00	1,590,000	
岡部	14,500	804.00	11,658,000	
ジーテクト	7,600	1,399.00	10,632,400	
東プレ	13,400	2,317.00	31,047,800	
高周波熱錬	13,000	853.00	11,089,000	
サンコール	3,800	522.00	1,983,600	
モリテック スチール	4,600	265.00	1,219,000	

パイオラックス	3,500	5,300.00	18,550,000	
日本発條	65,700	1,066.00	70,036,200	
中央発條	9,000	267.00	2,403,000	
アドバネクス	1,800	1,567.00	2,820,600	
立川ブラインド工業	3,100	703.00	2,179,300	
三益半導体工業	5,200	993.00	5,163,600	
日本ドライケミカル	900	2,122.00	1,909,800	
日本製鋼所	115,000	363.00	41,745,000	
三浦工業	31,100	1,542.00	47,956,200	
タクマ	26,000	830.00	21,580,000	
ツガミ	20,000	467.00	9,340,000	
オークマ	45,000	837.00	37,665,000	
東芝機械	38,000	351.00	13,338,000	
アマダホールディングス	101,800	1,028.00	104,650,400	
アイダエンジニアリング	18,300	1,024.00	18,739,200	
滝澤鉄工所	22,000	136.00	2,992,000	
富士機械製造	22,800	1,050.00	23,940,000	
牧野フライス製作所	35,000	759.00	26,565,000	
オーエスジー	31,800	1,928.00	61,310,400	
ダイジェット工業	11,000	142.00	1,562,000	
旭ダイヤモンド工業	19,100	1,116.00	21,315,600	
DMG森精機	38,700	1,110.00	42,957,000	
ソディック	13,300	733.00	9,748,900	
ディスコ	8,900	10,110.00	89,979,000	
日東工器	4,100	2,200.00	9,020,000	
パンチ工業	2,700	822.00	2,219,400	
豊和工業	4,100	556.00	2,279,600	
OKK	29,000	121.00	3,509,000	
東洋機械金属	5,100	395.00	2,014,500	
津田駒工業	17,000	110.00	1,870,000	
島精機製作所	9,900	1,691.00	16,740,900	
日阪製作所	8,800	795.00	6,996,000	
やまびこ	12,800	840.00	10,752,000	
ペガサスミシン製造	7,200	422.00	3,038,400	
ナブテスコ	37,200	2,100.00	78,120,000	
三井海洋開発	8,200	1,256.00	10,299,200	
レオン自動機	5,900	701.00	4,135,900	
SMC	20,900	25,925.00	541,832,500	
新川	6,200	494.00	3,062,800	
ホソカワミクロン	12,000	544.00	6,528,000	
ユニオンツール	3,000	2,775.00	8,325,000	
オイレス工業	9,000	1,691.00	15,219,000	

日精エー・エス・ピー機械	2,500	1,931.00	4,827,500	
サトーホールディングス	9,400	2,341.00	22,005,400	
日本エアテック	2,400	590.00	1,416,000	
日精樹脂工業	5,100	826.00	4,212,600	
ワイエイシイ	2,800	744.00	2,083,200	
小松製作所	342,000	1,703.00	582,426,000	
住友重機械工業	204,000	466.00	95,064,000	
日立建機	31,200	1,667.00	52,010,400	
日工	11,000	359.00	3,949,000	
巴工業	2,800	1,460.00	4,088,000	
井関農機	73,000	160.00	11,680,000	
TOWA	6,700	605.00	4,053,500	
丸山製作所	16,000	169.00	2,704,000	
北川鉄工所	32,000	216.00	6,912,000	
クボタ	335,400	1,583.50	531,105,900	
荏原実業	2,100	1,303.00	2,736,300	
三菱化工機	25,000	208.00	5,200,000	
月島機械	13,300	995.00	13,233,500	
帝国電機製作所	5,100	874.00	4,457,400	
新東工業	15,900	843.00	13,403,700	
澁谷工業	5,800	1,433.00	8,311,400	
アイチ コーポレーション	9,900	737.00	7,296,300	
小森コーポレーション	17,000	1,238.00	21,046,000	
鶴見製作所	5,200	1,584.00	8,236,800	
住友精密工業	11,000	372.00	4,092,000	
酒井重工業	13,000	191.00	2,483,000	
荏原製作所	154,000	502.00	77,308,000	
石井鐵工所	11,000	167.00	1,837,000	
西島製作所	7,500	837.00	6,277,500	
北越工業	7,500	707.00	5,302,500	
ダイキン工業	97,100	7,385.00	717,083,500	
オルガノ	12,000	430.00	5,160,000	
トーヨーカネツ	37,000	238.00	8,806,000	
栗田工業	41,900	2,383.00	99,847,700	
椿本チエイン	40,000	769.00	30,760,000	
大同工業	15,000	193.00	2,895,000	
日本コンベヤ	23,000	126.00	2,898,000	
木村化工機	6,600	357.00	2,356,200	
アネスト岩田	11,300	924.00	10,441,200	
ダイフク	34,800	1,805.00	62,814,000	
サムコ	1,100	908.00	998,800	
加藤製作所	16,000	436.00	6,976,000	

油研工業	14,000	225.00	3,150,000	
タダノ	32,000	1,178.00	37,696,000	
フジテック	19,400	1,091.00	21,165,400	
C K D	18,500	1,115.00	20,627,500	
キトー	8,400	918.00	7,711,200	
平和	20,700	2,129.00	44,070,300	
理想科学工業	7,400	1,665.00	12,321,000	
S A N K Y O	18,500	4,270.00	78,995,000	
日本金銭機械	6,100	947.00	5,776,700	
マースエンジニアリング	3,800	1,917.00	7,284,600	
福島工業	4,100	2,380.00	9,758,000	
オーイズミ	2,800	568.00	1,590,400	
ダイコク電機	2,800	1,389.00	3,889,200	
竹内製作所	9,900	1,888.00	18,691,200	
アマノ	20,600	1,406.00	28,963,600	
J U K I	9,900	846.00	8,375,400	
サンデンホールディングス	41,000	306.00	12,546,000	
蛇の目ミシン工業	6,500	614.00	3,991,000	
マックス	10,000	1,128.00	11,280,000	
グローリー	22,700	3,450.00	78,315,000	
新晃工業	4,600	1,472.00	6,771,200	
大和冷機工業	10,700	832.00	8,902,400	
セガサミーホールディングス	71,600	1,037.00	74,249,200	
日本ピストンリング	2,800	1,779.00	4,981,200	
リケン	31,000	396.00	12,276,000	
T P R	8,200	2,788.00	22,861,600	
ホシザキ電機	14,600	7,960.00	116,216,000	
大豊工業	5,400	1,219.00	6,582,600	
日本精工	136,900	1,131.00	154,833,900	
N T N	165,000	411.00	67,815,000	
ジェイテクト	71,100	1,744.00	123,998,400	
不二越	62,000	427.00	26,474,000	
日本トムソン	23,000	450.00	10,350,000	
T H K	44,300	1,973.00	87,403,900	
ユーシン精機	2,600	1,920.00	4,992,000	
前澤給装工業	2,700	1,411.00	3,809,700	
イーグル工業	8,200	1,839.00	15,079,800	
前澤工業	4,900	297.00	1,455,300	
日本ピラー工業	6,700	896.00	6,003,200	
キッツ	32,400	495.00	16,038,000	
日立工機	17,800	749.00	13,332,200	
マキタ	43,500	6,280.00	273,180,000	

日立造船	52,200	565.00	29,493,000	
三菱重工業	1,187,000	442.60	525,366,200	
I H I	512,000	255.00	130,560,000	
日清紡ホールディングス	37,000	1,121.00	41,477,000	
イビデン	40,800	1,508.00	61,526,400	
コニカミノルタ	166,500	1,031.00	171,661,500	
ブラザー工業	86,200	1,210.00	104,302,000	
ミネベア	107,000	895.00	95,765,000	
日立製作所	1,701,000	586.70	997,976,700	
東芝	1,403,000	219.40	307,818,200	
三菱電機	711,000	1,086.50	772,501,500	
富士電機	201,000	447.00	89,847,000	
東洋電機製造	13,000	358.00	4,654,000	
安川電機	82,800	1,377.00	114,015,600	
シンフォニアテクノロジー	43,000	165.00	7,095,000	
明電舎	61,000	421.00	25,681,000	
オリジン電気	10,000	287.00	2,870,000	
山洋電気	18,000	587.00	10,566,000	
デンヨー	6,200	1,491.00	9,244,200	
東芝テック	48,000	381.00	18,288,000	
芝浦メカトロニクス	11,000	194.00	2,134,000	
マブチモーター	19,100	5,840.00	111,544,000	
日本電産	80,200	7,862.00	630,532,400	
東光高岳	3,700	1,404.00	5,194,800	
ダブル・スコープ	2,000	3,410.00	6,820,000	
ダイヘン	39,000	580.00	22,620,000	
田淵電機	7,600	671.00	5,099,600	
ヤーマン	900	1,919.00	1,727,100	
J V C ケンウッド	49,000	280.00	13,720,000	
ミマキエンジニアリング	4,600	421.00	1,936,600	
第一精工	2,800	1,393.00	3,900,400	
日新電機	15,600	908.00	14,164,800	
大崎電気工業	12,000	594.00	7,128,000	
オムロン	76,500	3,360.00	257,040,000	
日東工業	10,700	1,820.00	19,474,000	
I D E C	8,700	1,004.00	8,734,800	
不二電機工業	600	1,422.00	853,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	128,000	393.00	50,304,000	
サクサホールディングス	17,000	185.00	3,145,000	
メルコホールディングス	3,700	1,894.00	7,007,800	
テクノメディカ	1,500	2,494.00	3,741,000	
日本電気	917,000	357.00	327,369,000	

富士通	643,000	514.20	330,630,600	
沖電気工業	289,000	127.00	36,703,000	
岩崎通信機	31,000	67.00	2,077,000	
電気興業	17,000	498.00	8,466,000	
サンケン電気	36,000	345.00	12,420,000	
ナカヨ	6,000	338.00	2,028,000	
アイホン	3,800	1,801.00	6,843,800	
ルネサスエレクトロニクス	34,600	813.00	28,129,800	
セイコーエプソン	99,300	1,524.00	151,333,200	
ワコム	52,600	450.00	23,670,000	
アルバック	11,200	2,844.00	31,852,800	
アクセル	3,300	1,058.00	3,491,400	
E I Z O	6,600	2,685.00	17,721,000	
ジャパンディスプレイ	124,600	281.00	35,012,600	
日本信号	18,400	1,100.00	20,240,000	
京三製作所	16,000	326.00	5,216,000	
能美防災	7,600	1,245.00	9,462,000	
ホーチキ	4,900	912.00	4,468,800	
エレコム	5,800	1,418.00	8,224,400	
日本無線	17,000	305.00	5,185,000	
パナソニック	761,600	1,063.00	809,580,800	
シャープ	563,000	121.00	68,123,000	
アンリツ	40,000	769.00	30,760,000	
富士通ゼネラル	20,000	1,410.00	28,200,000	
日立国際電気	15,000	1,406.00	21,090,000	
ソニー	470,300	2,454.00	1,154,116,200	
T D K	40,200	6,850.00	275,370,000	
帝国通信工業	16,000	182.00	2,912,000	
ミツミ電機	25,400	552.00	14,020,800	
タムラ製作所	26,000	305.00	7,930,000	
アルプス電気	56,500	2,606.00	147,239,000	
池上通信機	21,000	147.00	3,087,000	
パイオニア	107,900	260.00	28,054,000	
日本電波工業	6,100	696.00	4,245,600	
鈴木	1,800	526.00	946,800	
日本トリム	1,800	3,850.00	6,930,000	
ローランド ディー. ジー.	3,300	2,227.00	7,349,100	
フォスター電機	8,400	2,329.00	19,563,600	
クラリオン	35,000	391.00	13,685,000	
SMK	20,000	569.00	11,380,000	
ヨコオ	4,800	503.00	2,414,400	
東光	14,000	366.00	5,124,000	

ホシデン	20,300	540.00	10,962,000	
ヒロセ電機	10,800	12,910.00	139,428,000	
日本航空電子工業	19,000	1,327.00	25,213,000	
TOA	7,900	1,082.00	8,547,800	
日立マクセル	11,100	1,846.00	20,490,600	
古野電気	8,000	729.00	5,832,000	
ユニデンホールディングス	21,000	120.00	2,520,000	
アルパイン	15,900	1,450.00	23,055,000	
スミダコーポレーション	5,500	624.00	3,432,000	
アイコム	3,700	2,058.00	7,614,600	
リオン	2,600	1,857.00	4,828,200	
船井電機	6,700	819.00	5,487,300	
横河電機	66,700	1,228.00	81,907,600	
新電元工業	24,000	392.00	9,408,000	
アズビル	21,800	2,701.00	58,881,800	
東亜ディーケーケー	2,800	456.00	1,276,800	
日本光電工業	27,900	2,496.00	69,638,400	
チノー	2,400	1,042.00	2,500,800	
共和電業	8,100	363.00	2,940,300	
日本電子材料	2,600	508.00	1,320,800	
堀場製作所	12,300	4,165.00	51,229,500	
アドバンテスト	45,400	933.00	42,358,200	
小野測器	3,300	769.00	2,537,700	
エスベック	6,900	1,264.00	8,721,600	
パナソニック デバイスSUNX	5,900	573.00	3,380,700	
キーエンス	15,100	55,380.00	836,238,000	
日置電機	3,500	1,852.00	6,482,000	
シスメックス	51,700	6,880.00	355,696,000	
日本マイクロニクス	8,700	1,014.00	8,821,800	
メガチップス	7,000	986.00	6,902,000	
OBARA GROUP	4,300	3,635.00	15,630,500	
澤藤電機	4,000	200.00	800,000	
コーセル	9,300	928.00	8,630,400	
新日本無線	5,000	441.00	2,205,000	
オブテックス	4,900	2,647.00	12,970,300	
千代田インテグレ	3,500	2,645.00	9,257,500	
レーザーテック	6,900	1,164.00	8,031,600	
スタンレー電気	47,900	2,356.00	112,852,400	
岩崎電気	23,000	208.00	4,784,000	
ウシオ電機	40,500	1,522.00	61,641,000	
岡谷電機産業	3,600	394.00	1,418,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	5,700	381.00	2,171,700	

日本セラミック	3,800	1,786.00	6,786,800	
遠藤照明	3,400	1,028.00	3,495,200	
日本デジタル研究所	5,600	1,505.00	8,428,000	
古河電池	5,000	677.00	3,385,000	
双信電機	3,300	276.00	910,800	
山一電機	5,800	765.00	4,437,000	
図研	4,800	1,013.00	4,862,400	
日本電子	26,000	671.00	17,446,000	
カシオ計算機	66,800	2,433.00	162,524,400	
ファナック	68,200	18,090.00	1,233,738,000	
日本シイエムケイ	14,500	368.00	5,336,000	
エンプラス	3,400	3,735.00	12,699,000	
大真空	12,000	190.00	2,280,000	
ローム	32,900	5,140.00	169,106,000	
浜松ホトニクス	52,000	2,807.00	145,964,000	
三井ハイテック	9,700	601.00	5,829,700	
新光電気工業	25,200	691.00	17,413,200	
京セラ	109,400	4,882.00	534,090,800	
太陽誘電	32,400	1,411.00	45,716,400	
村田製作所	69,900	13,770.00	962,523,000	
ユーシン	8,900	609.00	5,420,100	
双葉電子工業	11,400	1,441.00	16,427,400	
北陸電気工業	27,000	140.00	3,780,000	
ニチコン	21,000	824.00	17,304,000	
日本ケミコン	54,000	180.00	9,720,000	
KOA	9,300	871.00	8,100,300	
市光工業	16,000	200.00	3,200,000	
小糸製作所	39,900	4,380.00	174,762,000	
ミツバ	11,300	1,524.00	17,221,200	
スター精密	12,700	1,290.00	16,383,000	
S C R E E Nホールディングス	68,000	809.00	55,012,000	
キャノン電子	6,100	1,751.00	10,681,100	
キャノン	358,900	3,238.00	1,162,118,200	
リコー	215,900	1,103.00	238,137,700	
MUTOHホールディングス	8,000	242.00	1,936,000	
東京エレクトロン	59,800	6,616.00	395,636,800	
トヨタ紡織	23,500	2,141.00	50,313,500	
鬼怒川ゴム工業	16,000	561.00	8,976,000	
ユニプレス	13,900	2,346.00	32,609,400	
豊田自動織機	60,800	5,500.00	334,400,000	
モリタホールディングス	11,700	1,127.00	13,185,900	
三櫻工業	9,100	653.00	5,942,300	

デンソー	164,800	4,948.00	815,430,400	
東海理化電機製作所	19,500	2,629.00	51,265,500	
三井造船	258,000	159.00	41,022,000	
川崎重工業	519,000	351.00	182,169,000	
名村造船所	20,500	809.00	16,584,500	
サノヤスホールディングス	11,100	206.00	2,286,600	
日本車輛製造	27,000	235.00	6,345,000	
ニチュ三菱フォークリフト	7,700	438.00	3,372,600	
近畿車輛	10,000	341.00	3,410,000	
日産自動車	935,700	1,063.50	995,116,950	
いすゞ自動車	193,200	1,105.00	213,486,000	
トヨタ自動車	829,100	6,574.00	5,450,503,400	
日野自動車	95,100	1,239.00	117,828,900	
三菱自動車工業	264,700	907.00	240,082,900	
エフテック	4,000	1,044.00	4,176,000	
レシップホールディングス	2,200	725.00	1,595,000	
GMB	1,600	950.00	1,520,000	
ファルテック	1,600	1,368.00	2,188,800	
武蔵精密工業	7,100	2,153.00	15,286,300	
日産車体	32,500	1,087.00	35,327,500	
新明和工業	29,000	956.00	27,724,000	
極東開発工業	13,300	1,117.00	14,856,100	
日信工業	14,900	1,540.00	22,946,000	
トピー工業	57,000	216.00	12,312,000	
ティラド	26,000	183.00	4,758,000	
曙ブレーキ工業	33,800	238.00	8,044,400	
タチエス	10,700	1,696.00	18,147,200	
NOK	32,500	2,363.00	76,797,500	
フタバ産業	22,000	461.00	10,142,000	
K Y B	75,000	310.00	23,250,000	
シロキ工業	17,000	330.00	5,610,000	
大同メタル工業	9,500	945.00	8,977,500	
プレス工業	35,800	459.00	16,432,200	
ミクニ	7,500	360.00	2,700,000	
カルソニックカンセイ	51,000	908.00	46,308,000	
太平洋工業	14,700	1,160.00	17,052,000	
ケーヒン	15,300	1,718.00	26,285,400	
河西工業	8,600	1,430.00	12,298,000	
アイシン精機	67,200	4,520.00	303,744,000	
富士機工	7,800	393.00	3,065,400	
マツダ	211,100	1,969.50	415,761,450	
ダイハツ工業	79,600	1,443.00	114,862,800	

今仙電機製作所	6,300	1,112.00	7,005,600	
本田技研工業	599,900	3,315.00	1,988,668,500	
スズキ	139,400	3,220.00	448,868,000	
富士重工業	210,700	4,364.00	919,494,800	
安永	3,200	512.00	1,638,400	
ヤマハ発動機	94,200	2,330.00	219,486,000	
ショーワ	17,300	997.00	17,248,100	
T B K	8,500	417.00	3,544,500	
エクセディ	9,100	2,519.00	22,922,900	
豊田合成	24,200	2,428.00	58,757,600	
愛三工業	11,700	1,061.00	12,413,700	
盟和産業	800	996.00	796,800	
ヨロズ	6,200	2,360.00	14,632,000	
エフ・シー・シー	10,900	2,304.00	25,113,600	
シマノ	26,900	16,660.00	448,154,000	
テイ・エス テック	15,500	2,727.00	42,268,500	
ジャムコ	3,000	2,843.00	8,529,000	
テルモ	102,200	3,505.00	358,211,000	
クリエートメディック	2,200	881.00	1,938,200	
日機装	25,000	770.00	19,250,000	
島津製作所	86,000	1,725.00	148,350,000	
J M S	12,000	278.00	3,336,000	
モリテックス	1,400	209.00	292,600	
長野計器	4,300	642.00	2,760,600	
ブイ・テクノロジー	1,600	3,645.00	5,832,000	
東京計器	21,000	197.00	4,137,000	
愛知時計電機	9,000	311.00	2,799,000	
オーバル	6,600	230.00	1,518,000	
東京精密	12,900	2,385.00	30,766,500	
マニー	6,100	1,844.00	11,248,400	
ニコン	124,500	1,663.00	207,043,500	
トプコン	22,400	1,535.00	34,384,000	
オリンパス	99,300	4,280.00	425,004,000	
理研計器	5,400	1,100.00	5,940,000	
タムロン	5,400	1,940.00	10,476,000	
H O Y A	155,100	4,544.00	704,774,400	
ノーリツ銅機	6,000	533.00	3,198,000	
エー・アンド・デイ	6,100	376.00	2,293,600	
シチズンホールディングス	82,100	752.00	61,739,200	
リズム時計工業	29,000	138.00	4,002,000	
大研医器	5,300	861.00	4,563,300	
メニコン	3,300	3,610.00	11,913,000	

松風	3,300	1,289.00	4,253,700	
セイコーホールディングス	43,000	594.00	25,542,000	
ニプロ	49,700	1,113.00	55,316,100	
パラマウントベッドホールディングス	7,000	3,990.00	27,930,000	
トランザクション	1,000	548.00	548,000	
SHO-B I	2,200	392.00	862,400	
ニホンフラッシュ	1,900	1,120.00	2,128,000	
前田工繊	7,300	989.00	7,219,700	
永大産業	9,000	408.00	3,672,000	
アートネイチャー	5,300	862.00	4,568,600	
ダンロップスポーツ	4,200	789.00	3,313,800	
バンダイナムコホールディングス	68,900	2,489.00	171,492,100	
アイフィスジャパン	1,100	413.00	454,300	
共立印刷	11,100	287.00	3,185,700	
SHOE I	3,200	2,058.00	6,585,600	
フランスベッドホールディングス	9,300	892.00	8,295,600	
パイロットコーポレーション	11,600	3,900.00	45,240,000	
萩原工業	1,400	2,119.00	2,966,600	
トッパン・フォームズ	11,900	1,227.00	14,601,300	
フジシールインターナショナル	8,100	3,430.00	27,783,000	
タカラトミー	21,900	678.00	14,848,200	
廣済堂	6,200	355.00	2,201,000	
A s - m e エステール	1,800	679.00	1,222,200	
アーク	28,000	92.00	2,576,000	
タカノ	2,900	634.00	1,838,600	
プロネクサス	6,200	923.00	5,722,600	
ホクシン	5,300	113.00	598,900	
ウッドワン	12,000	236.00	2,832,000	
大建工業	26,000	276.00	7,176,000	
凸版印刷	188,000	967.00	181,796,000	
大日本印刷	197,000	1,040.00	204,880,000	
図書印刷	12,000	470.00	5,640,000	
共同印刷	22,000	303.00	6,666,000	
日本写真印刷	11,200	2,135.00	23,912,000	
光村印刷	7,000	233.00	1,631,000	
宝印刷	3,500	1,212.00	4,242,000	
アシックス	62,100	2,014.00	125,069,400	
ツツミ	3,300	2,306.00	7,609,800	
小松ウオール工業	2,300	1,770.00	4,071,000	
ヤマハ	49,000	2,496.00	122,304,000	
河合楽器製作所	2,500	1,923.00	4,807,500	
クリナップ	7,800	679.00	5,296,200	

ピジョン	37,800	2,250.00	85,050,000	
兼松日産農林	7,000	145.00	1,015,000	
キングジム	5,500	748.00	4,114,000	
リンテック	15,800	2,291.00	36,197,800	
T A S A K I	1,300	1,399.00	1,818,700	
イトーキ	14,000	731.00	10,234,000	
任天堂	41,100	14,865.00	610,951,500	
三菱鉛筆	5,000	4,530.00	22,650,000	
タカラスタンダード	28,000	802.00	22,456,000	
コクヨ	34,600	1,147.00	39,686,200	
ナカバヤシ	14,000	252.00	3,528,000	
グローブライド	3,200	1,404.00	4,492,800	
岡村製作所	23,300	1,010.00	23,533,000	
美津濃	36,000	530.00	19,080,000	
アデランス	11,600	589.00	6,832,400	
東京電力	565,500	572.00	323,466,000	
中部電力	204,000	1,435.00	292,740,000	
関西電力	272,000	1,218.00	331,296,000	
中国電力	92,200	1,465.00	135,073,000	
北陸電力	65,300	1,589.00	103,761,700	
東北電力	166,500	1,409.00	234,598,500	
四国電力	60,000	1,633.00	97,980,000	
九州電力	147,200	1,148.00	168,985,600	
北海道電力	62,400	1,090.00	68,016,000	
沖縄電力	7,100	2,844.00	20,192,400	
電源開発	56,800	3,785.00	214,988,000	
東京瓦斯	744,000	500.10	372,074,400	
大阪瓦斯	690,000	409.00	282,210,000	
東邦瓦斯	168,000	720.00	120,960,000	
北海道瓦斯	16,000	272.00	4,352,000	
広島ガス	11,600	392.00	4,547,200	
西部瓦斯	75,000	256.00	19,200,000	
静岡ガス	18,900	712.00	13,456,800	
メタウォーター	4,300	2,656.00	11,420,800	
S B S ホールディングス	6,600	758.00	5,002,800	
東武鉄道	356,000	546.00	194,376,000	
相鉄ホールディングス	114,000	645.00	73,530,000	
東京急行電鉄	388,000	863.00	334,844,000	
京浜急行電鉄	183,000	922.00	168,726,000	
小田急電鉄	214,000	1,158.00	247,812,000	
京王電鉄	186,000	952.00	177,072,000	
京成電鉄	100,000	1,448.00	144,800,000	

富士急行	18,000	1,103.00	19,854,000	
新京成電鉄	9,000	412.00	3,708,000	
東日本旅客鉄道	121,900	9,945.00	1,212,295,500	
西日本旅客鉄道	64,200	7,244.00	465,064,800	
東海旅客鉄道	59,700	19,670.00	1,174,299,000	
西武ホールディングス	53,100	2,165.00	114,961,500	
鴻池運輸	9,400	1,350.00	12,690,000	
西日本鉄道	86,000	692.00	59,512,000	
ハマキョウレックス	5,100	1,881.00	9,593,100	
サカイ引越センター	2,600	2,969.00	7,719,400	
近鉄グループホールディングス	671,000	459.00	307,989,000	
阪急阪神ホールディングス	447,000	712.00	318,264,000	
南海電気鉄道	150,000	655.00	98,250,000	
京阪電気鉄道	149,000	695.00	103,555,000	
神戸電鉄	16,000	352.00	5,632,000	
名古屋鉄道	243,000	485.00	117,855,000	
山陽電気鉄道	24,000	449.00	10,776,000	
日本通運	258,000	515.00	132,870,000	
ヤマトホールディングス	123,200	2,251.50	277,384,800	
山九	88,000	532.00	46,816,000	
丸運	3,600	242.00	871,200	
丸全昭和運輸	22,000	406.00	8,932,000	
センコー	30,000	738.00	22,140,000	
トナミホールディングス	14,000	313.00	4,382,000	
ニッコンホールディングス	21,800	2,008.00	43,774,400	
日本石油輸送	8,000	238.00	1,904,000	
福山通運	40,000	544.00	21,760,000	
セイノーホールディングス	47,300	1,114.00	52,692,200	
神奈川中央交通	8,000	698.00	5,584,000	
日立物流	13,900	1,846.00	25,659,400	
丸和運輸機関	1,500	2,119.00	3,178,500	
C & F ロジホールディングス	6,400	812.00	5,196,800	
日本郵船	598,000	253.00	151,294,000	
商船三井	325,000	244.00	79,300,000	
川崎汽船	292,000	212.00	61,904,000	
N S ユナイテッド海運	34,000	173.00	5,882,000	
飯野海運	35,900	402.00	14,431,800	
共栄タンカー	12,000	163.00	1,956,000	
乾汽船	5,800	830.00	4,814,000	
日本航空	127,600	4,207.00	536,813,200	
A N A ホールディングス	1,237,000	321.70	397,942,900	
パスコ	6,000	399.00	2,394,000	

トランコム	1,900	6,080.00	11,552,000	
日新	27,000	316.00	8,532,000	
三菱倉庫	47,000	1,424.00	66,928,000	
三井倉庫ホールディングス	39,000	292.00	11,388,000	
住友倉庫	49,000	553.00	27,097,000	
澁澤倉庫	17,000	280.00	4,760,000	
東陽倉庫	11,000	235.00	2,585,000	
日本トランスシティ	15,000	399.00	5,985,000	
ケイヒン	12,000	150.00	1,800,000	
中央倉庫	3,800	926.00	3,518,800	
安田倉庫	5,200	813.00	4,227,600	
東洋埠頭	19,000	162.00	3,078,000	
宇徳	5,400	370.00	1,998,000	
上組	80,000	974.00	77,920,000	
サンリツ	1,600	502.00	803,200	
キムラユニティー	1,700	1,145.00	1,946,500	
キューソー流通システム	1,800	2,501.00	4,501,800	
郵船ロジスティクス	6,100	1,400.00	8,540,000	
近鉄エクスプレス	11,900	1,783.00	21,217,700	
東海運	3,600	273.00	982,800	
エーアイテイー	3,100	1,000.00	3,100,000	
内外トランスライン	1,700	971.00	1,650,700	
N E C ネットズエスアイ	8,200	1,894.00	15,530,800	
システナ	6,400	1,432.00	9,164,800	
デジタルアーツ	3,200	2,149.00	6,876,800	
新日鉄住金ソリューションズ	11,000	2,433.00	26,763,000	
キューブシステム	2,900	542.00	1,571,800	
コア	2,800	1,392.00	3,897,600	
ソフトクリエイイトホールディングス	2,400	896.00	2,150,400	
I T ホールディングス	21,800	2,416.00	52,668,800	
ネオス	2,000	468.00	936,000	
電算システム	2,300	1,501.00	3,452,300	
グリー	39,900	476.00	18,992,400	
コーエーテクモホールディングス	15,600	1,526.00	23,805,600	
三菱総合研究所	2,600	3,490.00	9,074,000	
ボルテージ	1,200	936.00	1,123,200	
電算	700	2,240.00	1,568,000	
A G S	1,100	910.00	1,001,000	
ファインデックス	4,300	806.00	3,465,800	
ヒト・コミュニケーションズ	700	2,812.00	1,968,400	
ブレインパッド	1,000	636.00	636,000	
K L a b	10,200	660.00	6,732,000	

ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	4,300	1,059.00	4,553,700	
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	621.00	931,500	
ネクソン	62,900	1,728.00	108,691,200	
アイスタイル	5,600	1,582.00	8,859,200	
エムアップ	1,700	535.00	909,500	
エイチーム	2,400	1,517.00	3,640,800	
テクノスジャパン	700	2,622.00	1,835,400	
e n i s h	1,900	474.00	900,600	
コロプラ	18,100	1,946.00	35,222,600	
モバイルクリエイト	3,900	458.00	1,786,200	
ブロードリーフ	6,800	989.00	6,725,200	
ハーツユナイテッドグループ	2,000	2,021.00	4,042,000	
ブイキューブ	3,200	809.00	2,588,800	
サイバーリンクス	800	1,010.00	808,000	
VOYAGE GROUP	1,500	1,275.00	1,912,500	
オプティム	400	3,905.00	1,562,000	
ベリサーブ	800	1,701.00	1,360,800	
ティーガイア	6,600	1,195.00	7,887,000	
日本アジアグループ	5,600	534.00	2,990,400	
豆蔵ホールディングス	5,200	610.00	3,172,000	
テクマトリックス	2,800	1,394.00	3,903,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	115,000	293.00	33,695,000	
GMOペイメントゲートウェイ	5,700	5,730.00	32,661,000	
ザッパラス	3,700	415.00	1,535,500	
インターネットイニシアティブ	10,600	2,086.00	22,111,600	
さくらインターネット	3,200	1,345.00	4,304,000	
GMOクラウド	1,500	655.00	982,500	
SRAホールディングス	3,800	2,444.00	9,287,200	
朝日ネット	6,000	496.00	2,976,000	
コムチュア	1,100	1,986.00	2,184,600	
g u m i	6,800	632.00	4,297,600	
パイプドHD	800	1,164.00	931,200	
フェイス	1,700	1,163.00	1,977,100	
ハイマックス	900	1,057.00	951,300	
野村総合研究所	46,100	4,050.00	186,705,000	
サイバネットシステム	5,400	540.00	2,916,000	
C Eホールディングス	1,000	940.00	940,000	
インテージホールディングス	3,400	1,482.00	5,038,800	
東邦システムサイエンス	2,000	628.00	1,256,000	
ソースネクスト	3,300	452.00	1,491,600	
ティー・ワイ・オー	9,100	183.00	1,665,300	
クレスコ	1,500	1,748.00	2,622,000	

フジ・メディア・ホールディングス	68,500	1,272.00	87,132,000	
オービック	22,700	5,830.00	132,341,000	
ジャストシステム	12,000	786.00	9,432,000	
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,400	1,239.00	1,734,600	
ヤフー	471,600	426.00	200,901,600	
トレンドマイクロ	31,900	4,655.00	148,494,500	
インフォメーション・ディベロプメント	1,300	861.00	1,119,300	
日本オラクル	10,500	5,160.00	54,180,000	
アルファシステムズ	2,200	1,668.00	3,669,600	
フューチャーアーキテクト	7,900	700.00	5,530,000	
CAC Holdings	4,900	837.00	4,101,300	
ソフトバンク・テクノロジー	1,800	1,111.00	1,999,800	
トーセ	1,800	670.00	1,206,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,300	6,260.00	20,658,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	14,900	2,148.00	32,005,200	
アイティフォー	8,500	516.00	4,386,000	
東計電算	1,200	2,076.00	2,491,200	
エクスネット	600	1,496.00	897,600	
大塚商会	17,700	5,740.00	101,598,000	
サイボウズ	8,800	291.00	2,560,800	
ソフトブレーン	9,700	149.00	1,445,300	
電通国際情報サービス	4,100	2,075.00	8,507,500	
EMシステムズ	1,100	2,393.00	2,632,300	
ウェザーニューズ	2,000	3,620.00	7,240,000	
C I J	6,000	429.00	2,574,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,333.00	933,100	
日本エンタープライズ	5,900	183.00	1,079,700	
WOWOW	3,100	2,572.00	7,973,200	
フュージョンパートナー	3,700	490.00	1,813,000	
日本コロムビア	2,200	402.00	884,400	
イマジカ・ロボット ホールディングス	5,600	387.00	2,167,200	
ネットワンシステムズ	28,500	650.00	18,525,000	
アルゴグラフィックス	3,000	1,654.00	4,962,000	
マーベラス	11,100	750.00	8,325,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	12,100	1,181.00	14,290,100	
日本ユニシス	18,200	1,225.00	22,295,000	
兼松エレクトロニクス	4,200	1,928.00	8,097,600	
東京放送ホールディングス	39,400	1,677.00	66,073,800	
日本テレビホールディングス	60,100	1,980.00	118,998,000	
朝日放送	6,500	718.00	4,667,000	
テレビ朝日ホールディングス	18,000	1,825.00	32,850,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	49,900	606.00	30,239,400	

テレビ東京ホールディングス	6,000	2,010.00	12,060,000	
日本BS放送	1,100	1,120.00	1,232,000	
コネクシオ	5,800	979.00	5,678,200	
日本通信	35,000	203.00	7,105,000	
クロップス	1,200	512.00	614,400	
日本電信電話	508,500	4,602.00	2,340,117,000	
KDDI	668,400	2,765.00	1,848,126,000	
光通信	7,900	7,650.00	60,435,000	
NTTドコモ	507,400	2,330.50	1,182,495,700	
エムティーアイ	8,400	649.00	5,451,600	
GMOインターネット	24,400	1,280.00	31,232,000	
カドカワ	20,500	1,554.00	31,857,000	
学研ホールディングス	22,000	238.00	5,236,000	
ゼンリン	8,700	2,140.00	18,618,000	
昭文社	3,600	662.00	2,383,200	
インプレスホールディングス	5,400	123.00	664,200	
アイネット	3,700	1,041.00	3,851,700	
松竹	43,000	989.00	42,527,000	
東宝	46,900	2,821.00	132,304,900	
東映	24,000	1,000.00	24,000,000	
AOI Pro.	3,300	904.00	2,983,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	40,600	5,420.00	220,052,000	
ピー・シー・エー	800	1,454.00	1,163,200	
ビジネスブレイン太田昭和	1,000	991.00	991,000	
DTS	7,300	2,340.00	17,082,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	27,800	2,526.00	70,222,800	
シーイーシー	4,300	1,075.00	4,622,500	
カプコン	16,800	2,682.00	45,057,600	
アイ・エス・ビー	800	642.00	513,600	
ジャステック	4,200	849.00	3,565,800	
SCSK	15,600	4,335.00	67,626,000	
日本システムウエア	2,500	760.00	1,900,000	
アイネス	9,300	985.00	9,160,500	
TKC	6,100	2,750.00	16,775,000	
富士ソフト	9,800	2,406.00	23,578,800	
NSD	14,000	1,542.00	21,588,000	
コナミホールディングス	29,700	2,541.00	75,467,700	
福井コンピュータホールディングス	1,400	1,096.00	1,534,400	
JBCCHホールディングス	5,500	687.00	3,778,500	
ミロク情報サービス	4,900	818.00	4,008,200	
ソフトバンクグループ	372,800	4,692.00	1,749,177,600	
ハウスイ	5,000	116.00	580,000	

高千穂交易	2,500	954.00	2,385,000	
伊藤忠食品	1,600	4,025.00	6,440,000	
エレマテック	3,100	2,428.00	7,526,800	
J A L U X	2,100	2,049.00	4,302,900	
あらた	3,000	2,103.00	6,309,000	
トーメンデバイス	1,000	1,853.00	1,853,000	
東京エレクトロン デバイス	2,400	1,493.00	3,583,200	
フィールズ	4,300	1,906.00	8,195,800	
双日	414,500	226.00	93,677,000	
アルフレッサ ホールディングス	82,700	2,072.00	171,354,400	
横浜冷凍	16,300	988.00	16,104,400	
神栄	9,000	116.00	1,044,000	
山下医科器械	500	1,594.00	797,000	
ラサ商事	3,100	555.00	1,720,500	
アルコニックス	3,700	1,381.00	5,109,700	
神戸物産	4,300	2,699.00	11,605,700	
あい ホールディングス	10,500	2,599.00	27,289,500	
ディーブイエックス	1,800	1,015.00	1,827,000	
ダイワボウホールディングス	60,000	217.00	13,020,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	11,800	1,311.00	15,469,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11,400	893.00	10,180,200	
八洲電機	5,100	532.00	2,713,200	
U K C ホールディングス	4,200	2,304.00	9,676,800	
O C H I ホールディングス	1,900	950.00	1,805,000	
T O K A I ホールディングス	31,400	538.00	16,893,200	
三洋貿易	3,600	1,227.00	4,417,200	
ウイン・パートナーズ	2,400	1,483.00	3,559,200	
ミタチ産業	1,500	711.00	1,066,500	
シップヘルスケアホールディングス	13,400	2,595.00	34,773,000	
明治電機工業	2,100	1,079.00	2,265,900	
デリカフーズ	1,400	901.00	1,261,400	
スターティア	1,300	520.00	676,000	
富士興産	2,600	414.00	1,076,400	
協栄産業	9,000	136.00	1,224,000	
小野建	5,700	1,042.00	5,939,400	
佐島電機	5,200	688.00	3,577,600	
エコートレーディング	1,500	617.00	925,500	
伯東	5,000	1,079.00	5,395,000	
コンドーテック	5,200	688.00	3,577,600	
中山福	4,100	784.00	3,214,400	
ナガイレーベン	9,500	1,789.00	16,995,500	
三菱食品	7,200	2,632.00	18,950,400	

松田産業	4,800	1,300.00	6,240,000	
メディバルホールディングス	65,800	1,816.00	119,492,800	
アドヴァン	6,700	1,023.00	6,854,100	
S P K	1,500	2,002.00	3,003,000	
萩原電気	1,700	1,950.00	3,315,000	
アズワン	5,100	4,065.00	20,731,500	
スズデン	2,100	1,047.00	2,198,700	
尾家産業	2,100	858.00	1,801,800	
シモジマ	4,500	1,002.00	4,509,000	
ドウシシャ	7,700	2,196.00	16,909,200	
小津産業	1,300	1,995.00	2,593,500	
高速	3,900	960.00	3,744,000	
たけびし	2,300	991.00	2,279,300	
黒田電気	12,300	1,973.00	24,267,900	
丸文	5,800	783.00	4,541,400	
ハピネット	6,000	1,015.00	6,090,000	
橋本総業	1,400	1,392.00	1,948,800	
エクセル	3,200	1,314.00	4,204,800	
マルカキカイ	2,100	1,331.00	2,795,100	
ガリバーインターナショナル	17,700	1,170.00	20,709,000	
日本エム・ディ・エム	5,500	692.00	3,806,000	
進和	3,900	1,383.00	5,393,700	
エスケイジャパン	1,600	434.00	694,400	
ダイトエレクトロン	3,000	638.00	1,914,000	
シークス	4,200	3,105.00	13,041,000	
田中商事	2,000	643.00	1,286,000	
オーハシテクニカ	3,700	1,223.00	4,525,100	
白銅	1,900	1,156.00	2,196,400	
伊藤忠商事	516,300	1,253.00	646,923,900	
丸紅	647,500	529.20	342,657,000	
高島	12,000	198.00	2,376,000	
長瀬産業	39,600	1,335.00	52,866,000	
蝶理	4,200	1,560.00	6,552,000	
豊田通商	73,300	2,473.00	181,270,900	
三共生興	10,000	425.00	4,250,000	
兼松	140,000	177.00	24,780,000	
ツカモトコーポレーション	12,000	114.00	1,368,000	
三井物産	595,000	1,269.50	755,352,500	
日本紙パルプ商事	34,000	316.00	10,744,000	
日立ハイテクノロジーズ	22,800	2,942.00	67,077,600	
カメイ	8,600	1,015.00	8,729,000	
東都水産	11,000	185.00	2,035,000	

ＯＵＧホールディングス	10,000	235.00	2,350,000	
スターゼン	2,400	3,130.00	7,512,000	
山善	25,300	930.00	23,529,000	
椿本興業	7,000	292.00	2,044,000	
住友商事	414,200	1,090.00	451,478,000	
内田洋行	16,000	403.00	6,448,000	
三菱商事	493,700	1,794.00	885,697,800	
第一実業	15,000	487.00	7,305,000	
キャノンマーケティングジャパン	18,800	1,652.00	31,057,600	
西華産業	22,000	260.00	5,720,000	
佐藤商事	5,900	683.00	4,029,700	
菱洋エレクトロ	7,600	1,121.00	8,519,600	
東京産業	6,600	441.00	2,910,600	
ユアサ商事	6,200	2,506.00	15,537,200	
神鋼商事	15,000	210.00	3,150,000	
小林産業	4,400	186.00	818,400	
阪和興業	66,000	448.00	29,568,000	
カナデン	6,300	863.00	5,436,900	
菱電商事	10,000	720.00	7,200,000	
フルサト工業	3,600	1,687.00	6,073,200	
岩谷産業	78,000	568.00	44,304,000	
すてきナイスグループ	28,000	156.00	4,368,000	
昭光通商	23,000	69.00	1,587,000	
ニチモウ	10,000	167.00	1,670,000	
極東貿易	9,000	208.00	1,872,000	
イワキ	10,000	197.00	1,970,000	
三愛石油	17,000	823.00	13,991,000	
稲畑産業	15,800	1,060.00	16,748,000	
G S I クレオス	18,000	107.00	1,926,000	
明和産業	6,100	363.00	2,214,300	
ワキタ	14,000	856.00	11,984,000	
東邦ホールディングス	21,100	2,603.00	54,923,300	
サンゲツ	23,700	1,904.00	45,124,800	
ミツウロコグループホールディングス	10,600	525.00	5,565,000	
シナネンホールディングス	14,000	440.00	6,160,000	
伊藤忠エネクス	17,000	784.00	13,328,000	
サンリオ	20,300	2,594.00	52,658,200	
サンワテクノス	4,200	849.00	3,565,800	
リョーサン	10,400	2,939.00	30,565,600	
新光商事	7,700	1,184.00	9,116,800	
トーヨー	3,000	2,275.00	6,825,000	
三信電気	9,100	1,069.00	9,727,900	

東陽テクニカ	9,600	980.00	9,408,000	
モスフードサービス	8,600	3,100.00	26,660,000	
加賀電子	6,000	1,449.00	8,694,000	
ソーダニッカ	6,800	480.00	3,264,000	
立花エレテック	4,900	1,130.00	5,537,000	
フォーバル	2,600	634.00	1,648,400	
PALTAC	10,500	1,922.00	20,181,000	
三谷産業	7,000	314.00	2,198,000	
ヤマタネ	31,000	164.00	5,084,000	
丸紅建材リース	6,000	195.00	1,170,000	
日鉄住金物産	43,000	353.00	15,179,000	
トラスコ中山	7,500	3,960.00	29,700,000	
オートバックスセブン	25,200	1,937.00	48,812,400	
加藤産業	10,300	2,751.00	28,335,300	
イノテック	6,100	484.00	2,952,400	
イエローハット	6,200	2,246.00	13,925,200	
JKホールディングス	6,600	460.00	3,036,000	
日伝	2,700	2,698.00	7,284,600	
北沢産業	5,500	166.00	913,000	
杉本商事	3,800	1,242.00	4,719,600	
因幡電機産業	9,200	3,370.00	31,004,000	
バイテックホールディングス	2,000	1,107.00	2,214,000	
ミスミグループ本社	73,900	1,374.00	101,538,600	
アルテック	5,600	146.00	817,600	
タキヒヨー	11,000	450.00	4,950,000	
蔵王産業	1,100	1,325.00	1,457,500	
スズケン	30,000	3,810.00	114,300,000	
ジェコス	4,500	862.00	3,879,000	
ルネサスイーストン	4,100	411.00	1,685,100	
ローソン	24,900	8,880.00	221,112,000	
サンエー	4,500	4,915.00	22,117,500	
ダイユーエイト	1,900	786.00	1,493,400	
カワチ薬品	5,100	2,049.00	10,449,900	
エービーシー・マート	8,400	6,030.00	50,652,000	
ハードオフコーポレーション	3,200	1,323.00	4,233,600	
アスクル	6,900	4,035.00	27,841,500	
ゲオホールディングス	12,500	1,694.00	21,175,000	
アダストリア	6,100	6,090.00	37,149,000	
ジーフット	4,000	802.00	3,208,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	9,000	90.00	810,000	
くらコーポレーション	3,900	4,680.00	18,252,000	
キャンドゥ	3,500	1,451.00	5,078,500	

パル	3,900	2,278.00	8,884,200	
エディオン	27,900	857.00	23,910,300	
サーラコーポレーション	5,700	560.00	3,192,000	
ワッツ	2,600	772.00	2,007,200	
ハローズ	2,000	2,589.00	5,178,000	
あみやき亭	1,300	4,385.00	5,700,500	
ひらまつ	9,300	655.00	6,091,500	
ゲンキー	1,400	2,799.00	3,918,600	
サッポロドラッグストアー	700	2,269.00	1,588,300	
大黒天物産	1,600	4,260.00	6,816,000	
ハニーズ	5,800	1,045.00	6,061,000	
ファーマライズホールディングス	1,900	508.00	965,200	
アルペン	5,900	1,854.00	10,938,600	
クオール	6,800	1,402.00	9,533,600	
ジェイアイエヌ	4,500	4,685.00	21,082,500	
ビックカメラ	34,000	1,022.00	34,748,000	
DCMホールディングス	32,400	827.00	26,794,800	
Monotaro	23,200	2,504.00	58,092,800	
東京一番フーズ	1,300	546.00	709,800	
ダイヤモンドダイニング	1,200	1,053.00	1,263,600	
きちり	1,800	600.00	1,080,000	
アークランドサービス	2,100	2,691.00	5,651,100	
J. フロント リテイリング	83,300	1,533.00	127,698,900	
ドトール・日レスホールディングス	11,500	1,923.00	22,114,500	
マツモトキヨシホールディングス	13,600	5,300.00	72,080,000	
ブロンコビリー	2,600	2,352.00	6,115,200	
スタートトゥデイ	20,500	3,345.00	68,572,500	
トレジャー・ファクトリー	2,000	1,090.00	2,180,000	
物語コーポレーション	1,900	4,735.00	8,996,500	
ココカラファイン	6,900	4,470.00	30,843,000	
三越伊勢丹ホールディングス	130,900	1,462.00	191,375,800	
ウエルシアホールディングス	5,700	5,910.00	33,687,000	
クリエイトSDホールディングス	9,700	2,374.00	23,027,800	
丸善CH I ホールディングス	7,700	335.00	2,579,500	
ミサワ	1,000	606.00	606,000	
エー・ピーカンパニー	1,200	1,302.00	1,562,400	
チムニー	1,600	2,707.00	4,331,200	
ネクステージ	1,300	597.00	776,100	
ジョイフル本田	9,600	2,267.00	21,763,200	
麒麟堂ホールディングス	2,300	944.00	2,171,200	
ホットランド	1,800	1,226.00	2,206,800	
すかいらーく	20,200	1,299.00	26,239,800	

ユニテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,800	997.00	21,734,600	
ブックオフコーポレーション	3,800	928.00	3,526,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,600	684.00	1,094,400	
あさひ	4,900	1,396.00	6,840,400	
日本調剤	1,700	4,020.00	6,834,000	
コスモス薬品	3,300	16,110.00	53,163,000	
トーエル	3,500	606.00	2,121,000	
一六堂	1,800	361.00	649,800	
セブン&アイ・ホールディングス	275,200	4,912.00	1,351,782,400	
薬王堂	900	2,847.00	2,562,300	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5,900	2,785.00	16,431,500	
ツルハホールディングス	14,100	9,500.00	133,950,000	
サンマルクホールディングス	5,200	2,963.00	15,407,600	
フェリシモ	1,900	984.00	1,869,600	
トリドール	8,100	1,899.00	15,381,900	
クスリのアオキ	5,200	5,000.00	26,000,000	
メディカルシステムネットワーク	7,800	480.00	3,744,000	
総合メディカル	3,200	3,555.00	11,376,000	
はるやま商事	2,800	740.00	2,072,000	
カッパ・クリエイト	9,200	1,167.00	10,736,400	
ライトオン	5,000	1,273.00	6,365,000	
良品計画	7,600	22,520.00	171,152,000	
三城ホールディングス	8,100	450.00	3,645,000	
アルビス	1,700	1,884.00	3,202,800	
コナカ	7,800	574.00	4,477,200	
ハウス オブ ローゼ	800	1,441.00	1,152,800	
G-7ホールディングス	2,100	1,402.00	2,944,200	
イオン北海道	4,900	527.00	2,582,300	
コジマ	9,900	249.00	2,465,100	
ヒマラヤ	2,100	999.00	2,097,900	
コーナン商事	9,500	1,608.00	15,276,000	
エコス	2,600	1,284.00	3,338,400	
マルシェ	1,700	825.00	1,402,500	
ドンキホーテホールディングス	42,600	3,705.00	157,833,000	
西松屋チェーン	13,000	948.00	12,324,000	
ゼンショーホールディングス	33,800	1,349.00	45,596,200	
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,495.00	6,279,000	
ハークスレイ	2,000	1,175.00	2,350,000	
サイゼリヤ	10,800	2,326.00	25,120,800	
V Tホールディングス	22,300	628.00	14,004,400	
魚力	2,000	1,257.00	2,514,000	

ポプラ	1,600	505.00	808,000	
ユナイテッドアローズ	9,400	5,230.00	49,162,000	
ハイデイ日高	5,000	3,540.00	17,700,000	
京都きもの友禅	4,500	833.00	3,748,500	
コロワイド	21,900	1,656.00	36,266,400	
ピーシーデポコーポレーション	5,500	817.00	4,493,500	
壺番屋	3,000	5,450.00	16,350,000	
トップカルチャー	2,800	452.00	1,265,600	
P L A N T	1,700	1,194.00	2,029,800	
スギホールディングス	11,800	6,020.00	71,036,000	
スクロール	10,000	379.00	3,790,000	
ヨンドシーホールディングス	5,000	2,471.00	12,355,000	
ファミリーマート	20,200	5,180.00	104,636,000	
木曽路	8,000	2,041.00	16,328,000	
サトレストランシシステムズ	7,700	850.00	6,545,000	
千趣会	13,000	701.00	9,113,000	
タカキュー	5,400	185.00	999,000	
ケーヨー	11,300	497.00	5,616,100	
上新電機	16,000	901.00	14,416,000	
日本瓦斯	7,500	2,311.00	17,332,500	
ベスト電器	21,200	124.00	2,628,800	
ロイヤルホールディングス	11,000	2,046.00	22,506,000	
東天紅	5,000	126.00	630,000	
いなげや	7,300	1,210.00	8,833,000	
島忠	17,000	2,628.00	44,676,000	
チヨダ	7,800	2,931.00	22,861,800	
ライフコーポレーション	4,400	2,517.00	11,074,800	
リンガーハット	5,900	2,328.00	13,735,200	
MrMax	6,300	292.00	1,839,600	
テンアライド	6,100	360.00	2,196,000	
AOKIホールディングス	15,000	1,402.00	21,030,000	
オークワ	11,000	1,006.00	11,066,000	
コメリ	10,100	2,224.00	22,462,400	
青山商事	12,600	4,280.00	53,928,000	
しまむら	7,600	12,750.00	96,900,000	
はせがわ	2,500	420.00	1,050,000	
高島屋	96,000	972.00	93,312,000	
松屋	13,900	911.00	12,662,900	
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,700	2,012.00	67,804,400	
近鉄百貨店	25,000	295.00	7,375,000	
ニッセンホールディングス	9,700	166.00	1,610,200	
パルコ	6,400	966.00	6,182,400	

丸井グループ	80,900	1,680.00	135,912,000	
アクシアル リテイリング	5,100	3,495.00	17,824,500	
イオン	270,700	1,473.00	398,741,100	
ユニーグループ・ホールディングス	63,700	712.00	45,354,400	
イズミ	13,100	3,985.00	52,203,500	
東武ストア	9,000	289.00	2,601,000	
平和堂	13,300	2,214.00	29,446,200	
フジ	7,500	2,143.00	16,072,500	
ヤオコー	7,500	4,535.00	34,012,500	
ゼビオホールディングス	8,900	2,014.00	17,924,600	
ケーズホールディングス	13,900	3,870.00	53,793,000	
O l y m p i c グループ	4,200	555.00	2,331,000	
日産東京販売ホールディングス	11,600	275.00	3,190,000	
アインホールディングス	7,900	5,360.00	42,344,000	
元気寿司	1,900	2,008.00	3,815,200	
ヤマダ電機	200,100	534.00	106,853,400	
アークランドサカモト	5,600	2,382.00	13,339,200	
ニトリホールディングス	28,400	8,820.00	250,488,000	
グルメ杵屋	5,000	991.00	4,955,000	
愛眼	5,200	232.00	1,206,400	
ケーユーホールディングス	3,400	748.00	2,543,200	
吉野家ホールディングス	24,300	1,378.00	33,485,400	
松屋フーズ	3,200	2,733.00	8,745,600	
サガミチェーン	8,800	1,204.00	10,595,200	
関西スーパーマーケット	5,400	791.00	4,271,400	
王将フードサービス	4,800	4,005.00	19,224,000	
プレナス	7,400	1,802.00	13,334,800	
ミニストップ	4,900	1,958.00	9,594,200	
アークス	12,300	2,267.00	27,884,100	
バローホールディングス	14,200	2,419.00	34,349,800	
藤久	500	1,700.00	850,000	
ベルク	3,200	3,985.00	12,752,000	
大庄	3,100	1,421.00	4,405,100	
ファーストリテイリング	13,200	35,650.00	470,580,000	
サンドラッグ	13,900	7,180.00	99,802,000	
サックスパー ホールディングス	6,200	1,667.00	10,335,400	
ヤマザワ	1,400	1,627.00	2,277,800	
やまや	1,400	1,823.00	2,552,200	
ベルーナ	16,500	570.00	9,405,000	
島根銀行	1,400	1,345.00	1,883,000	
じもとホールディングス	47,200	178.00	8,401,600	
足利ホールディングス	48,300	401.00	19,368,300	

東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,100	3,370.00	30,667,000	
九州フィナンシャルグループ	100,700	729.00	73,410,300	
ゆうちょ銀行	126,500	1,430.00	180,895,000	
新生銀行	569,000	200.00	113,800,000	
あおぞら銀行	416,000	392.00	163,072,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,279,000	621.20	3,279,314,800	
りそなホールディングス	769,700	543.70	418,485,890	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,374,000	390.60	536,684,400	
三井住友フィナンシャルグループ	526,800	3,903.00	2,056,100,400	
第四銀行	83,000	453.00	37,599,000	
北越銀行	71,000	227.00	16,117,000	
西日本シティ銀行	214,000	275.00	58,850,000	
千葉銀行	254,000	738.00	187,452,000	
横浜銀行	441,000	637.20	281,005,200	
常陽銀行	238,000	484.00	115,192,000	
群馬銀行	146,000	639.00	93,294,000	
武蔵野銀行	10,500	3,785.00	39,742,500	
千葉興業銀行	18,000	582.00	10,476,000	
筑波銀行	27,300	364.00	9,937,200	
七十七銀行	103,000	549.00	56,547,000	
青森銀行	48,000	341.00	16,368,000	
秋田銀行	44,000	351.00	15,444,000	
山形銀行	37,000	445.00	16,465,000	
岩手銀行	4,600	4,460.00	20,516,000	
東邦銀行	59,000	385.00	22,715,000	
東北銀行	33,000	148.00	4,884,000	
みちのく銀行	33,000	196.00	6,468,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	285,000	522.00	148,770,000	
静岡銀行	193,000	1,022.00	197,246,000	
十六銀行	82,000	417.00	34,194,000	
スルガ銀行	69,500	2,054.00	142,753,000	
八十二銀行	119,000	649.00	77,231,000	
山梨中央銀行	41,000	547.00	22,427,000	
大垣共立銀行	88,000	409.00	35,992,000	
福井銀行	56,000	220.00	12,320,000	
北國銀行	73,000	341.00	24,893,000	
清水銀行	2,200	2,713.00	5,968,600	
富山銀行	1,300	3,715.00	4,829,500	
滋賀銀行	62,000	529.00	32,798,000	
南都銀行	64,000	344.00	22,016,000	
百五銀行	59,000	504.00	29,736,000	
京都銀行	126,000	938.00	118,188,000	

紀陽銀行	25,800	1,468.00	37,874,400	
三重銀行	29,000	237.00	6,873,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	448,000	215.00	96,320,000	
広島銀行	194,000	575.00	111,550,000	
山陰合同銀行	39,900	859.00	34,274,100	
中国銀行	46,600	1,394.00	64,960,400	
鳥取銀行	21,000	198.00	4,158,000	
伊予銀行	70,400	991.00	69,766,400	
百十四銀行	72,000	397.00	28,584,000	
四国銀行	51,000	240.00	12,240,000	
阿波銀行	54,000	631.00	34,074,000	
大分銀行	38,000	406.00	15,428,000	
宮崎銀行	44,000	341.00	15,004,000	
佐賀銀行	40,000	246.00	9,840,000	
十八銀行	40,000	323.00	12,920,000	
沖縄銀行	5,200	4,295.00	22,334,000	
琉球銀行	13,600	1,477.00	20,087,200	
セブン銀行	246,500	459.00	113,143,500	
みずほフィナンシャルグループ	9,267,700	206.10	1,910,072,970	
高知銀行	25,000	120.00	3,000,000	
山口フィナンシャルグループ	62,000	1,279.00	79,298,000	
長野銀行	22,000	190.00	4,180,000	
名古屋銀行	55,000	394.00	21,670,000	
北洋銀行	99,100	365.00	36,171,500	
愛知銀行	2,200	5,870.00	12,914,000	
第三銀行	37,000	165.00	6,105,000	
中京銀行	27,000	212.00	5,724,000	
東日本銀行	32,000	341.00	10,912,000	
大光銀行	23,000	224.00	5,152,000	
愛媛銀行	39,000	241.00	9,399,000	
トマト銀行	25,000	162.00	4,050,000	
みなと銀行	60,000	177.00	10,620,000	
京葉銀行	54,000	500.00	27,000,000	
関西アーバン銀行	9,200	1,184.00	10,892,800	
栃木銀行	35,000	586.00	20,510,000	
北日本銀行	2,000	3,095.00	6,190,000	
東和銀行	92,000	94.00	8,648,000	
福島銀行	81,000	89.00	7,209,000	
大東銀行	39,000	189.00	7,371,000	
トモニホールディングス	50,500	397.00	20,048,500	
フィデアホールディングス	40,300	231.00	9,309,300	
池田泉州ホールディングス	69,800	460.00	32,108,000	

F P G	20,000	783.00	15,660,000	
S B I ホールディングス	79,200	1,068.00	84,585,600	
ジャフコ	11,100	3,615.00	40,126,500	
大和証券グループ本社	616,000	657.80	405,204,800	
野村ホールディングス	1,266,000	587.30	743,521,800	
岡三証券グループ	56,000	597.00	33,432,000	
丸三証券	19,600	1,118.00	21,912,800	
東洋証券	25,000	323.00	8,075,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	75,600	611.00	46,191,600	
光世証券	16,000	137.00	2,192,000	
水戸証券	20,500	351.00	7,195,500	
いちよし証券	14,800	1,002.00	14,829,600	
松井証券	33,500	980.00	32,830,000	
だいこう証券ビジネス	3,200	864.00	2,764,800	
マネックスグループ	77,600	269.00	20,874,400	
カブドットコム証券	58,400	319.00	18,629,600	
極東証券	8,800	1,306.00	11,492,800	
岩井コスモホールディングス	6,200	1,217.00	7,545,400	
藍澤證券	9,300	612.00	5,691,600	
マネースクウェアHD	2,400	1,251.00	3,002,400	
マネーパートナーズグループ	6,600	412.00	2,719,200	
かんぽ生命保険	20,100	2,645.00	53,164,500	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	146,200	3,308.00	483,629,600	
アニコム ホールディングス	4,400	2,791.00	12,280,400	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	196,600	2,946.50	579,281,900	
ソニーフィナンシャルホールディングス	63,000	1,854.00	116,802,000	
第一生命保険	421,600	1,645.50	693,742,800	
東京海上ホールディングス	266,600	3,929.00	1,047,471,400	
T & D ホールディングス	239,800	1,337.50	320,732,500	
全国保証	17,100	3,490.00	59,679,000	
クレディセゾン	49,900	2,010.00	100,299,000	
アクリーティブ	5,400	364.00	1,965,600	
芙蓉総合リース	7,500	5,250.00	39,375,000	
興銀リース	12,400	2,174.00	26,957,600	
東京センチュリーリース	15,400	3,795.00	58,443,000	
日本証券金融	29,000	537.00	15,573,000	
アイフル	110,100	328.00	36,112,800	
ポケットカード	6,600	471.00	3,108,600	
リコーリース	5,200	3,310.00	17,212,000	
イオンフィナンシャルサービス	43,200	2,300.00	99,360,000	
アコム	132,200	477.00	63,059,400	
ジャックス	36,000	366.00	13,176,000	

オリエントコーポレーション	284,500	202.00	57,469,000	
日立キャピタル	15,500	2,708.00	41,974,000	
アプラスフィナンシャル	31,500	96.00	3,024,000	
オリックス	465,900	1,531.00	713,292,900	
三菱UFJリース	166,900	541.00	90,292,900	
日本取引所グループ	193,200	1,593.00	307,767,600	
イー・ギャランティ	2,100	2,237.00	4,697,700	
アサックス	1,100	1,432.00	1,575,200	
NECキャピタルソリューション	2,700	1,503.00	4,058,100	
いちごグループホールディングス	54,600	363.00	19,819,800	
日本駐車場開発	72,100	117.00	8,435,700	
ヒューリック	137,200	898.00	123,205,600	
三栄建築設計	2,700	1,073.00	2,897,100	
野村不動産ホールディングス	43,600	1,925.00	83,930,000	
三重交通グループホールディングス	11,700	447.00	5,229,900	
サムティ	3,500	952.00	3,332,000	
ディア・ライフ	3,400	317.00	1,077,800	
エー・ディー・ワークス	45,800	40.00	1,832,000	
日本商業開発	2,200	1,459.00	3,209,800	
プレサンスコーポレーション	2,200	3,555.00	7,821,000	
ユニゾホールディングス	4,100	3,900.00	15,990,000	
日本管理センター	4,300	1,191.00	5,121,300	
サンセイランディック	1,500	777.00	1,165,500	
エストラスト	1,200	617.00	740,400	
フージャースホールディングス	9,200	478.00	4,397,600	
オープンハウス	9,500	1,839.00	17,470,500	
東急不動産ホールディングス	159,200	657.00	104,594,400	
飯田グループホールディングス	61,000	1,853.00	113,033,000	
パーク24	33,100	2,890.00	95,659,000	
パラカ	2,300	1,307.00	3,006,100	
三井不動産	349,000	2,555.00	891,695,000	
三菱地所	489,000	2,124.00	1,038,636,000	
平和不動産	12,500	1,098.00	13,725,000	
東京建物	71,900	1,118.00	80,384,200	
ダイビル	17,000	872.00	14,824,000	
京阪神ビルディング	10,900	602.00	6,561,800	
住友不動産	158,000	2,904.00	458,832,000	
大京	122,000	178.00	21,716,000	
テーオーシー	25,500	858.00	21,879,000	
東京楽天地	11,000	498.00	5,478,000	
レオパレス21	77,500	565.00	43,787,500	
スターツコーポレーション	7,600	2,099.00	15,952,400	

フジ住宅	8,400	694.00	5,829,600	
空港施設	8,000	522.00	4,176,000	
明和地所	3,700	461.00	1,705,700	
住友不動産販売	4,700	2,362.00	11,101,400	
ゴールドクレスト	5,200	1,876.00	9,755,200	
日本エスリード	2,600	1,050.00	2,730,000	
日神不動産	8,800	360.00	3,168,000	
タカラレーベン	29,200	544.00	15,884,800	
サンヨーハウジング名古屋	3,700	978.00	3,618,600	
イオンモール	42,500	1,696.00	72,080,000	
ファースト住建	2,500	1,270.00	3,175,000	
トーセイ	10,000	664.00	6,640,000	
穴吹興産	6,000	238.00	1,428,000	
エス・ティ・ティ都市開発	40,900	1,057.00	43,231,300	
サンフロンティア不動産	8,000	859.00	6,872,000	
エフ・ジェー・ネクスト	5,800	463.00	2,685,400	
ランドビジネス	4,400	317.00	1,394,800	
グランディハウス	5,800	349.00	2,024,200	
日本空港ビルデング	21,000	4,405.00	92,505,000	
日本工営	23,000	378.00	8,694,000	
ネクスト	20,000	1,077.00	21,540,000	
ジェイエシーリクルートメント	3,300	877.00	2,894,100	
日本M&Aセンター	10,800	5,070.00	54,756,000	
ノバレーゼ	1,900	834.00	1,584,600	
アコーディア・ゴルフ	19,400	1,044.00	20,253,600	
タケエイ	6,300	867.00	5,462,100	
トラスト・テック	1,200	2,302.00	2,762,400	
パソナグループ	5,600	683.00	3,824,800	
C D S	1,600	852.00	1,363,200	
リンクアンドモチベーション	15,100	109.00	1,645,900	
G C Aサヴィアン	6,300	966.00	6,085,800	
エス・エム・エス	8,700	2,203.00	19,166,100	
テンプホールディングス	48,800	1,590.00	77,592,000	
リニカル	4,400	1,303.00	5,733,200	
クックパッド	15,500	1,683.00	26,086,500	
エスクリ	3,600	919.00	3,308,400	
アイ・ケイ・ケイ	3,900	580.00	2,262,000	
学情	2,600	980.00	2,548,000	
スタジオアリス	3,200	1,890.00	6,048,000	
シミックホールディングス	3,200	1,341.00	4,291,200	
N J S	1,400	1,299.00	1,818,600	
総合警備保障	23,200	5,030.00	116,696,000	

カカコム	50,500	2,040.00	103,020,000	
アイロムグループ	2,000	819.00	1,638,000	
ルネサンス	3,800	1,186.00	4,506,800	
ディップ	7,800	2,438.00	19,016,400	
オプトホールディング	4,500	588.00	2,646,000	
ツクイ	8,500	1,152.00	9,792,000	
キャリアデザインセンター	2,200	1,081.00	2,378,200	
エムスリー	60,300	2,137.00	128,861,100	
ツカダ・グローバルホールディング	5,200	686.00	3,567,200	
アウトソーシング	3,400	2,725.00	9,265,000	
ウェルネット	2,500	2,484.00	6,210,000	
ディー・エヌ・エー	31,200	1,601.00	49,951,200	
博報堂DYホールディングス	96,500	1,175.00	113,387,500	
ぐるなび	8,100	2,202.00	17,836,200	
エスアールジータカミヤ	6,700	379.00	2,539,300	
一休	4,700	3,415.00	16,050,500	
ファンコミュニケーションズ	16,100	668.00	10,754,800	
ジェイコムホールディングス	2,100	1,465.00	3,076,500	
WDBホールディングス	2,500	915.00	2,287,500	
ティア	3,100	645.00	1,999,500	
バリューコマース	6,500	416.00	2,704,000	
インフォマート	10,100	983.00	9,928,300	
J Pホールディングス	17,700	284.00	5,026,800	
E P Sホールディングス	7,800	1,215.00	9,477,000	
レッグス	1,100	594.00	653,400	
プレステージ・インターナショナル	5,900	1,109.00	6,543,100	
アミューズ	1,900	4,495.00	8,540,500	
ドリームインキュベータ	2,500	2,000.00	5,000,000	
クイック	3,600	828.00	2,980,800	
T A C	7,100	199.00	1,412,900	
ケネディクス	94,400	377.00	35,588,800	
電通	77,600	5,930.00	460,168,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,100	613.00	2,513,300	
ぴあ	2,100	2,150.00	4,515,000	
イオンファンタジー	2,500	2,086.00	5,215,000	
シーティーエス	1,800	703.00	1,265,400	
ネクシィーズ	3,100	633.00	1,962,300	
みらかホールディングス	17,800	4,955.00	88,199,000	
アルプス技研	2,600	2,024.00	5,262,400	
ダイオーズ	1,300	1,062.00	1,380,600	
日本空調サービス	3,400	1,101.00	3,743,400	
オリエンタルランド	75,300	6,996.00	526,798,800	

ダスキン	19,700	1,920.00	37,824,000	
明光ネットワークジャパン	8,100	1,020.00	8,262,000	
ファルコホールディングス	3,100	1,302.00	4,036,200	
ラウンドワン	21,900	555.00	12,154,500	
リゾートトラスト	29,200	2,833.00	82,723,600	
ビー・エム・エル	4,100	3,265.00	13,386,500	
ワタベウェディング	2,700	411.00	1,109,700	
りらいあコミュニケーションズ	11,500	979.00	11,258,500	
早稲田アカデミー	1,000	807.00	807,000	
ユー・エス・エス	84,300	1,639.00	138,167,700	
東京個別指導学院	3,400	615.00	2,091,000	
サイバーエージェント	17,000	4,290.00	72,930,000	
楽天	325,700	1,123.50	365,923,950	
テー・オー・ダブリュー	4,200	543.00	2,280,600	
セントラルスポーツ	2,400	2,218.00	5,323,200	
フルキャストホールディングス	6,700	565.00	3,785,500	
リゾートソリューション	9,000	292.00	2,628,000	
テクノプロ・ホールディングス	9,900	3,155.00	31,234,500	
リブセンス	6,000	275.00	1,650,000	
ジャパンマテリアル	2,900	2,105.00	6,104,500	
ベクトル	2,200	1,998.00	4,395,600	
ウチヤマホールディングス	4,400	461.00	2,028,400	
サクセスホールディングス	1,100	1,299.00	1,428,900	
キャリアリンク	1,200	1,431.00	1,717,200	
I B J	4,800	397.00	1,905,600	
アサンテ	2,600	1,398.00	3,634,800	
N・フィールド	2,600	954.00	2,480,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	800	1,557.00	1,245,600	
ライドオン・エクスプレス	1,300	2,075.00	2,697,500	
E R I ホールディングス	1,800	794.00	1,429,200	
アビスト	1,000	1,989.00	1,989,000	
ウィルグループ	2,000	730.00	1,460,000	
日本ビューホテル	1,000	1,651.00	1,651,000	
リクルートホールディングス	140,400	3,425.00	480,870,000	
エラン	900	1,286.00	1,157,400	
日本郵政	153,600	1,546.00	237,465,600	
ベルシステム24ホールディングス	10,500	1,229.00	12,904,500	
リロ・ホールディング	2,600	13,170.00	34,242,000	
東祥	2,100	3,225.00	6,772,500	
エイチ・アイ・エス	11,400	3,535.00	40,299,000	
ラックランド	1,200	1,413.00	1,695,600	
共立メンテナンス	5,200	8,180.00	42,536,000	

イチネンホールディングス	7,700	994.00	7,653,800	
建設技術研究所	4,100	1,004.00	4,116,400	
スペース	3,800	1,171.00	4,449,800	
燦ホールディングス	1,400	1,420.00	1,988,000	
スバル興業	5,000	417.00	2,085,000	
東京テアトル	27,000	125.00	3,375,000	
よみうりランド	15,000	388.00	5,820,000	
東京都競馬	48,000	242.00	11,616,000	
カナモト	9,800	2,517.00	24,666,600	
東京ドーム	56,000	585.00	32,760,000	
西尾レントオール	5,600	2,716.00	15,209,600	
トランス・コスモス	8,100	2,736.00	22,161,600	
乃村工藝社	14,900	1,447.00	21,560,300	
藤田観光	26,000	480.00	12,480,000	
KNT－CTホールディングス	34,000	198.00	6,732,000	
日本管財	6,000	1,703.00	10,218,000	
トーカイ	3,100	3,055.00	9,470,500	
白洋舎	9,000	256.00	2,304,000	
セコム	72,400	7,509.00	543,651,600	
セントラル警備保障	3,100	1,706.00	5,288,600	
丹青社	13,100	724.00	9,484,400	
メイテック	8,700	3,795.00	33,016,500	
アサツー ディ・ケイ	12,200	2,442.00	29,792,400	
応用地質	7,300	1,117.00	8,154,100	
船井総研ホールディングス	9,600	1,454.00	13,958,400	
進学会	3,400	590.00	2,006,000	
オオバ	4,400	382.00	1,680,800	
学究社	1,000	1,195.00	1,195,000	
ベネッセホールディングス	23,300	3,130.00	72,929,000	
イオンディライト	6,700	3,650.00	24,455,000	
ナック	4,300	839.00	3,607,700	
ニチイ学館	12,400	779.00	9,659,600	
ダイセキ	13,100	1,673.00	21,916,300	
ステップ	2,400	1,007.00	2,416,800	
合 計	109,696,700		131,910,970,400	

(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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	262,533,790
コール・ローン	1,972,920,388
国債証券	213,728,040,986
派生商品評価勘定	17,164,525
未収入金	182,875
未収利息	1,901,318,416
前払費用	102,608,649
差入委託証拠金	81,848,979
流動資産合計	218,066,618,608
資産合計	218,066,618,608
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,206,423
前受金	13,386,547
未払金	196,665
未払解約金	208,380,583
流動負債合計	229,170,218
負債合計	229,170,218
純資産の部	
元本等	
元本	79,917,600,176
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	137,919,848,214
元本等合計	217,837,448,390
純資産合計	217,837,448,390
負債純資産合計	218,066,618,608

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 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。

	平成28年 1月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)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、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。 (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。 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。
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)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成28年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,917,600,176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 2.7258円 (1万口当たり純資産額) (27,258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 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月20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 1月20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。 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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年 1月21日
期首元本額	87,062,303,721円
期中追加設定元本額	39,167,035,496円
期中一部解約元本額	46,311,739,041円
期末元本額	79,917,600,176円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,945,503,535円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	165,705,272円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,138,052,009円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	740,546,081円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,502,326,773円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,013,013円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,090,239,807円
世界経済インデックスファンド	1,759,161,993円
マイセクション25	5,972,936円
マイセクション50	4,711,323円

区分	平成28年 1月20日現在
マイセレクション75	3,329,427円
DCマイセレクション25	1,154,993,498円
DCマイセレクション50	1,007,018,105円
DCマイセレクション75	686,709,234円
DC外国債券インデックス・オープン	1,417,589,006円
DCマイセレクションS25	465,569,743円
DCマイセレクションS50	383,998,649円
DCマイセレクションS75	180,816,384円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	50,010,926円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	36,989,082円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	14,703,252円
DC世界経済インデックスファンド	1,721,418,028円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	449,817,743円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	175,399,483円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,337,517円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,516,401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）	113,211,681円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	336,756,133円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	487,747,075円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	843,797,416円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	814,799,318円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,962,698,003円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	913,689,308円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,177,891,659円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,293,587,001円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,567,941,746円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	971,396,170円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,113,446,325円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	330,093,122円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	464,517,745円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,760,530,776円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,472,154,698円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	577,998,745円
外国債券ファンド・シリーズ1	482,154,434円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,962,088,251円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,554,783,824円
分散投資コア戦略ファンドA	492,985,294円
分散投資コア戦略ファンドS	1,122,343,079円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	41,860,789円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	589,315,190円
コア投資戦略ファンド（切替型）	565,741,836円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	137,689,680円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	84,442,436円

区分	平成28年 1月20日現在
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）	286,502,617円
SMT インデックスバランス・オープン	163,002,461円
外国債券SMT Bセレクション（SMA専用）	22,268,184,818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）	836,799,326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 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△26,937,731
合計	△26,937,731

(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 1月20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	1,202,069,262	—	1,215,455,809	13,386,547
合計		1,202,069,262	—	1,215,455,809	13,386,547

(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 1月20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	1,741,950,745	—	1,738,522,300	△3,428,445
	アメリカドル	790,698,175	—	788,357,900	△2,340,275
	カナダドル	66,949,055	—	65,269,800	△1,679,255
	ユーロ	739,602,690	—	743,378,100	3,775,410

	イギリスポンド	144,700,825	—	141,516,500	△3,184,325
合計		1,741,950,745	—	1,738,522,300	△3,428,445

(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。

- ①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。
- ②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 03/31/17	1,000,000.00	997,265.63	
		T 0.5% 07/31/17	2,000,000.00	1,990,156.26	
		T 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,920,312.50	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	6,975,390.66	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	995,996.09	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,975,488.30	
		T 0.75% 01/15/17	12,000,000.00	12,009,609.36	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,382,640.63	
		T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	2,985,351.57	
		T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	5,994,609.36	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,891,617.20	
		T 0.875% 01/31/17	10,000,000.00	10,019,531.30	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,495,165.99	
		T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,007,519.55	
		T 0.875% 04/30/17	11,600,000.00	11,615,406.30	
		T 0.875% 06/15/17	5,000,000.00	5,004,980.45	
		T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	4,003,281.24	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,429,316.42	
		T 0.875% 08/15/17	8,800,000.00	8,804,125.00	
		T 0.875% 10/15/17	6,200,000.00	6,200,363.25	
		T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	3,979,453.12	
		T 0.875% 11/15/17	1,500,000.00	1,499,677.74	

T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,979,062.50	
T 1.125% 06/15/18	3,000,000.00	3,008,964.84	
T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	3,025,933.60	
T 1.25% 01/31/19	900,000.00	903,164.06	
T 1.25% 01/31/20	8,520,000.00	8,488,050.00	
T 1.25% 02/29/20	7,000,000.00	6,968,554.67	
T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,529,707.01	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,492,158.21	
T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,579,935.53	
T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	5,005,468.75	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,114,478.51	
T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,879,809.38	
T 1.375% 04/30/20	10,000,000.00	9,994,726.60	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,547,457.03	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,220,066.39	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,932,220.70	
T 1.375% 09/30/20	1,500,000.00	1,494,638.67	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,974,804.68	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,022,734.39	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,021,718.76	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,449,111.34	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,021,484.38	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,445,289.06	
T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,076,562.48	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,869,667.97	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,576,000.98	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,036,035.15	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,042,890.64	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,070,117.20	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	3,026,777.34	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	5,042,968.75	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,462,470.72	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,596,826.20	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,072,774.42	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,505,664.07	
T 1.75% 03/31/22	7,000,000.00	7,008,476.58	
T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,752,470.71	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,803,042.96	
T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	6,950,917.96	
T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	1,994,648.44	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,047,187.52	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,301,867.16	

T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,027,140.62	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,023,203.12	
T 1.875% 09/30/17	850,000.00	864,127.92	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,542,626.95	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,464,757.82	
T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,804,210.94	
T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,404,402.34	
T 1% 05/15/18	5,550,000.00	5,551,192.36	
T 1% 05/31/18	5,000,000.00	4,999,609.40	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,934,082.02	
T 1% 09/15/18	5,200,000.00	5,193,093.77	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,960,078.12	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,224,818.38	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,087,949.23	
T 2.125% 05/15/25	9,450,000.00	9,517,552.75	
T 2.125% 06/30/21	1,000,000.00	1,027,812.50	
T 2.125% 06/30/22	3,500,000.00	3,577,724.60	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,267,869.13	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,690,810.55	
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,052,617.18	
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,614,169.90	
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,155,796.87	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,620,654.31	
T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,465,417.97	
T 2.25% 11/15/24	8,150,000.00	8,310,293.95	
T 2.25% 11/30/17	5,000,000.00	5,123,535.15	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,129,062.52	
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,758,320.35	
T 2.5% 02/15/45	10,580,000.00	9,884,860.99	
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,745,843.79	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,756,260.73	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,185,253.90	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,785,097.67	
T 2.625% 11/15/20	2,000,000.00	2,103,398.44	
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,825,417.98	
T 2.75% 02/15/24	9,100,000.00	9,656,664.10	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,942,351.57	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,209,375.04	
T 2.75% 08/15/42	2,000,000.00	1,986,445.32	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,332,867.22	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,162,101.55	
T 2.75% 12/31/17	9,100,000.00	9,420,277.32	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,060,722.66	

T 2.875% 05/15/43	10,300,000.00	10,441,222.68	
T 2.875% 08/15/45	1,500,000.00	1,514,355.46	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,546,777.35	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,632,906.24	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,380,804.65	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,090,859.36	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,881,417.96	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,326,039.05	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,042,656.25	
T 2% 08/15/25	9,500,000.00	9,456,396.51	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,935,468.78	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,119,726.55	
T 2% 10/31/21	6,200,000.00	6,316,976.57	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,444,765.61	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,627,832.04	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,586,816.41	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,065,253.91	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,694,873.05	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,315,722.65	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,716,029.27	
T 3.125% 08/15/44	6,500,000.00	6,905,107.43	
T 3.125% 11/15/41	4,800,000.00	5,141,812.51	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,584,697.27	
T 3.375% 05/15/44	4,000,000.00	4,458,515.64	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	5,998,804.71	
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,291,054.68	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,611,387.67	
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	6,056,982.41	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,840,429.70	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,923,593.75	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,338,671.88	
T 3.75% 08/15/41	3,200,000.00	3,804,250.01	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,375,000.00	
T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,750,431.63	
T 3.875% 08/15/40	2,700,000.00	3,264,468.75	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	9,738,984.37	
T 3% 05/15/42	3,950,000.00	4,124,355.48	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,623,320.33	
T 3% 11/15/44	8,200,000.00	8,495,808.60	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,553,816.39	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,149,363.27	
T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,703,298.83	

	T 4.25% 11/15/40	1,000,000.00	1,278,183.59	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,303,261.72	
	T 4.375% 05/15/40	3,000,000.00	3,901,054.68	
	T 4.375% 05/15/41	3,450,000.00	4,500,902.36	
	T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,509,630.85	
	T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,436,095.30	
	T 4.5% 05/15/17	4,800,000.00	5,034,750.00	
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,326,152.34	
	T 4.5% 08/15/39	250,000.00	330,581.05	
	T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,208,105.45	
	T 4.625% 02/15/40	1,650,000.00	2,220,796.87	
	T 4.75% 08/15/17	3,500,000.00	3,713,759.76	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,554,695.31	
	T 5.25% 02/15/29	400,000.00	536,039.06	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,736,972.65	
	T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,226,125.00	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,631,765.62	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,308,214.84	
	T 6.125% 11/15/27	350,000.00	494,532.22	
	T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,633,328.12	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,164,432.61	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,300,279.29	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,605,476.57	
アメリカドル 小計		766,620,000.00	791,790,224.15 (93,074,940,848)	
カナダドル	CAN 0.75% 09/01/20	1,700,000.00	1,721,088.50	
	CAN 1.25% 02/01/18	1,350,000.00	1,376,210.25	
	CAN 1.25% 03/01/18	1,990,000.00	2,029,879.60	
	CAN 1.25% 08/01/17	2,250,000.00	2,282,433.75	
	CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	512,267.50	
	CAN 1.5% 02/01/17	2,250,000.00	2,277,450.00	
	CAN 1.5% 03/01/17	2,900,000.00	2,938,062.50	
	CAN 1.5% 03/01/20	1,450,000.00	1,514,126.25	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,650,000.00	1,716,107.25	
	CAN 1.5% 06/01/26	480,000.00	488,899.20	
	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,681,680.00	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,461,194.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	850,000.00	891,429.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,697,405.00	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,700,000.00	1,897,336.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,550,000.00	1,738,309.50	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,100,000.00	1,292,236.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	522,627.00	

	CAN 3.25% 06/01/21	1,940,000.00	2,209,252.60	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,350,000.00	1,528,800.75	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,740,000.00	2,328,946.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,300,000.00	2,560,003.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,970,000.00	2,752,917.40	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,100,000.00	2,294,701.50	
	CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,470,056.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,550,000.00	2,324,829.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,560,000.00	2,471,625.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,690,000.00	2,584,939.50	
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	609,597.00	
	カナダドル 小計	44,700,000.00	51,174,410.55 (4,125,680,978)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	12,000,000.00	16,074,960.00	
	MBONO 10% 12/05/24	16,900,000.00	21,530,769.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	21,150,000.00	21,343,628.25	
	MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,156,103.00	
	MBONO 5% 12/11/19	12,300,000.00	12,286,285.50	
	MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	12,318,374.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	24,000,000.00	25,187,280.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	16,055,560.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,550,000.00	24,764,184.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	9,800,000.00	10,699,444.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	25,700,000.00	27,508,252.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	18,286,164.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	19,434,937.50	
	MBONO 8.5% 12/13/18	14,400,000.00	15,916,104.00	
	MBONO 8% 06/11/20	14,500,000.00	16,109,645.00	
	MBONO 8% 12/07/23	26,450,000.00	29,854,644.00	
	メキシコペソ 小計	280,150,000.00	309,526,335.25 (1,990,254,335)	
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,570,000.00	1,564,756.20	
	BGB 1.25% 06/22/18	980,000.00	1,017,171.40	
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	518,529.75	
	BGB 1% 06/22/31	580,000.00	540,713.70	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,695,937.50	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,290,000.00	2,656,583.20	
	BGB 3.5% 06/28/17	1,520,000.00	1,604,709.60	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,010,000.00	1,428,953.05	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,944,887.50	
	BGB 3% 06/22/34	1,000,000.00	1,219,915.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,230,000.00	1,374,174.45	

BGB 4.0% 03/28/17	450,000.00	473,456.25	
BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,930,860.00	
BGB 4.25% 03/28/41	1,890,000.00	2,832,013.80	
BGB 4.25% 09/28/21	2,300,000.00	2,837,797.50	
BGB 4.25% 09/28/22	2,400,000.00	3,027,000.00	
BGB 4.5% 03/28/26	1,550,000.00	2,093,422.25	
BGB 4% 03/28/18	1,660,000.00	1,818,123.30	
BGB 4% 03/28/22	1,110,000.00	1,368,519.00	
BGB 4% 03/28/32	1,100,000.00	1,496,187.00	
BGB 5.5% 03/28/28	1,850,000.00	2,765,703.75	
BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,088,679.50	
BGB 5% 03/28/35	2,020,000.00	3,147,543.80	
BTNS 1% 07/25/17	3,600,000.00	3,674,052.00	
BTPS 0.25% 05/15/18	2,500,000.00	2,511,900.00	
BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,006,005.00	
BTPS 0.65% 11/01/20	1,000,000.00	1,004,555.00	
BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,637,739.00	
BTPS 1.05% 12/01/19	500,000.00	513,522.50	
BTPS 1.15% 05/15/17	800,000.00	812,356.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	3,250,000.00	3,338,221.25	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,000,000.00	1,029,250.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,600,000.00	1,607,120.00	
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,504,112.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	800,000.00	762,316.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,689,262.50	
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,686,825.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,671,970.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,650,000.00	1,862,025.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,460,000.00	2,927,424.60	
BTPS 3.5% 06/01/18	1,600,000.00	1,730,008.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,000,000.00	2,124,730.00	
BTPS 3.5% 12/01/18	3,200,000.00	3,510,464.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,700,000.00	5,435,174.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	750,000.00	869,482.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,651,780.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	3,300,000.00	3,931,488.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,271,770.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	5,800,000.00	6,715,240.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	3,027,439.50	
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,617,896.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,923,132.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	1,600,000.00	1,815,408.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,450,000.00	3,052,749.00	

BTPS 4.5% 03/01/26	2,800,000.00	3,567,060.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,533,820.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	1,800,000.00	2,001,825.00	
BTPS 4.75% 05/01/17	3,770,000.00	3,999,838.05	
BTPS 4.75% 06/01/17	1,700,000.00	1,810,364.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,596,299.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,925,168.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,644,038.75	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,800,000.00	2,571,588.00	
BTPS 4% 02/01/17	2,100,000.00	2,187,937.50	
BTPS 4% 02/01/37	3,050,000.00	3,852,943.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,550,000.00	4,116,633.25	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,450,000.00	3,546,828.25	
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,296,135.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,300,000.00	4,613,548.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,050,000.00	2,641,814.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	1,950,000.00	2,518,551.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,050,000.00	3,097,662.75	
BTPS 5% 03/01/22	2,250,000.00	2,800,946.25	
BTPS 5% 03/01/25	4,500,000.00	5,863,927.50	
BTPS 5% 08/01/34	2,500,000.00	3,538,587.50	
BTPS 5% 09/01/40	2,650,000.00	3,820,915.75	
BTPS 6.5% 11/01/27	2,000,000.00	2,995,790.00	
BTPS 6% 05/01/31	4,200,000.00	6,368,544.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,171,652.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,261,828.00	
DBR 0.5% 02/15/25	1,600,000.00	1,612,872.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	3,019,885.00	
DBR 1.5% 05/15/23	1,950,000.00	2,143,752.00	
DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,731,389.95	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,589,722.00	
DBR 1.75% 02/15/24	2,970,000.00	3,327,781.05	
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	3,000,280.50	
DBR 1% 08/15/24	1,150,000.00	1,216,010.00	
DBR 1% 08/15/25	3,000,000.00	3,146,670.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,784,187.50	
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,262,340.00	
DBR 2.5% 01/04/21	2,100,000.00	2,376,192.00	
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	2,323,251.00	
DBR 2.5% 08/15/46	1,550,000.00	2,006,955.50	
DBR 2% 01/04/22	3,150,000.00	3,529,921.50	
DBR 2% 08/15/23	1,100,000.00	1,251,332.50	

DBR 3.25% 01/04/20	4,700,000.00	5,357,671.00	
DBR 3.25% 07/04/21	2,900,000.00	3,429,192.00	
DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	2,748,996.00	
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,964,502.50	
DBR 3.75% 01/04/17	2,300,000.00	2,391,793.00	
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,656,901.75	
DBR 3% 07/04/20	2,300,000.00	2,629,820.00	
DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,879,781.50	
DBR 4.0% 01/04/37	2,850,000.00	4,330,845.75	
DBR 4.25% 07/04/17	4,100,000.00	4,378,718.00	
DBR 4.25% 07/04/18	2,400,000.00	2,674,332.00	
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	2,988,813.75	
DBR 4.75% 07/04/28	1,550,000.00	2,295,550.00	
DBR 4.75% 07/04/34	2,270,000.00	3,660,443.10	
DBR 4.75% 07/04/40	1,850,000.00	3,220,739.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,610,156.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,432,043.00	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,364,184.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,050,000.00	1,805,538.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,550,000.00	2,560,057.50	
FRTR 0.25% 11/25/20	600,000.00	606,570.00	
FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,093,887.00	
FRTR 0.5% 11/25/19	4,300,000.00	4,402,168.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	900,000.00	907,128.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	3,760,000.00	4,119,719.20	
FRTR 1.75% 11/25/24	3,200,000.00	3,492,464.00	
FRTR 1% 05/25/18	4,750,000.00	4,894,067.50	
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,378,488.75	
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,588,600.00	
FRTR 1% 11/25/25	2,000,000.00	2,025,490.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	4,991,360.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,630,704.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	4,022,095.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	6,096,724.25	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	4,843,986.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	2,050,000.00	2,664,446.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,125,418.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,050,000.00	5,818,887.75	
FRTR 3.5% 04/25/26	3,850,000.00	4,832,346.75	
FRTR 3.75% 04/25/17	5,800,000.00	6,102,064.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	4,050,000.00	4,831,731.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	3,750,000.00	4,298,943.75	
FRTR 3% 04/25/22	4,400,000.00	5,158,978.00	

FRTR 4.25% 04/25/19	4,700,000.00	5,383,309.50	
FRTR 4.25% 10/25/17	3,450,000.00	3,730,933.50	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,387,344.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,634,848.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,900,000.00	4,492,419.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,950,000.00	4,485,180.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,918,368.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	2,684,683.75	
FRTR 4% 04/25/60	1,430,000.00	2,219,166.95	
FRTR 4% 10/25/38	2,980,000.00	4,244,995.10	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,190,000.00	6,382,312.75	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,420,000.00	5,598,711.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,583,464.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,583,410.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,485,069.60	
IRISH 0.8% 03/15/22	1,370,000.00	1,410,723.25	
IRISH 2.4% 05/15/30	800,000.00	888,960.00	
IRISH 2% 02/18/45	670,000.00	659,196.25	
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,083,996.00	
IRISH 3.9% 03/20/23	650,000.00	802,828.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,267,689.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	1,950,000.00	2,318,238.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	1,004,244.85	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,939,273.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	920,000.00	1,013,200.60	
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	915,768.75	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,400,000.00	1,423,660.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,580,000.00	1,520,584.10	
NETHER 0.5% 04/15/17	500,000.00	505,582.50	
NETHER 1.25% 01/15/18	2,350,000.00	2,425,975.50	
NETHER 1.25% 01/15/19	2,100,000.00	2,197,093.50	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	2,209,210.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,900,000.00	2,154,961.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,250,000.00	2,314,777.50	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,300,000.00	1,558,934.00	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,140,000.00	1,507,610.10	
NETHER 2% 07/15/24	1,700,000.00	1,914,336.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,411,937.75	
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,267,109.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,830,000.00	2,275,431.15	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,950,000.00	2,969,304.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,250,000.00	2,493,180.00	

NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,628,605.00	
NETHER 4% 01/15/37	1,680,000.00	2,513,389.20	
NETHER 4% 07/15/19	1,800,000.00	2,066,778.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,426,236.65	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	300,874.00	
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,130,838.50	
OBL 0.25% 10/11/19	1,450,000.00	1,480,174.50	
OBL 0.25% 10/16/20	2,400,000.00	2,447,748.00	
OBL 0.5% 02/23/18	2,900,000.00	2,955,332.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,426,340.00	
OBL 0.5% 04/12/19	1,990,000.00	2,045,013.55	
OBL 0.5% 10/13/17	2,750,000.00	2,793,450.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,037,950.00	
OBL 1% 10/12/18	2,150,000.00	2,231,764.50	
RAGB 0.25% 10/18/19	950,000.00	965,409.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	600,000.00	623,475.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,080,000.00	1,176,471.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	2,050,000.00	2,257,101.25	
RAGB 1.95% 06/18/19	800,000.00	859,288.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	600,000.00	693,633.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	720,000.00	969,667.20	
RAGB 3.2% 02/20/17	700,000.00	727,184.50	
RAGB 3.4% 11/22/22	850,000.00	1,029,379.75	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,112,149.85	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,337,616.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	430,000.00	708,650.75	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,450,000.00	1,709,745.75	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,450,000.00	2,145,195.25	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,400,000.00	1,508,248.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,400,000.00	2,747,904.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,484,730.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,322,661.25	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,060,000.00	1,671,805.50	
RFGB 0.375% 09/15/20	550,000.00	560,997.25	
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	463,460.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	450,000.00	453,915.00	
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	571,100.75	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	702,871.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	643,996.80	
RFGB 2.625% 07/04/42	440,000.00	552,932.60	
RFGB 2.75% 07/04/28	640,000.00	767,462.40	
RFGB 2% 04/15/24	480,000.00	536,359.20	
RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	688,977.00	

		RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	827,631.00	
		RFGB 3.875% 09/15/17	1,170,000.00	1,252,795.05	
		RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,217,412.00	
		RFGB 4% 07/04/25	750,000.00	975,337.50	
		SPGB 0.25% 04/30/18	3,200,000.00	3,208,864.00	
		SPGB 0.5% 10/31/17	2,230,000.00	2,249,122.25	
		SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,902,228.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	2,300,000.00	2,296,745.50	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,302,351.75	
		SPGB 2.1% 04/30/17	3,000,000.00	3,080,595.00	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,450,000.00	2,548,196.00	
		SPGB 2.75% 04/30/19	3,050,000.00	3,291,987.00	
		SPGB 2.75% 10/31/24	2,750,000.00	3,010,548.75	
		SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,538,418.00	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,293,682.00	
		SPGB 4.1% 07/30/18	3,180,000.00	3,495,837.60	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,615,319.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,377,101.00	
		SPGB 4.4% 10/31/23	1,150,000.00	1,406,007.25	
		SPGB 4.5% 01/31/18	2,830,000.00	3,083,214.25	
		SPGB 4.6% 07/30/19	2,200,000.00	2,526,876.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,450,000.00	3,092,279.75	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,276,912.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,827,277.25	
		SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,570,583.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,600,000.00	2,196,864.00	
		SPGB 4% 04/30/20	3,700,000.00	4,235,649.00	
		SPGB 5.15% 10/31/28	2,700,000.00	3,621,699.00	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,400,000.00	2,015,265.00	
		SPGB 5.4% 01/31/23	2,330,000.00	2,982,306.80	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,728,475.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,467,792.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,100,000.00	3,076,363.50	
		SPGB 5.85% 01/31/22	2,800,000.00	3,600,240.00	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,332,747.20	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,500,000.00	2,163,217.50	
ユーロ 小計		565,500,000.00	672,767,030.50 (86,369,831,375)		
イギリスポ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	3,780,000.00	3,841,217.10		
	UKT 1.5% 01/22/21	250,000.00	254,095.00		
	UKT 1.75% 01/22/17	2,000,000.00	2,027,020.00		
	UKT 1.75% 07/22/19	3,550,000.00	3,660,263.00		

	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,921,136.00	
	UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	3,026,520.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	3,000,000.00	3,165,600.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	700,000.00	730,646.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	2,900,000.00	3,169,134.50	
	UKT 2% 07/22/20	3,300,000.00	3,438,484.50	
	UKT 2% 09/07/25	2,420,000.00	2,485,618.30	
	UKT 3.25% 01/22/44	3,100,000.00	3,568,301.50	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,470,000.00	2,980,277.30	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,220,000.00	2,983,158.30	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,970,000.00	2,618,868.75	
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	608,011.25	
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,981,766.75	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,350,000.00	2,679,857.75	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,550,000.00	3,314,604.75	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,430,000.00	3,117,641.40	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,670,000.00	2,205,936.40	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,690,000.00	2,124,068.05	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,100,000.00	2,797,620.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	2,915,146.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,600,000.00	2,278,512.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,800,000.00	2,685,771.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,574,217.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,770,000.00	3,689,889.30	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,300,000.00	3,215,952.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	3,150,000.00	3,643,053.75	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,300,000.00	3,085,576.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,674,335.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,550,000.00	2,251,305.25	
	UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,387,973.25	
	UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,247,978.75	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,453,061.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,843,262.50	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,702,822.50	
	UKT 8% 06/07/21	2,050,000.00	2,785,857.75	
	イギリスポンド 小計	86,070,000.00	103,134,562.15 (17,180,155,362)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	320,000.00	364,174.40	
	SWISS 2% 04/28/21	540,000.00	617,814.00	
	SWISS 3% 01/08/18	1,970,000.00	2,124,753.35	
	SWISS 4% 02/11/23	1,140,000.00	1,504,754.40	
	SWISS 4% 04/08/28	490,000.00	732,692.10	

スイスフラン 小計		4,460,000.00	5,344,188.25 (626,338,862)	
スウェーデン クロナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,600,000.00	10,260,480.00	
	SGB 1% 11/12/26	3,300,000.00	3,286,123.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,600,000.00	8,763,180.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,350,000.00	6,983,542.25	
	SGB 3.5% 06/01/22	10,210,000.00	12,221,421.05	
	SGB 3.75% 08/12/17	8,650,000.00	9,227,820.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	10,150,000.00	11,603,581.50	
	SGB 5% 12/01/20	10,150,000.00	12,570,572.00	
スウェーデンクロナ 小計		65,010,000.00	74,916,720.30 (1,032,352,405)	
ノルウェー クロネ	NGB 1.75% 03/13/25	3,050,000.00	3,145,983.50	
	NGB 2% 05/24/23	7,040,000.00	7,433,254.40	
	NGB 3.75% 05/25/21	9,350,000.00	10,713,043.00	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,284,875.50	
	NGB 4.25% 05/19/17	7,400,000.00	7,754,349.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	8,300,000.00	9,351,485.50	
ノルウェークロネ 小計		40,690,000.00	44,682,990.90 (596,071,098)	
デンマーク クロネ	DGB 1.5% 11/15/23	5,800,000.00	6,247,412.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,850,000.00	7,454,786.50	
	DGB 3% 11/15/21	10,950,000.00	12,722,367.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	14,900,000.00	24,219,652.00	
	DGB 4% 11/15/17	5,900,000.00	6,368,283.00	
	DGB 4% 11/15/19	11,650,000.00	13,471,244.50	
	DGB 7% 11/10/24	4,800,000.00	7,472,496.00	
デンマーククロネ 小計		60,850,000.00	77,956,241.00 (1,340,847,345)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	3,100,000.00	3,012,146.00	
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,100,000.00	3,167,595.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	750,000.00	697,620.00	
	POLGB 2% 04/25/21	2,100,000.00	2,051,343.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,925,286.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,260,000.00	3,296,675.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	1,800,000.00	1,888,236.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,720,000.00	2,833,600.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,150,000.00	3,383,588.25	
	POLGB 5.25% 10/25/17	4,100,000.00	4,368,468.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,530,000.00	2,869,816.95	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,932,111.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,734,474.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,422,785.95	

	POLGB 5.75% 10/25/21	1,500,000.00	1,757,827.50	
ポーランドズロチ 小計		37,800,000.00	40,341,573.95 (1,163,854,408)	
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	1,100,000.00	1,081,195.50	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	2,975,294.70	
	ACGB 2.75% 06/21/35	650,000.00	603,811.00	
	ACGB 2.75% 10/21/19	1,090,000.00	1,119,811.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,550,000.00	2,673,764.25	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,736,532.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	610,000.00	604,183.65	
	ACGB 3.25% 10/21/18	2,050,000.00	2,122,242.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	900,000.00	967,234.50	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,600,000.00	2,954,614.00	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,800,000.00	1,861,155.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,600,000.00	2,860,013.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,300,000.00	1,539,973.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,210,000.00	2,626,750.75	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,890,000.00	4,282,228.70	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,140,000.00	2,288,109.40	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,150,000.00	3,782,929.50	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,850,000.00	3,357,072.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,400,000.00	2,888,076.00	
	ACGB 6% 02/15/17	3,050,000.00	3,179,869.00	
オーストラリアドル 小計		41,560,000.00	45,504,859.95 (3,693,629,482)	
シンガポ ールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	591,078.00	
	SIGB 1.375% 10/01/17	280,000.00	281,292.20	
	SIGB 1.625% 10/01/19	110,000.00	110,012.65	
	SIGB 2.25% 06/01/21	410,000.00	412,837.20	
	SIGB 2.375% 04/01/17	650,000.00	661,254.75	
	SIGB 2.375% 06/01/25	270,000.00	269,381.70	
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	928,570.50	
	SIGB 2.75% 04/01/42	590,000.00	582,135.30	
	SIGB 2.75% 07/01/23	320,000.00	328,892.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	204,942.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	305,646.00	
	SIGB 2% 07/01/20	150,000.00	150,758.25	
	SIGB 3.125% 09/01/22	800,000.00	844,564.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	930,000.00	985,418.70	
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	434,986.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	776,335.30	
	SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	807,033.15	

	SIGB 4% 09/01/18	630,000.00	673,816.50	
シンガポールドル 小計		9,020,000.00	9,348,955.00	
			(764,838,008)	
マレーシア リンギット	MGS 3.26% 03/01/18	1,450,000.00	1,454,872.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	1,000,000.00	1,009,955.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,131,811.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	1,968,307.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,002,970.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	731,448.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,171,693.50	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,614,376.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,202,526.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,050,000.00	2,074,579.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,523,625.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	750,000.00	708,825.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	540,000.00	533,717.10	
	MGS 4.012% 09/15/17	1,000,000.00	1,020,565.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	1,400,000.00	1,422,792.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,400,000.00	1,319,395.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,686,927.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,100,000.00	2,103,066.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,700,000.00	2,759,899.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,691,273.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,103,608.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	500,000.00	496,667.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	650,000.00	662,051.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,350,000.00	1,437,635.25	
マレーシアリンギット 小計		35,840,000.00	35,832,584.85	
			(961,746,577)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	26,680,922.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,411,297.10	
	SAGB 6.5% 02/28/41	7,300,000.00	4,842,710.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	8,020,000.00	7,150,792.40	
	SAGB 7.25% 01/15/20	6,500,000.00	6,073,372.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,850,000.00	6,200,551.50	
	SAGB 7% 02/28/31	16,300,000.00	12,429,728.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	4,800,000.00	4,068,192.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	6,200,000.00	6,170,798.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	10,450,000.00	8,869,594.25	
	SAGB 8.75% 01/31/44	5,800,000.00	4,966,076.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,200,000.00	11,291,610.00	
	SAGB 8% 01/31/30	3,800,000.00	3,214,724.00	
	SAGB 8% 12/21/18	7,000,000.00	6,822,200.00	

	南アフリカランド 小計	131,240,000.00	115,192,568.25 (807,499,903)	
	合計		213,728,040,986 (213,728,040,986)	

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 172銘柄	100.0%	43.5%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 260銘柄	100.0%	40.4%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8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 7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 24銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%

(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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,986,333,906
コール・ローン	858,667,711
株式	222,546,663,966
投資信託受益証券	240,192,819
投資証券	6,007,581,316
派生商品評価勘定	5,107,367
未収入金	1,851,456
未収配当金	209,866,832
未収利息	1,294
前払金	500,775,650
差入委託証拠金	794,914,450
流動資産合計	238,151,956,767
資産合計	238,151,956,767
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	506,314,847
未払解約金	80,650,919
流動負債合計	586,965,766
負債合計	586,965,766
純資産の部	
元本等	
元本	132,735,037,669
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	104,829,953,332
元本等合計	237,564,991,001
純資産合計	237,564,991,001
負債純資産合計	238,151,956,767

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 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (3) 投資証券

	平成28年 1月20日現在
	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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,735,037,669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 1.7898円 (1万口当たり純資産額) (17,898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 1月20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 1月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引

	平成28年 1月20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	「(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。 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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年 1月21日
期首元本額	115,343,620,405円
期中追加設定元本額	63,151,294,852円
期中一部解約元本額	45,759,877,588円
期末元本額	132,735,037,669円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,197,009,859円
SBI資産設計オープン（分配型）	19,514,155円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	25,922,696,927円
世界経済インデックスファンド	2,470,275,024円

区分	平成28年 1月20日現在
マイセレクション25	4,563,015円
マイセレクション50	20,756,342円
マイセレクション75	23,002,290円
外国株式インデックス・オープン	1,091,988,505円
DCマイセレクション25	899,613,495円
DCマイセレクション50	4,617,053,299円
DCマイセレクション75	4,689,056,832円
DC外国株式インデックス・オープン	6,351,812,369円
DCマイセレクションS25	344,864,607円
DCマイセレクションS50	1,760,591,418円
DCマイセレクションS75	1,239,906,654円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	144,728,367円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	160,531,574円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	85,089,513円
DC世界経済インデックスファンド	2,481,469,111円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,925,644,017円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	42,544,578円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	26,051,186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）	134,667,085円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	203,679,491円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	701,936,788円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	244,054,747円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	706,074,190円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,577,237,265円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	689,763,746円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,545,753,879円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,604,501,713円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,872,500,547円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	672,947,054円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	695,699,875円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	215,629,925円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,696,531,627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）	3,698,865,692円
外国株式ファンド・シリーズ1	961,858,757円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,656,105,084円
コア投資戦略ファンド（成長型）	11,873,119,011円
分散投資コア戦略ファンドA	817,382,148円
分散投資コア戦略ファンドS	1,835,129,310円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	183,641,820円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	280,179,476円
コア投資戦略ファンド（切替型）	956,650,295円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	582,309,874円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	40,170,580円

区分	平成28年 1月20日現在
SMT インデックスバランス・オープン	226,315,048円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	4,052,811,952円
外国株式SMT Bセレクション（SMA専用）	27,116,517,013円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,374,240,540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 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△33,397,109,590
投資信託受益証券	△21,395,015
投資証券	△168,001,016
合計	△33,586,505,621

(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 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,298,135,009	—	8,797,359,359	△500,775,650
	合計	9,298,135,009	—	8,797,359,359	△500,775,650

(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 1月20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	804,159,030	—	803,727,200	△431,830
	アメリカドル	532,714,200	—	532,456,200	△258,000

	カナダドル	32,368,400	—	32,244,000	△124,400
	ユーロ	88,293,090	—	88,582,200	289,110
	イギリスポンド	67,070,000	—	66,628,000	△442,000
	スイスフラン	32,735,080	—	32,816,000	80,920
	スウェーデンクローナ	9,649,500	—	9,646,000	△3,500
	オーストラリアドル	30,776,960	—	30,840,800	63,840
	香港ドル	10,551,800	—	10,514,000	△37,800
	合計	804,159,030	—	803,727,200	△431,830

(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。

- ①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。
- ②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	36,549	30.85	1,127,536.65	
	ANTERO RESOURCES CORP	6,631	20.89	138,521.59	
	APACHE CORP	27,976	34.48	964,612.48	
	BAKER HUGHES	31,466	39.79	1,252,032.14	
	CABOT OIL & GAS CORP	29,004	16.43	476,535.72	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,037	58.33	818,778.21	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	30.01	470,886.91	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	41,770	3.08	128,651.60	
	CHEVRON CORP	136,541	81.51	11,129,456.91	
	CIMAREX ENERGY CO	6,569	81.19	533,337.11	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	21,371	16.49	352,407.79	
	CONCHO RESOURCES INC	9,489	75.98	720,974.22	
	CONOCOPHILLIPS	89,961	36.40	3,274,580.40	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,265	16.96	106,254.40	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,346	92.57	309,739.22	
	DEVON ENERGY CORPORATION	28,955	23.48	679,863.40	
	ENERGEN CORP	6,190	28.72	177,776.80	
	ENSCO PLC-CL A	18,962	9.42	178,622.04	
	EOG RESOURCES INC	39,428	60.98	2,404,319.44	

EQT CORPORATION	10,652	53.28	567,538.56
EXXON MOBIL	302,483	76.40	23,109,701.20
FMC TECHNOLOGIES INC	17,553	23.88	419,165.64
HALLIBURTON CO	61,292	29.79	1,825,888.68
HELMERICH & PAYNE	8,315	43.15	358,792.25
HESS CORP	19,238	36.53	702,764.14
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	33.86	421,489.28
KINDER MORGAN INC	136,198	12.55	1,709,284.90
MARATHON OIL CORP	47,335	7.68	363,532.80
MARATHON PETROLEUM CORP	39,252	41.20	1,617,182.40
MURPHY OIL CORP	11,085	16.38	181,572.30
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,272	29.53	834,872.16
NOBLE ENERGY INC	31,899	25.82	823,632.18
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,076	61.46	3,384,970.96
OCEANEERING INTL INC	7,126	32.30	230,169.80
ONEOK INC	15,568	20.79	323,658.72
PHILLIPS 66	38,948	78.67	3,064,039.16
PIONEER NATURAL RESOURCES	11,012	111.62	1,229,159.44
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	17,636	7.31	128,919.16
RANGE RESOURCES CORP	12,769	20.45	261,126.05
SCHLUMBERGER	92,088	62.82	5,784,968.16
SOUTHWESTERN ENERGY CO	29,105	6.52	189,764.60
SPECTRA ENERGY CORP	49,756	24.47	1,217,529.32
TESORO CORP	9,230	89.60	827,008.00
VALERO ENERGY CORP	35,813	66.54	2,382,997.02
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	52,887	5.99	316,793.13
WHITING PETROLEUM CORP	14,018	4.72	66,164.96
WILLIAMS COS	51,233	15.78	808,456.74
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,784	119.59	1,768,018.56
AIRGAS INC	5,138	138.55	711,869.90
ALBEMARLE CORP	8,689	48.42	420,721.38
ALCOA	92,840	6.74	625,741.60
ASHLAND INC	4,845	96.24	466,282.80
AVERY DENNISON CORP	6,084	58.97	358,773.48
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	11,076	22.69	251,314.44
BALL CORP	9,343	69.34	647,843.62
CELANESE CORP-SERIES A	11,407	60.64	691,720.48
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,307	30.25	523,536.75
CROWN HOLDINGS INC	10,494	44.83	470,446.02
DOW CHEMICAL CO	81,366	42.07	3,423,067.62
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	65,265	53.22	3,473,403.30
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,546	61.19	645,309.74

ECOLAB INC	19,413	102.37	1,987,308.81
FMC CORP	10,402	34.81	362,093.62
FREEPORT-MCMORAN INC	76,807	3.96	304,155.72
INT'L PAPER CO	27,907	35.64	994,605.48
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,028	113.48	684,057.44
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,091	73.98	2,152,152.18
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,255	119.19	507,153.45
MONSANTO CO	33,724	90.86	3,064,162.64
MOSAIC CO/THE	23,240	24.83	577,049.20
NEWMONT MINING CORP	39,440	16.31	643,266.40
NUCOR CORP	22,283	35.27	785,921.41
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	57.34	394,900.58
PPG INDUSTRIES INC	19,788	91.60	1,812,580.80
PRAXAIR INC	20,875	98.18	2,049,507.50
SEALED AIR CORP	14,781	39.95	590,500.95
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,847	239.35	1,399,479.45
VULCAN MATERIALS CO	9,287	82.52	766,363.24
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,260	43.11	140,538.60
WESTROCK CO	18,286	36.46	666,707.56
3 M COMPANY	45,347	138.39	6,275,571.33
ACUITY BRANDS INC	3,065	206.51	632,953.15
AERCAP HOLDINGS NV	6,824	32.85	224,168.40
AGCO CORP	5,969	44.61	266,277.09
AMETEK INC	16,903	47.42	801,540.26
B/E AEROSPACE INC	6,965	38.01	264,739.65
BOEING CO	46,968	126.06	5,920,786.08
CATERPILLAR	41,174	59.03	2,430,501.22
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,538	33.52	219,153.76
CUMMINS INC	11,934	83.52	996,727.68
DANAHER CORP	44,892	85.61	3,843,204.12
DEERE&CO	22,921	72.46	1,660,855.66
DOVER CORP	11,832	53.24	629,935.68
EATON CORP	33,730	48.09	1,622,075.70
EMERSON ELECTRIC CO	48,150	43.14	2,077,191.00
FASTENAL CO	19,679	36.77	723,596.83
FLOWSERVE CORP	8,985	35.40	318,069.00
FLUOR CORP	10,027	41.17	412,811.59
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,074	47.51	526,125.74
GENERAL DYNAMICS CORP	20,072	127.38	2,556,771.36
GENERAL ELECTRIC CO	684,725	28.49	19,507,815.25
GRAINGER (WW) INC	4,203	186.58	784,195.74
HONEYWELL INTL INC	54,103	97.33	5,265,844.99

ILLINOIS TOOL WORKS	23,885	81.69	1,951,165.65
INGERSOLL-RAND PLC	19,750	50.58	998,955.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	36.44	353,212.92
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,117	109.87	672,074.79
LOCKHEED MARTIN CORP	20,336	215.29	4,378,137.44
MASCO CORP	25,921	24.71	640,507.91
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,851	186.75	2,399,924.25
PACCAR INC	26,289	45.03	1,183,793.67
PARKER HANNIFIN CORP	10,107	87.87	888,102.09
PENTAIR PLC	13,583	44.08	598,738.64
PRECISION CASTPARTS CORP	9,957	231.80	2,308,032.60
QUANTA SERVICES INC	14,015	17.55	245,963.25
RAYTHEON COMPANY	21,971	120.94	2,657,172.74
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,353	91.26	853,554.78
ROCKWELL COLLIN	9,269	85.62	793,611.78
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,442	169.52	1,261,567.84
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,018	34.90	419,428.20
SNAP-ON INC	4,317	155.92	673,106.64
STANLEY BLACK&DECKER	10,775	95.67	1,030,844.25
TEXTRON	19,521	36.80	718,372.80
TRANSDIGM GROUP INC	3,709	220.82	819,021.38
UNITED RENTALS INC	7,302	54.00	394,308.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61,605	85.24	5,251,210.20
WABCO HOLDINGS INC	3,875	85.31	330,576.25
WABTEC CORP	7,158	63.02	451,097.16
XYLEM INC	13,941	32.96	459,495.36
ADT CORPORATION	11,437	28.88	330,300.56
CINTAS CORP	6,449	83.50	538,491.50
DUN & BRADSTREET CORP	2,440	95.97	234,166.80
EQUIFAX INC	8,759	103.86	909,709.74
IHS INC-CLASS A	5,122	100.99	517,270.78
MANPOWER GROUP	5,272	73.74	388,757.28
NIelsen HOLDINGS PLC	26,015	45.02	1,171,195.30
REPUBLIC SERVICES INC	18,168	43.75	794,850.00
ROBERT HALF INTL INC	9,340	42.65	398,351.00
STERICYCLE INC	5,973	115.82	691,792.86
TYCO INTERNATIONAL PLC	31,433	30.52	959,335.16
VERISK ANALYTICS INC	11,168	71.53	798,847.04
WASTE MANAGEMENT INC	33,137	52.62	1,743,668.94
AMERCO	602	353.10	212,566.20
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,336	38.86	479,376.96
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,328	63.66	657,480.48

CSX CORP	71,296	22.73	1,620,558.08
DELTA AIR LINES INC	15,095	45.96	693,766.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,154	42.95	607,914.30
FEDEX CORP	19,359	127.20	2,462,464.80
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	30,229	9.19	277,804.51
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	65.27	465,636.18
KANSAS CITY SOUTHERN	7,756	65.88	510,965.28
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,053	71.85	1,584,508.05
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,137	39.60	441,025.20
UNION PACIFIC CORP	62,862	74.10	4,658,074.20
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,417	45.18	335,100.06
UNITED PARCEL SERVICE B	50,208	90.35	4,536,292.80
AUTOLIV INC	6,636	105.18	697,974.48
BORGWARNER INC	15,914	30.34	482,830.76
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,954	67.34	1,411,042.36
FORD MOTOR COMPANY	265,953	11.95	3,178,138.35
GENERAL MOTORS CO	103,843	29.40	3,052,984.20
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,642	27.57	513,959.94
HARLEY-DAVIDSON	14,677	40.66	596,766.82
JOHNSON CONTROLS INC	47,274	34.72	1,641,353.28
LEAR CORP	5,323	102.55	545,873.65
TESLA MOTORS INC	7,159	204.72	1,465,590.48
COACH INC	19,687	31.16	613,446.92
DR HORTON INC	24,329	26.93	655,179.97
GARMIN LTD	7,608	32.29	245,662.32
HANESBRANDS INC	28,237	28.53	805,601.61
HARMAN INTL INDS INC	5,462	75.69	413,418.78
HASBRO INC	7,972	70.45	561,627.40
JARDEN CORP	13,882	50.03	694,516.46
LEGGETT & PLATT INC	10,594	38.30	405,750.20
LENNAR CORP-CL A	12,360	40.98	506,512.80
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	56.74	480,701.28
MATTEL INC	25,250	24.87	627,967.50
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	35.76	497,779.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,358	163.34	711,835.72
NEWELL RUBBERMAID	19,732	36.20	714,298.40
NIKE B	97,604	58.32	5,692,265.28
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	79.48	372,840.68
PULTE GROUP INC	24,602	15.67	385,513.34
PVH CORP	5,867	66.41	389,627.47
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	101.38	464,117.64
TOLL BROTHERS INC	11,131	28.57	318,012.67

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,365	67.11	896,925.15
VF CORP	24,586	54.00	1,327,644.00
WHIRLPOOL CORP	5,470	127.21	695,838.70
ARAMARK	17,044	30.91	526,830.04
BLOCK H & R INC	16,984	31.92	542,129.28
CARNIVAL CORPORATION	30,652	49.07	1,504,093.64
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,247	469.47	1,054,899.09
DARDEN RESTAURANTS INC	8,439	60.83	513,344.37
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,483	17.31	596,900.73
LAS VEGAS SANDS CORP	29,549	38.43	1,135,568.07
MARRIOTT INTL A	15,364	58.38	896,950.32
MCDONALD'S CORP	68,516	117.50	8,050,630.00
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	8,400	14.31	120,204.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	31,282	19.63	614,065.66
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11,086	47.20	523,259.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,092	81.08	1,061,499.36
STARBUCKS CORP	107,240	58.55	6,278,902.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,530	59.15	741,149.50
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,080	64.74	523,099.20
WYNN RESORTS LTD	5,532	59.13	327,107.16
YUM BRANDS INC	31,103	68.77	2,138,953.31
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,565	31.33	487,651.45
CBS CORP-CL B	31,516	45.39	1,430,511.24
CHARTER COMMUNICATION-A	5,860	167.38	980,846.80
COMCAST CORP-CL A	180,452	54.25	9,789,521.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,803	25.79	252,819.37
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,923	25.22	527,678.06
DISH NETWORK CORPORATION-A	16,789	48.90	820,982.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS	30,771	21.69	667,422.99
LIBERTY GLOBAL PLC-A	17,571	32.88	577,734.48
LIBERTY GLOBAL PLC-C	44,688	31.72	1,417,503.36
LIBERTY MEDIA CORP	6,384	34.99	223,376.16
LIBERTY MEDIA CORP-C	15,233	33.53	510,762.49
NEWS CORP-CLASS A	27,721	12.35	342,354.35
OMNICOM GROUP	18,024	68.89	1,241,673.36
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	55.62	273,706.02
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	3.66	607,622.22
TEGNA INC	15,014	23.20	348,324.80
THE WALT DISNEY CO	116,428	93.97	10,940,739.16
TIME WARNER CABLE-A	20,265	177.63	3,599,671.95
TIME WARNER INC	59,065	69.79	4,122,146.35
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	88,115	26.36	2,322,711.40

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	30,649	26.58	814,650.42
VIACOM INC-CLASS B	25,254	41.72	1,053,596.88
ADVANCE AUTO PARTS	5,123	144.62	740,888.26
AMAZON.COM	28,844	574.48	16,570,301.12
AUTONATION INC	5,015	44.55	223,418.25
AUTOZONE INC	2,218	715.71	1,587,444.78
BED BATH & BEYOND INC	12,615	43.22	545,220.30
BEST BUY COMPANY INC	22,277	25.87	576,305.99
CARMAX INC	14,601	42.99	627,696.99
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	34.36	217,979.84
DOLLAR GENERAL CORP	21,097	70.34	1,483,962.98
DOLLAR TREE INC	16,574	76.89	1,274,374.86
EXPEDIA INC	7,575	105.32	797,799.00
FOOT LOCKER INC	10,566	62.89	664,495.74
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	25.51	191,095.41
GAP	17,852	22.70	405,240.40
GENUINE PARTS CO	10,617	78.31	831,417.27
HOME DEPOT	93,429	119.76	11,189,057.04
KOHL'S CORP	14,309	46.38	663,651.42
L BRANDS INC	17,992	93.15	1,675,954.80
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	31,128	25.18	783,803.04
LKQ CORP	22,518	25.74	579,613.32
LOWES COMPANIES	66,903	69.46	4,647,082.38
MACY'S INC	23,441	38.76	908,573.16
NETFLIX INC	29,492	107.89	3,181,891.88
NORDSTROM INC	10,094	46.14	465,737.16
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,304	235.69	1,721,479.76
PRICELINE GROUP INC/THE	3,662	1,094.50	4,008,059.00
ROSS STORES INC	30,013	52.58	1,578,083.54
SIGNET JEWELERS LTD	5,419	122.21	662,255.99
STAPLES INC	47,470	8.81	418,210.70
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,511	69.24	3,012,701.64
TIFFANY & CO	9,101	64.22	584,466.22
TJX COMPANIES INC	48,793	68.14	3,324,755.02
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,011	83.46	835,518.06
TRIPADVISOR INC	8,771	71.19	624,407.49
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,504	175.31	789,596.24
COSTCO WHOLESALE CORP	32,042	150.47	4,821,359.74
CVS HEALTH CORP	80,600	95.06	7,661,836.00
KROGER CO	67,058	38.19	2,560,945.02
RITE AID CORP	69,829	7.64	533,493.56
SYSCO CORP	42,954	39.96	1,716,441.84

WAL-MART STORES	117,157	62.56	7,329,341.92
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,667	80.70	5,137,926.90
WHOLE FOODS MKT INC	25,128	29.41	739,014.48
ALTRIA GROUP INC	142,579	58.40	8,326,613.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,789	30.51	1,366,512.39
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,415	92.63	779,481.45
BUNGE LIMITED	10,583	60.85	643,975.55
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,202	54.33	717,264.66
COCA-COLA CO	300,050	41.92	12,578,096.00
COCA-COLA ENTERPRISES	15,090	46.29	698,516.10
CONAGRA	31,939	38.87	1,241,468.93
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,414	145.62	1,807,726.68
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,184	90.70	1,286,488.80
GENERAL MILLS INC	42,898	55.42	2,377,407.16
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,504	84.61	888,743.44
HORMEL FOODS CORP	10,754	76.90	826,982.60
JM SMUCKER CO	8,412	119.73	1,007,168.76
KELLOGG CO	19,637	71.24	1,398,939.88
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,222	89.83	738,582.26
KRAFT HEINZ CO/THE	44,295	70.17	3,108,180.15
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,566	81.28	696,244.48
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	15,072	69.24	1,043,585.28
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,738	87.20	936,353.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	116,411	41.46	4,826,400.06
MONSTER BEVERAGE CORP	10,588	144.76	1,532,718.88
PEPSICO INC	106,732	95.77	10,221,723.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	112,551	87.47	9,844,835.97
REYNOLDS AMERICAN INC	61,705	46.93	2,895,815.65
TYSON FOODS INC	21,224	49.68	1,054,408.32
WHITEWAVE FOODS CO	12,395	35.78	443,493.10
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,620	78.96	759,595.20
CLOROX COMPANY	9,110	127.64	1,162,800.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,584	64.29	3,959,235.36
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	72.27	325,504.08
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,024	83.88	1,344,093.12
KIMBERLY-CLARK CORP	26,166	125.88	3,293,776.08
PROCTER & GAMBLE CO	196,930	76.73	15,110,438.90
ABBOTT LABORATORIES	108,669	40.43	4,393,487.67
AETNA INC	25,079	104.84	2,629,282.36
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,456	92.54	1,337,758.24
ANTHEM INC	19,010	136.85	2,601,518.50
BARD C R INC	5,186	178.69	926,686.34

BAXTER INTERNATIONAL	40,256	35.36	1,423,452.16
BECTON DICKINSON & CO	15,099	142.50	2,151,607.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,069	17.57	1,705,502.33
CARDINAL HEALTH	23,879	81.58	1,948,048.82
CENTENE CORP	7,820	62.51	488,828.20
CERNER CORP	22,992	56.39	1,296,518.88
CIGNA CORP	18,507	139.92	2,589,499.44
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	11,984	65.71	787,468.64
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,467	56.36	589,920.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	15,954	74.52	1,188,892.08
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	22.20	285,159.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	49,114	72.38	3,554,871.32
HCA HOLDINGS INC	23,905	63.47	1,517,250.35
HENRY SCHEIN INC	5,885	148.35	873,039.75
HOLOGIC INC	16,762	34.48	577,953.76
HUMANA INC	10,808	164.00	1,772,512.00
IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,329	23.30	287,265.70
INTUITIVE SURGICAL INC	2,737	556.49	1,523,113.13
LABORATORY CRP OF AMER	7,053	109.93	775,336.29
MCKESSON CORP	16,616	169.44	2,815,415.04
MEDNAX INC	6,946	67.03	465,590.38
MEDTRONIC PLC	102,983	74.58	7,680,472.14
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	39.85	282,217.70
QUEST DIAGNOSTICS	10,170	65.48	665,931.60
RESMED INC	10,525	53.66	564,771.50
ST JUDE MEDICAL INC	20,877	53.78	1,122,765.06
STRYKER CORP	24,512	91.56	2,244,318.72
THE COOPER COS INC	3,727	121.01	451,004.27
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,321	112.58	7,804,158.18
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,432	107.37	690,603.84
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,730	75.94	511,076.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12,823	99.24	1,272,554.52
ABBVIE INC	120,101	54.99	6,604,353.99
AGILENT TECHNOLOGIES	23,439	37.20	871,930.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,559	156.75	2,595,623.25
ALKERMES PLC	10,522	59.53	626,374.66
ALLERGAN PLC	28,599	291.79	8,344,902.21
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,369	72.41	388,769.29
AMGEN	55,114	151.30	8,338,748.20
BAXALTA INC	40,104	40.70	1,632,232.80
BIOGEN INC	17,146	269.85	4,626,848.10
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,983	79.51	952,768.33

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,220	63.21	7,662,316.20
CELGENE CORP	57,558	102.99	5,927,898.42
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,990	52.66	842,033.40
GILEAD SCIENCES INC	106,585	89.90	9,581,991.50
ILLUMINA INC	10,393	169.58	1,762,444.94
INCYTE CORP	12,006	73.31	880,159.86
IONIS PHARMACEUTICALS INC	9,019	40.63	366,441.97
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,302	120.68	519,165.36
JOHNSON & JOHNSON	200,919	97.50	19,589,602.50
LILLY (ELI) & CO	72,661	83.23	6,047,575.03
MALLINCKRODT PLC	8,200	64.43	528,326.00
MEDIVATION INC	11,768	36.56	430,238.08
MERCK & CO	204,602	51.34	10,504,266.68
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,100	308.43	647,703.00
MYLAN NV	30,799	50.22	1,546,725.78
PERRIGO CO PLC	10,560	146.50	1,547,040.00
PFIZER	447,642	30.69	13,738,132.98
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,593	63.36	417,732.48
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,456	447.02	2,438,941.12
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	738	143.91	106,205.58
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,546	134.91	3,851,140.86
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	129.17	416,702.42
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,550	94.99	1,667,074.50
WATERS CORP	5,852	125.85	736,474.20
ZOETIS INC	34,943	43.19	1,509,188.17
BANK OF AMERICA CORP	758,052	14.24	10,794,660.48
BB&T CORP	56,217	32.92	1,850,663.64
CIT GROUP INC	12,099	32.22	389,829.78
CITIGROUP	218,685	41.94	9,171,648.90
CITIZENS FINANCIAL GROUP	38,881	22.23	864,324.63
COMERICA INC	13,561	34.72	470,837.92
FIFTH THIRD BANCORP	56,599	16.88	955,391.12
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,126	63.41	642,089.66
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,051	9.48	569,283.48
JPMORGAN CHASE & CO	268,375	57.01	15,300,058.75
KEY CORP	62,338	11.33	706,289.54
M & T BANK CORP	10,559	106.35	1,122,949.65
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,048	14.78	488,449.44
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	14.46	315,763.02
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,154	85.33	3,170,350.82
REGIONS FINL CORP	93,833	8.08	758,170.64
SIGNATURE BANK	3,757	135.73	509,937.61

SUNTRUST BANKS	37,920	37.12	1,407,590.40
US BANCORP	126,859	39.13	4,963,992.67
WELLS FARGO & CO	353,869	48.21	17,060,024.49
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,839	128.61	493,733.79
ALLY FINANCIAL INC	30,804	15.69	483,314.76
AMERICAN EXPRESS	65,430	62.64	4,098,535.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,569	92.54	1,163,135.26
BANK NEW YORK CO	80,497	35.93	2,892,257.21
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	86,020	127.76	10,989,915.20
BLACKROCK INC	8,875	294.00	2,609,250.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,238	62.19	2,440,211.22
CME GROUP INC	23,109	86.11	1,989,915.99
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32,027	48.91	1,566,440.57
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,026	24.81	496,845.06
EATON VANCE CORP	7,881	27.61	217,594.41
FRANKLIN RESOURCES INC	27,900	33.05	922,095.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,382	156.82	4,450,865.24
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,040	249.03	2,002,201.20
INVESCO LTD	29,872	28.82	860,911.04
LEGG MASON INC	7,716	31.91	246,217.56
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	15.94	409,753.64
MCGRAW-HILL FINANCIAL	19,765	83.33	1,647,017.45
MOODY'S CORP	13,371	86.43	1,155,655.53
MORGAN STANLEY	105,938	26.26	2,781,931.88
NASDAQ INC	9,070	57.47	521,252.90
NAVIENT CORP	29,884	8.76	261,783.84
NORTHERN TRUST CORP	16,441	63.93	1,051,073.13
PRICE T ROWE GROUP INC	18,086	65.56	1,185,718.16
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	48.39	480,609.48
SCHWAB (CHARLES) CORP	84,997	26.51	2,253,270.47
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	44.89	484,901.78
STATE STREET CORP	29,676	55.54	1,648,205.04
SYNCHRONY FINANCIAL	60,845	28.03	1,705,485.35
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,139	28.93	582,621.27
VOYA FINANCIAL INC	16,094	30.17	485,555.98
AFLAC	31,363	56.49	1,771,695.87
ALLEGHANY CORP	1,109	463.20	513,688.80
ALLSTATE CORP	29,595	58.44	1,729,531.80
AMERICAN INT'L GROUP	93,746	56.16	5,264,775.36
AON PLC	20,347	85.98	1,749,435.06
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,789	66.75	586,665.75
ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,324	37.19	495,519.56

ASSURANT INC	4,769	78.52	374,461.88
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	53.33	389,415.66
CHUBB LTD	33,486	110.87	3,712,592.82
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,121	55.24	614,324.04
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	171.24	574,167.72
FNF GROUP	18,683	31.82	594,493.06
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,750	39.11	1,202,632.50
LINCOLN NATIONAL CORP	17,658	39.69	700,846.02
LOEWS CORP	21,888	35.07	767,612.16
MARKEL CORP	1,025	851.24	872,521.00
MARSH & MCLENNAN COS	38,821	52.15	2,024,515.15
METLIFE INC	68,046	42.74	2,908,286.04
PARTNERRE LTD	3,587	140.00	502,180.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,970	37.53	824,534.10
PROGRESSIVE CORP	43,470	29.80	1,295,406.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,576	69.29	2,257,191.04
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	110.90	360,314.10
TORCHMARK CORP	9,592	52.87	507,129.04
TRAVELERS COS INC/THE	22,418	105.76	2,370,927.68
UNUM GROUP	18,574	28.17	523,229.58
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,292	110.38	1,025,650.96
WR BERKLEY CORP	7,065	49.19	347,527.35
XL GROUP PLC	21,398	35.38	757,061.24
CBRE GROUP INC-A	21,139	28.56	603,729.84
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,900	6.18	277,482.00
JONES LANG LASALLE INC	3,112	138.79	431,914.48
REALOGY HOLDINGS CORP	11,351	32.71	371,291.21
WEYERHAEUSER CO	36,213	25.47	922,345.11
ACCENTURE PLC-CL A	44,937	101.38	4,555,713.06
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,822	35.15	1,329,443.30
ADOBE SYSTEMS INC	36,009	89.18	3,211,282.62
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	12,545	45.44	570,044.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,344	251.97	1,094,557.68
ALPHABET INC-CL A	21,057	719.08	15,141,667.56
ALPHABET INC-CL C	22,484	701.79	15,779,046.36
ANSYS INC	6,865	84.99	583,456.35
AUTODESK INC	16,007	47.59	761,773.13
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,826	79.11	2,675,974.86
CA INC	24,426	26.10	637,518.60
CDK GLOBAL INC	9,538	41.98	400,405.24
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,090	75.92	386,432.80
CITRIX SYSTEMS INC	11,275	66.07	744,939.25

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,959	59.94	2,634,902.46
EBAY	78,992	25.77	2,035,623.84
ELECTRONIC ARTS INC	22,844	67.37	1,539,000.28
FACEBOOK INC-A	155,938	95.26	14,854,653.88
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	20,900	58.71	1,227,039.00
FIREEYE INC	7,918	15.23	120,591.14
FISERV INC	17,335	89.04	1,543,508.40
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,487	114.85	630,181.95
FORTINET INC	10,871	26.46	287,646.66
GARTNER INC	6,094	84.73	516,344.62
GLOBAL PAYMENTS INC	9,527	57.32	546,087.64
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,718	128.11	8,675,352.98
INTUIT INC	18,993	90.88	1,726,083.84
LINKEDIN CORP - A	8,401	193.43	1,625,005.43
MASTERCARD INC-CLASS A	71,942	86.22	6,202,839.24
MICROSOFT CORP	551,829	50.56	27,900,474.24
MOBILEYE NV	6,284	28.37	178,277.08
NETSUITE INC	3,217	70.86	227,956.62
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	18.15	318,148.22
ORACLE CORP	252,444	34.55	8,721,940.20
PAYCHEX INC	24,161	47.50	1,147,647.50
PAYPAL HOLDINGS INC	78,428	32.20	2,525,381.60
RED HAT INC	12,854	71.60	920,346.40
SABRE CORP	13,317	25.52	339,849.84
SALESFORCE.COM INC	44,787	70.80	3,170,919.60
SERVICENOW INC	10,271	74.32	763,340.72
SPLUNK INC	8,873	48.45	429,896.85
SYMANTEC CORP	47,460	19.03	903,163.80
SYNOPSYS INC	11,010	40.69	447,996.90
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,378	80.89	273,246.42
TERADATA CORP	9,511	22.69	215,804.59
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,531	45.11	565,273.41
TWITTER INC	42,396	16.69	707,589.24
VANTIV INC - CL A	11,196	43.69	489,153.24
VERISIGN INC	7,494	74.60	559,052.40
VISA INC-CLASS A SHARES	141,889	71.39	10,129,455.71
VMWARE INC-CLASS A	5,459	48.99	267,436.41
WESTERN UNION CO	38,757	16.44	637,165.08
WORKDAY INC-CLASS A	7,992	66.10	528,271.20
XEROX CORP	73,995	8.91	659,295.45
YAHOO	64,457	29.74	1,916,951.18
ZILLOW GROUP INC-C	6,200	20.67	128,154.00

AMPHENOL CORPORATION	22,979	45.42	1,043,706.18
APPLE INC	414,006	96.66	40,017,819.96
ARROW ELECTRONICS INC	6,579	46.66	306,976.14
AVNET INC	9,057	38.03	344,437.71
CDW CORP/DE	10,704	37.24	398,616.96
CISCO SYSTEMS	369,847	23.85	8,820,850.95
CORNING	87,462	16.76	1,465,863.12
EMC CORP	139,592	24.35	3,399,065.20
F5 NETWORKS INC	5,350	93.50	500,225.00
FLEXTRONICS INTL LTD	38,641	9.25	357,429.25
FLIR SYSTEMS INC	9,284	30.22	280,562.48
HARRIS CORP	8,769	84.34	739,577.46
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	130,581	12.32	1,608,757.92
HP INC	130,581	9.76	1,274,470.56
JUNIPER NETWORKS INC	24,324	25.74	626,099.76
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,617	61.13	710,147.21
NETAPP INC	23,085	21.45	495,173.25
PALO ALTO NETWORKS INC	4,973	149.24	742,170.52
QUALCOMM	114,055	46.09	5,256,794.95
SANDISK CORP	15,286	71.06	1,086,223.16
SEAGATE TECHNOLOGY	23,147	29.83	690,475.01
TE CONNECTIVITY LTD	29,455	55.38	1,631,217.90
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,032	19.56	333,145.92
WESTERN DIGITAL CORP	16,063	46.45	746,126.35
AT&T INC	446,456	34.51	15,407,196.56
CENTURYLINK INC	39,157	23.22	909,225.54
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	82,647	4.18	345,464.46
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,528	47.12	1,061,519.36
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,972	90.82	814,837.04
SPRINT CORP	53,367	2.64	140,888.88
T-MOBILE US INC	19,816	37.65	746,072.40
VERIZON COMMUNICATIONS	295,199	44.87	13,245,579.13
AES CORP	52,646	8.72	459,073.12
AGL RESOURCES INC	8,873	63.95	567,428.35
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,521	63.08	537,504.68
AMEREN CORPORATION	17,147	43.45	745,037.15
AMERICAN ELECTRIC POWER	35,378	59.57	2,107,467.46
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,314	61.01	812,287.14
CALPINE CORP	25,284	14.01	354,228.84
CENTERPOINT ENERGY INC	30,517	17.50	534,047.50
CMS ENERGY CORP	21,027	36.87	775,265.49
CONSOLIDATED EDISON INC	21,704	69.07	1,499,095.28

	DOMINION RESOURCES	42,626	69.90	2,979,557.40	
	DTE ENERGY COMPANY	13,401	82.23	1,101,964.23	
	DUKE ENERGY CORP	49,603	73.16	3,628,955.48	
	EDISON INTL	24,104	60.12	1,449,132.48	
	ENTERGY CORP	12,548	68.87	864,180.76	
	EVERSOURCE ENERGY	22,121	52.59	1,163,343.39	
	EXELON CORP	62,204	27.64	1,719,318.56	
	FIRSTENERGY CORP	29,330	32.49	952,931.70	
	NEXTERA ENERGY INC	33,029	107.81	3,560,856.49	
	NRG ENERGY INC	25,186	10.03	252,615.58	
	OGE ENERGY CORP	15,686	24.79	388,855.94	
	PEPCO HOLDINGS INC	19,559	26.19	512,250.21	
	PG&E CORP	34,729	52.98	1,839,942.42	
	PINNACLE WEST CAPITAL	8,330	64.88	540,450.40	
	PPL CORPORATION	49,336	33.63	1,659,169.68	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	37,376	39.83	1,488,686.08	
	SCANA CORP	10,178	61.56	626,557.68	
	SEMPRA ENERGY	17,041	92.50	1,576,292.50	
	SOUTHERN CO	65,269	47.94	3,128,995.86	
	WEC ENERGY GROUP INC	22,005	54.19	1,192,450.95	
	XCEL ENERGY INC	37,603	37.21	1,399,207.63	
	ANALOG DEVICES	23,246	49.39	1,148,119.94	
	APPLIED MATERIALS	85,527	16.45	1,406,919.15	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	18,714	120.07	2,246,989.98	
	BROADCOM CORP-CL A	39,952	52.96	2,115,857.92	
	INTEL CORP	345,603	29.80	10,298,969.40	
	KLA-TENCOR CORP	11,893	64.32	764,957.76	
	LAM RESEARCH CORP	11,195	67.46	755,214.70	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,891	39.57	668,376.87	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,286	7.77	235,322.22	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,025	31.07	653,246.75	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,894	41.70	621,079.80	
	MICRON TECHNOLOGY	80,552	10.80	869,961.60	
	NVIDIA CORP	37,929	27.33	1,036,599.57	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	11,569	68.43	791,666.67	
	QORVO INC	10,609	36.29	385,000.61	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,228	60.38	859,086.64	
	TEXAS INSTRUMENTS	74,739	48.22	3,603,914.58	
	XILINX INC	18,324	42.79	784,083.96	
	アメリカドル 小計	23,029,536		1,223,851,138.11 (143,863,701,284)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	28.75	341,722.50	

ARC RESOURCES LTD	27,117	15.56	421,940.52
CAMECO CORP	28,709	15.88	455,898.92
CANADIAN NATURAL RESOURCES	80,615	22.92	1,847,695.80
CANADIAN OIL SANDS LTD	40,122	8.13	326,191.86
CENOVUS ENERGY INC	59,243	17.22	1,020,164.46
CRESCENT POINT ENERGY CORP	38,454	13.21	507,977.34
ENBRIDGE	63,129	44.07	2,782,095.03
ENCANA CORP	57,917	4.75	275,105.75
HUSKY ENERGY INC	23,143	13.20	305,487.60
IMPERIAL OIL	21,387	39.64	847,780.68
INTER PIPELINE LTD	25,744	20.09	517,196.96
KEYERA CORP	11,240	34.95	392,838.00
MEG ENERGY CORP	11,150	4.54	50,621.00
PEMBINA PIPELINE CORP	25,731	27.95	719,181.45
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	25.75	325,299.75
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,235	19.51	180,174.85
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	13,811	12.86	177,609.46
SUNCOR ENERGY	104,463	29.09	3,038,828.67
TOURMALINE OIL CORP	15,316	22.59	345,988.44
TRANSCANADA CORP	52,364	43.02	2,252,699.28
VERESEN INC	23,263	7.74	180,055.62
VERMILION ENERGY INC	7,138	33.05	235,910.90
AGNICO EAGLE MINES	16,929	38.99	660,061.71
AGRIUM INC	9,859	124.85	1,230,896.15
BARRICK GOLD CORP	89,275	11.01	982,917.75
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,100	210.99	443,079.00
ELDORADO GOLD CORP	45,613	3.10	141,400.30
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,991	2.85	159,574.35
FRANCO-NEVADA CORP	12,011	61.75	741,679.25
GOLDCORP INC	59,518	14.33	852,892.94
KINROSS GOLD CORP	81,986	2.00	163,972.00
METHANEX CORP	6,468	35.98	232,718.64
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	58,698	23.65	1,388,207.70
SILVER WHEATON CORP	28,647	15.31	438,585.57
TECK RESOURCES LTD-CL B	37,266	4.97	185,212.02
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	2.51	178,210.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	41.60	180,003.20
YAMANA GOLD INC	59,651	2.04	121,688.04
BOMBARDIER B	157,835	1.18	186,245.30
CAE INC	18,429	15.06	277,540.74
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	18.01	211,869.64
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	37.78	458,346.96

CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,934	71.70	4,153,867.80
CP RAILWAY LIMITED	10,996	154.98	1,704,160.08
LINAMAR CORP	3,889	56.12	218,250.68
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,782	49.69	1,529,557.58
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	37.44	661,152.96
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,433	48.29	745,259.57
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,558	23.81	727,585.98
THOMSON REUTERS CORP	25,460	51.57	1,312,972.20
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	107.38	580,818.42
DOLLARAMA INC	8,315	73.61	612,067.15
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,496	58.81	1,734,659.76
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	24.76	284,715.24
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	17.81	98,204.34
LOBLAW COMPANIES LTD	16,203	63.27	1,025,163.81
METRO INC	19,179	39.86	764,474.94
WESTON (GEORGE) LTD	3,518	102.64	361,087.52
SAPUTO INC	19,855	31.95	634,367.25
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	23,471	129.67	3,043,484.57
BANK MONTREAL	46,810	71.30	3,337,553.00
BANK NOVA SCOTIA	87,726	53.27	4,673,164.02
CANADIAN IMPERIAL BANK	29,210	85.84	2,507,386.40
NATIONAL BANK OF CANADA	23,678	36.63	867,325.14
ROYAL BANK OF CANADA	107,983	67.43	7,281,293.69
TORONTO-DOMINION BANK	133,315	50.29	6,704,411.35
CI FINANCIAL CORP	18,671	28.13	525,215.23
ELEMENT FINANCIAL CORP	28,986	14.91	432,181.26
IGM FINANCIAL INC	7,685	32.47	249,531.95
ONEX CORP	5,970	81.75	488,047.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,554	711.63	1,105,873.02
GREAT-WEST LIFECO INC	22,628	32.65	738,804.20
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	38.99	269,849.79
INTACT FINANCIAL CORP	9,906	84.92	841,217.52
MANULIFE FINANCIAL CORP	142,781	18.04	2,575,769.24
POWER CORP OF CANADA	28,343	27.08	767,528.44
POWER FINANCIAL CORP	16,605	29.61	491,674.05
SUN LIFE FINANCIAL INC	42,970	38.18	1,640,594.60
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	63,489	40.41	2,565,590.49
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,916	18.02	124,626.32
CGI GROUP INC - CL A	17,086	54.24	926,744.64
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,448	499.92	723,884.16
OPEN TEXT CORP	8,064	66.50	536,256.00
BCE INC	10,313	54.48	561,852.24

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	25,886	49.36	1,277,732.96	
	TELUS CORP	16,454	36.81	605,671.74	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	34.49	180,762.09	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.06	320,663.44	
	FORTIS INC	21,187	36.78	779,257.86	
	カナダドル 小計	2,886,629		91,075,878.29 (7,342,537,307)	
ユーロ	ENI	182,966	12.58	2,301,712.28	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	9.59	247,642.57	
	NESTE OIL OYJ	9,335	26.35	245,977.25	
	OMV AG	9,889	22.14	218,942.46	
	REPSOL SA	74,777	8.50	635,604.50	
	SAIPEM	22,904	6.27	143,722.60	
	TECHNIP S.A.	7,230	38.29	276,872.85	
	TENARIS SA	34,866	9.29	324,079.47	
	TOTAL SA	157,996	38.62	6,101,805.52	
	VOPAK	4,507	37.72	170,004.04	
	AIR LIQUIDE	24,736	93.67	2,317,021.12	
	AKZO NOBEL	17,228	57.82	996,122.96	
	ARCELORMITTAL	75,111	3.33	250,119.63	
	ARKEMA	4,293	55.03	236,243.79	
	BASF SE	66,945	61.17	4,095,025.65	
	CRH	60,824	23.69	1,440,920.56	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,337	27.84	287,782.08	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	38.62	222,528.44	
	HEIDELBERGCEMENT AG	10,108	65.41	661,164.28	
	IMERYS SA	3,000	58.40	175,200.00	
	K+S AG	14,355	20.43	293,344.42	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,482	42.81	577,231.83	
	LANXESS	7,293	37.59	274,143.87	
	LINDE AG	13,402	120.05	1,608,910.10	
	OCI NV	5,400	17.06	92,151.00	
	SOLVAY SA	4,469	77.80	347,688.20	
	STORA ENSO OYJ R	36,014	7.32	263,622.48	
	SYMRISE AG	9,404	58.79	552,861.16	
	THYSSEN KRUPP	26,520	15.18	402,706.20	
	UMICORE	6,892	34.02	234,465.84	
	UPM KYMMENE CORP	38,348	14.87	570,234.76	
	VOESTALPINE AG	7,829	24.51	191,927.93	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,261	22.50	320,872.50	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	14,261	0.40	5,704.40	
	AIRBUS GROUP SE	42,522	56.72	2,411,847.84	

ALSTOM	16,356	27.22	445,210.32
ANDRITZ AG	5,242	42.48	222,680.16
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	34.39	201,313.93
BOUYGUES ORD	13,925	35.25	490,925.87
BRENTAG AG	11,535	43.15	497,792.92
CNH INDUSTRIAL NV	65,726	5.45	358,206.70
FERROVIAL SA	31,764	19.57	621,621.48
FINMECCANICA SPA	28,941	11.58	335,136.78
GEA GROUP AG	13,801	36.30	500,976.30
KONE OYJ-B	23,752	37.50	890,700.00
KONINKLIJKE PHILIPS	70,003	22.88	1,601,668.64
LEGRAND SA	18,733	49.25	922,693.91
MAN SE	2,329	90.90	211,706.10
METSO OYJ	9,561	18.13	173,340.93
OSRAM LICHT AG	5,675	38.81	220,275.12
PRYSMIAN SPA	14,715	18.34	269,873.10
REXEL SA	24,339	10.26	249,839.83
SAFRAN SA	21,597	56.23	1,214,399.31
SAINT-GOBAIN	35,987	36.70	1,320,902.83
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,019	47.85	1,914,909.15
SIEMENS	57,766	82.26	4,751,831.16
THALES SA	7,875	69.14	544,477.50
VINCI S.A.	34,479	59.05	2,035,984.95
WARTSILA OYJ	11,462	37.21	426,501.02
ZARDOYA OTIS SA	13,496	9.76	131,720.96
ZODIAC AEROSPACE	13,148	18.67	245,473.16
BUREAU VERITAS SA	19,558	17.41	340,504.78
EDENRED	13,303	16.20	215,508.60
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	49.00	469,812.00
SOCIETE BIC SA	1,899	143.30	272,126.70
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	39,689	12.66	502,462.74
ADP	2,382	99.46	236,913.72
AENA SA	4,899	101.15	495,533.85
ATLANTIA SPA	29,543	22.79	673,284.97
BOLLORE	61,805	3.75	232,139.58
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,731	13.67	201,372.77
DEUTSCHE POST AG-REG	71,196	23.09	1,643,915.64
FRAPORT AG	3,561	53.61	190,905.21
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	9.64	351,720.87
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	7.30	439,788.50
TNT EXPRESS	38,784	7.74	300,188.16
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,900	78.86	1,884,754.00

BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	63.27	226,569.87
CONTINENTAL AG	8,097	194.40	1,574,056.80
DAIMLER AG	70,145	65.53	4,596,601.85
FERRARI NV	6,686	38.80	259,416.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	66,864	6.62	442,639.68
MICHELIN	13,673	80.73	1,103,821.29
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,697	29.49	226,984.53
PEUGEOT SA	31,342	13.85	434,086.70
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,908	43.09	470,080.26
RENAULT SA	14,321	76.62	1,097,275.02
VALEO SA	5,679	122.00	692,838.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,739	110.10	1,292,463.90
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	121.75	315,819.50
ADIDAS AG	14,723	92.00	1,354,516.00
CHRISTIAN DIOR	4,038	148.10	598,027.80
HERMES INTERNATIONAL	1,961	301.25	590,751.25
HUGO BOSS AG	4,852	68.06	330,227.12
KERING	5,366	150.50	807,583.00
LUXOTTICA GROUP SPA	12,039	58.25	701,271.75
LVMH	20,068	140.00	2,809,520.00
ACCOR	14,931	34.74	518,777.59
SODEXO	7,055	87.27	615,689.85
ALTICE NV -A	28,394	12.87	365,430.78
ALTICE NV -B	10,461	12.96	135,574.56
AXEL SPRINGER SE	3,827	44.45	170,110.15
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	26.89	322,034.64
JC DECAUX SA	4,674	31.97	149,427.78
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,885	111.95	211,025.75
LAGADERE S.C.A	9,057	24.70	223,753.18
NUMERICABLE-SFR	7,526	34.85	262,281.10
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,172	44.71	723,130.98
PUBLICIS GROUPE	13,383	51.99	695,782.17
RELX NV	71,956	14.45	1,040,123.98
RTL GROUP	2,486	72.11	179,275.40
SES	22,954	24.20	555,601.57
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	46.83	150,792.60
VIVENDI	83,735	18.83	1,577,148.72
WOLTERS KLUWER	22,399	29.34	657,186.66
INDITEX	78,610	29.03	2,282,441.35
ZALANDO SE	6,805	31.43	213,915.17
CARREFOUR	38,705	24.26	938,983.30
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	36.50	134,575.50

COLRUYT SA	4,415	46.27	204,304.12
DELHAIZE GROUP	7,450	86.77	646,436.50
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	4.85	224,461.39
JERONIMO MARTINS	20,234	10.98	222,270.49
KONINKLIJKE AHOLD NV	60,001	18.79	1,127,418.79
METRO STAMM	13,712	25.82	354,112.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV	58,505	109.85	6,426,774.25
DANONE (GROUPE)	43,164	59.71	2,577,322.44
HEINEKEN HOLDING NV	7,613	66.87	509,081.31
HEINEKEN NV	16,177	75.83	1,226,701.91
KERRY GROUP PLC-A	11,778	73.65	867,449.70
PERNOD-RICARD	15,652	98.73	1,545,321.96
REMY COINTREAU	1,575	60.57	95,397.75
BEIERSDORF AG	7,534	80.84	609,048.56
HENKEL AG & CO KGAA	7,463	78.84	588,382.92
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,471	90.93	1,133,988.03
LOREAL	18,113	149.20	2,702,459.60
UNILEVER NV-CVA	118,787	38.61	4,586,366.07
ESSILOR INTERNATIONAL	15,104	111.15	1,678,809.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,305	73.67	1,127,519.35
FRESENIUS SE&CO KGAA	28,017	59.30	1,661,408.10
BAYER	60,142	102.50	6,164,555.00
GRIFOLS SA	22,728	19.34	439,673.16
MERCK KGAA	9,216	80.83	744,929.28
ORION OYJ-CLASS B	7,975	28.50	227,287.50
QIAGEN N.V.	14,956	20.45	305,850.20
SANOFI	85,896	74.79	6,424,161.84
UCB (GROUPE)	9,374	78.43	735,202.82
BANCO BILBAO VIZCAYA	474,050	5.82	2,762,289.35
BANCO DE SABADELL SA	352,757	1.44	510,439.37
BANCO SANTANDER SA	1,071,016	3.92	4,201,595.76
BANKINTER SA	46,530	6.04	281,041.20
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.03	86,133.09
BNP PARIBAS	77,319	44.18	3,415,953.42
CAIXABANK	184,750	2.80	518,593.25
COMMERZBANK AG	77,118	7.91	610,157.61
CREDIT AGRICOLE SA	74,240	9.28	689,095.68
ERSTE GROUP BANK AG	20,524	25.24	518,128.38
ING GROEP NV-CVA	282,592	10.85	3,066,123.20
INTESA SANPAOLO	928,149	2.69	2,496,720.81
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.49	161,850.00
KBC GROEP NV	17,988	51.14	919,906.32

NATIXIS	69,996	4.16	291,393.34
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	11.40	104,845.80
SOCIETE GENERALE	53,264	35.84	1,908,981.76
UNICREDIT SPA	351,961	4.01	1,414,179.29
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,534	4.82	315,873.88
DEUTSCHE BANK NAMEN	101,094	18.86	1,906,632.84
DEUTSCHE BOERSE	13,777	75.48	1,039,887.96
EURAZEO	2,763	54.59	150,832.17
EXOR SPA	7,381	32.02	236,339.62
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	69.24	432,542.28
MEDIOBANCA	41,923	7.61	319,034.03
WENDEL	1,898	92.81	176,153.38
AEGON	131,858	5.18	683,288.15
AGEAS	13,863	39.09	541,904.67
ALLIANZ SE-REG	33,881	149.70	5,071,985.70
ASSICURAZIONI GENERALI	86,452	15.18	1,312,341.36
AXA	143,565	22.90	3,287,638.50
CNP ASSURANCES	11,830	11.25	133,087.50
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	96.70	455,070.20
MAPFRE SA	90,939	2.05	186,697.76
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,261	175.00	2,145,675.00
NN GROUP NV	18,368	31.27	574,459.20
SAMPO OYJ-A SHS	33,606	44.37	1,491,098.22
SCOR SE	10,368	31.04	321,822.72
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	2.00	190,920.64
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	25,500	23.56	600,907.50
VONOVIA SE	33,154	26.00	862,004.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	32,922	37.54	1,236,056.49
ATOS SE	6,536	71.06	464,448.16
CAP GEMINI SA	12,178	80.28	977,649.84
DASSAULT SYSTEMES SA	9,516	66.78	635,478.48
GEMALTO	6,158	56.42	347,434.36
SAP SE	71,630	72.29	5,178,132.70
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	45.77	435,410.01
ALCATEL-LUCENT	209,497	3.64	762,569.08
INGENICO GROUP	3,848	105.20	404,809.60
NOKIA OYJ	270,653	6.63	1,795,782.65
DEUTSCHE TELEKOM	235,126	15.54	3,655,033.67
ELISA A	10,064	33.67	338,854.88
ILIAD SA	2,053	221.95	455,663.35
KPN (KON.)	228,559	3.25	743,045.30
ORANGE	143,323	15.40	2,207,890.81

	PROXIMUS	10,096	29.16	294,449.84	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	1.04	892,621.94	
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.83	393,748.11	
	TELEFONICA	328,868	9.16	3,012,430.88	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	4.51	169,556.44	
	E.ON SE	148,316	8.82	1,309,481.96	
	ELECTRICITE DE FRANCE	15,766	11.71	184,619.86	
	ENAGAS	15,285	25.86	395,270.10	
	ENDESA	24,774	17.47	432,801.78	
	ENEL	508,928	3.64	1,855,551.48	
	ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.75	215,768.72	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	159,451	3.03	484,252.68	
	ENGIE	107,619	14.26	1,535,185.03	
	FORTUM OYJ	33,469	13.26	443,798.94	
	GAS NATURAL SDG SA	26,546	17.37	461,104.02	
	IBERDROLA SA	389,295	6.24	2,431,147.27	
	IBERDROLA SA-RTS	389,295	0.12	48,661.87	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,102	74.29	601,897.58	
	RWE STAMM	36,844	11.86	436,969.84	
	SNAM SPA	150,885	4.97	751,105.53	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	16.46	341,874.20	
	TERNA SPA	113,720	4.69	534,256.56	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,358	21.02	701,185.16	
	ASML HOLDING NV	25,001	73.80	1,845,073.80	
	INFINEON TECHNOLOGIES	80,647	11.88	958,086.36	
	STMICROELECTRONICS	42,509	5.54	235,882.44	
	ユーロ 小計	16,599,725		222,950,274.42 (28,622,356,230)	
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	26,190	3.81	99,914.85	
	BG GROUP	244,857	9.39	2,301,410.94	
	BP PLC	1,330,199	3.42	4,555,266.47	
	PETROFAC LTD	16,711	7.12	118,982.32	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	285,002	13.65	3,890,277.30	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	174,787	13.69	2,393,707.96	
	ANGLO AMERICAN PLC	98,685	2.38	235,659.78	
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	3.55	90,360.99	
	BHP BILLTON PLC	151,979	6.27	953,060.30	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,609	28.88	306,387.92	
	FRESNILLO PLC	17,743	6.64	117,902.23	
	GLENCORE PLC	903,415	0.78	713,517.16	
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,364	24.45	351,199.80	
	MONDI PLC	27,264	12.13	330,712.32	

RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	42.68	311,307.92
REXAM PLC	54,799	6.11	334,821.89
RIO TINTO PLC REG	90,790	16.57	1,504,390.30
ASHTED GROUP PLC	38,400	9.68	371,712.00
BAE SYSTEMS PLC	233,284	5.06	1,180,417.04
BUNZL PLC	24,824	17.72	439,881.28
COBHAM PLC	90,015	2.59	233,768.95
IMI PLC	17,506	7.93	138,822.58
MEGGITT PLC	50,990	3.55	181,473.41
MELROSE INDUSTRIES PLC	64,431	2.76	178,151.71
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	128,458	5.50	706,519.00
SMITHS GROUP PLC	29,684	8.89	264,039.18
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	18.20	337,701.00
WEIR GROUP PLC/THE	13,390	8.40	112,542.95
WOLSELEY LTD	18,291	33.67	615,857.97
AGGREKO PLC	19,830	8.05	159,730.65
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	9.49	186,985.03
CAPITA GROUP PLC	47,099	11.59	545,877.41
EXPERIAN PLC	69,123	11.52	796,296.96
G4S PLC	100,693	2.17	218,604.50
INTERTEK GROUP PLC	12,430	27.25	338,717.50
EASYJET PLC	11,633	16.32	189,850.56
ROYAL MAIL PLC	60,548	4.36	264,352.56
NEW GKN	123,433	2.86	353,882.41
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,214	5.79	423,909.06
BURBERRY GROUP PLC	32,866	11.39	374,343.74
PERSIMMON PLC	22,640	19.57	443,064.80
TAYLOR WIMPAY PLC	233,248	1.84	431,042.30
CARNIVAL PLC	13,621	37.33	508,471.93
COMPASS GROUP PLC	121,226	11.64	1,411,070.64
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,502	22.74	397,995.48
MERLIN ENTERTAINME	48,554	4.10	199,071.40
TUI AG-DI	35,476	12.36	438,483.36
WHITBREAD PLC	12,809	39.52	506,211.68
WILLIAM HILL	70,325	3.76	264,984.60
ITV PLC	269,479	2.62	708,190.81
PEARSON	57,783	6.84	395,524.63
RELX PLC	78,856	11.65	918,672.40
SKY PLC	72,378	10.49	759,245.22
WPP PLC	95,145	14.47	1,376,748.15
DIXONS CARPHONE PLC	66,738	4.49	299,987.31
KINGFISHER PLC	165,161	3.33	550,977.09

MARKS & SPENCER GROUP PLC	116,812	4.21	492,596.20
NEXT PLC	10,193	66.85	681,402.05
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,094	3.94	71,435.11
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	1.58	266,141.87
SAINSBURY (J) PLC	86,863	2.39	207,602.57
TESCO	602,014	1.59	957,804.27
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,939	30.10	750,663.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO	135,591	36.47	4,945,003.77
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	13.90	194,586.10
DIAGEO	183,398	18.28	3,352,515.44
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	68,673	35.59	2,444,415.43
SABMILLER PLC	69,637	41.38	2,881,579.06
TATE & LYLE	29,189	5.90	172,361.04
RECKITT BENCKISER PLC	46,035	60.99	2,807,674.65
UNILEVER PLC	92,030	29.34	2,700,160.20
SMITH & NEPHEW PLC	62,775	11.07	694,919.25
ASTRAZENECA	92,035	43.12	3,969,009.37
GLAXOSMITHKLINE	354,117	13.90	4,922,226.30
SHIRE PLC	42,481	42.23	1,793,972.63
BARCLAYS	1,221,961	1.89	2,320,503.93
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,445,880	4.88	7,065,292.62
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,165,025	0.65	2,739,753.44
ROYAL BANK OF SCOTLAND	261,518	2.64	691,976.62
STANDARD CHARTERED PLC	243,537	4.91	1,195,766.67
3I GROUP PLC	74,066	4.31	319,520.72
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	74,245	2.28	169,501.33
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	12.65	258,932.85
ICAP PLC	43,892	4.54	199,357.46
INVESTEC PLC	36,474	4.23	154,285.02
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	23,357	24.73	577,618.61
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	29.32	325,862.48
SCHRODERS PLC	9,867	25.90	255,555.30
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	16.95	275,522.25
AVIVA PIC	297,285	4.74	1,411,509.18
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	94,822	3.71	352,358.55
LEGAL & GENERAL GROUP	445,827	2.44	1,090,047.01
OLD MUTUAL PLC	352,004	1.57	554,758.30
PRUDENTIAL	187,754	13.92	2,614,474.45
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	70,206	4.07	286,300.06
ST JAMES'S PLACE PLC	37,294	9.25	344,969.50
STANDARD LIFE PLC	141,626	3.64	516,368.39
AUTO TRADER GROUP PLC	57,144	4.11	235,261.84

	SAGE GROUP PLC	80,156	5.67	454,484.52	
	BT GROUP PLC	599,623	4.67	2,804,736.58	
	INMARSAT PLC	33,632	10.54	354,481.28	
	VODAFONE GROUP PLC	1,932,600	2.16	4,189,876.80	
	CENTRICA PLC	375,613	2.09	786,533.62	
	NATIONAL GRID PLC	268,349	9.44	2,535,629.70	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	21.17	383,431.04	
	SSE PLC	73,391	14.23	1,044,353.93	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,451	9.20	464,401.45	
	ARM HOLDINGS PLC	98,798	9.64	952,412.72	
	イギリスポンド 小計	21,238,784		109,063,967.13 (18,167,875,644)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	28,559	9.46	270,310.93	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	415.75	279,384.00	
	GIVAUDAN-REG	651	1,810.00	1,178,310.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	31,197	42.66	1,330,864.02	
	SIKA AG-BR	164	3,562.00	584,168.00	
	SYNGENTA AG	6,705	367.90	2,466,769.50	
	ABB LTD	158,155	16.46	2,603,231.30	
	GEBERIT AG-REG	2,683	337.20	904,707.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	152.00	205,504.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,393	152.00	515,736.00	
	SULZER AG-REG	1,607	86.55	139,085.85	
	ADECCO	12,082	60.65	732,773.30	
	SGS SA	406	1,849.00	750,694.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,072	131.60	535,875.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	37,577	63.75	2,395,533.75	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,199	325.90	716,654.10	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	63.45	249,866.10	
	DUFREY AG-REG	2,999	102.00	305,898.00	
	ARYZTA AG	5,619	44.12	247,910.28	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,074.00	141,768.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,485.00	411,375.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	65,320.00	457,240.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	231,550	71.25	16,497,937.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	119.60	495,144.00	
	ACTELION LTD-REG	7,281	131.70	958,907.70	
	GALENICA AG-REG	291	1,386.00	403,326.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,988	152.30	607,372.40	
	NOVARTIS	165,204	81.80	13,513,687.20	
	ROCHE HOLDING GENUSS	51,013	259.80	13,253,177.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	133,255	18.62	2,481,208.10	

	JULIUS BAER GROUP LTD	16,269	42.86	697,289.34	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	57.90	109,778.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,221	361.25	441,086.25	
	UBS GROUP AG	271,302	17.04	4,622,986.08	
	BALOISE HOLDING AG	3,877	123.30	478,034.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,458	262.30	644,733.40	
	SWISS RE LTD	25,911	94.20	2,440,816.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,018	246.70	2,718,140.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,038	75.95	382,636.10	
	SWISSCOM	1,834	482.20	884,354.80	
	スイスフラン 小計	1,241,790		79,054,274.50 (9,265,160,971)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	113.40	1,609,259.40	
	BOLIDEN AB	18,196	116.80	2,125,292.80	
	ALFA LAVAL AB	19,284	139.80	2,695,903.20	
	ASSA ABLOY AB-B	70,136	168.50	11,817,916.00	
	ATLAS COPCO A	47,043	184.70	8,688,842.10	
	ATLAS COPCO B	29,087	174.90	5,087,316.30	
	SANDVIK AB	79,113	67.95	5,375,728.35	
	SKANSKA B	28,530	154.00	4,393,620.00	
	SKF AB-B	27,040	125.60	3,396,224.00	
	VOLVO B	107,905	74.75	8,065,898.75	
	SECURITAS B	22,844	117.40	2,681,885.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	182.50	3,316,025.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	49.45	1,372,633.10	
	HENNES & MAURITZ B	68,398	288.90	19,760,182.20	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	287.40	1,646,802.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	288.80	4,375,031.20	
	SCA SV CELLULOSA B	41,445	239.30	9,917,788.50	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	195.80	3,102,451.00	
	NORDEA BANK AB	222,952	86.95	19,385,676.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	108,437	79.40	8,609,897.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	112,895	100.40	11,334,658.00	
	SWEDBANK AB-A	64,426	171.30	11,036,173.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	130.30	1,666,797.60	
	INVESTOR AB-B SHS	32,558	282.70	9,204,146.60	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	18,104	227.60	4,120,470.40	
	ERICSSON (LM) B	219,832	77.05	16,938,055.60	
	HEXAGON AB-B SHS	18,602	285.20	5,305,290.40	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	396.90	1,718,180.10	
	TELE2 AB-B SHS	21,310	77.65	1,654,721.50	
	TELIASONERA AB	182,966	39.20	7,172,267.20	

スウェーデンクローナ 小計		1,675,067		197,575,134.90 (2,722,585,358)	
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	78,540	105.50	8,285,970.00	
	NORSK HYDRO	106,150	27.54	2,923,371.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	352.60	4,749,522.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	263.20	1,834,767.20	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	265.00	1,588,675.00	
	ORKLA	60,218	67.90	4,088,802.20	
	DNB ASA	70,441	96.15	6,772,902.15	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	133.70	1,802,409.70	
	TELENOR ASA	53,105	137.80	7,317,869.00	
ノルウェークローネ 小計		408,371		39,364,288.25 (525,119,605)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	409.00	3,027,009.00	
	NOVOZYMES A/S	17,281	268.50	4,639,948.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS	15,987	441.20	7,053,464.40	
	ISS A/S	11,663	228.70	2,667,328.10	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	7,765.00	2,321,735.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	7,850.00	3,987,800.00	
	DSV A/S	14,580	250.80	3,656,664.00	
	PANDORA A/S	8,093	882.50	7,142,072.50	
	CARLSBERG AS-B	8,005	536.00	4,290,680.00	
	COLOPLAST-B	8,335	528.00	4,400,880.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	602.50	894,110.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,529	367.20	52,336,648.80	
	DANSKE BANK A/S	50,272	175.80	8,837,817.60	
	TRYG A/S	9,828	115.90	1,139,065.20	
	TDC A/S	52,498	33.91	1,780,207.18	
デンマーククローネ 小計		348,763		108,175,430.28 (1,860,617,400)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	35.75	737,486.75	
	OIL SEARCH LTD	101,778	5.76	586,241.28	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	131,447	3.82	502,127.54	
	SANTOS	128,132	2.68	343,393.76	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	53,718	26.11	1,402,576.98	
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.05	178,980.90	
	AMCOR	88,019	13.06	1,149,528.14	
	BHP BILLITON LTD	230,444	14.73	3,394,440.12	
	BORAL LIMITED	46,867	5.44	254,956.48	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	136,041	1.53	208,142.73	
	ILUKA RESOURCES LTD	28,555	5.60	159,908.00	
	INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.37	371,333.56	

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	15.12	445,253.76
NEWCREST MINING LIMITED	58,258	13.24	771,335.92
ORICA LTD	29,211	14.18	414,211.98
RIO TINTO LTD	31,029	38.82	1,204,545.78
SOUTH32 LTD	354,855	0.90	319,369.50
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	23.18	213,719.60
BRAMBLES LTD	116,593	10.75	1,253,374.75
SEEK LTD	21,328	13.90	296,459.20
ASCIANO GROUP	47,074	8.43	396,833.82
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	3.75	598,076.25
QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	4.04	137,986.20
TRANSURBAN GROUP	140,834	10.29	1,449,181.86
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	9.28	405,768.00
CROWN RESORTS LTD	30,328	11.88	360,296.64
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	37.27	121,612.01
TABCORP HOLDINGS	62,731	4.48	281,034.88
TATTS GROUP LTD	93,361	3.99	372,510.39
REA GROUP LTD	3,593	50.50	181,446.50
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	4.29	132,183.48
WESFARMERS LTD	82,583	39.70	3,278,545.10
WOOLWORTHS LTD	90,378	23.35	2,110,326.30
COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	8.16	310,112.64
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	7.64	445,985.00
COCHLEAR LIMITED	3,856	93.15	359,186.40
HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.40	336,669.60
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,773	61.12	658,445.76
SONIC HEALTHCARE LTD	24,730	17.69	437,473.70
CSL LIMITED	33,087	103.69	3,430,791.03
AUST AND NZ BANKING GROUP	209,507	24.59	5,151,777.13
BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	12.71	309,831.67
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	10.61	331,085.05
COMMONWEALTH BANK OF AUST	123,602	79.19	9,788,042.38
NATIONAL AUSTRALIA BANK	191,804	27.03	5,184,462.12
WESTPAC BANKING	241,614	31.18	7,533,524.52
ASX LTD	12,620	38.71	488,520.20
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	7.91	348,577.88
MACQUARIE GROUP LIMITED	21,772	73.91	1,609,168.52
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	6.54	132,284.58
AMP LTD	217,702	5.27	1,147,289.54
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	175,295	5.00	876,475.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.17	465,491.04
QBE INSURANCE GROUP	100,546	10.83	1,088,913.18

	SUNCORP GROUP LIMITED	95,154	11.30	1,075,240.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	10.61	326,968.37	
	TELSTRA CORP	308,815	5.36	1,655,248.40	
	TPG TELECOM LTD	20,000	9.64	192,800.00	
	AGL ENERGY LTD	50,606	17.68	894,714.08	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.44	173,732.35	
	オーストラリアドル 小計	5,282,119		68,785,998.50 (5,583,359,498)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	6.78	315,609.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,160	5.49	336,074.20	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	8.15	179,430.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.37	490,890.37	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	4.70	277,126.10	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.35	259,778.40	
	MIGHTY RIVER POWER	61,741	2.79	172,257.39	
	ニュージーランドドル 小計	506,423		2,031,165.86 (152,357,751)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	194,496	96.50	18,768,864.00	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	11.46	1,134,540.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	12.54	1,078,440.00	
	MTR CORP	94,000	36.40	3,421,600.00	
	LI & FUNG	378,800	4.52	1,712,176.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	30.10	2,814,350.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	25.85	1,202,025.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	22.35	3,933,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	8.78	590,016.00	
	SANDS CHINA LTD	174,000	23.15	4,028,100.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	7.27	712,460.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	4.73	624,360.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	7.58	779,224.00	
	WH GROUP LTD	476,500	4.21	2,006,065.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	23.45	1,987,622.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	262,500	21.05	5,525,625.00	
	HANG SENG BANK	54,100	129.10	6,984,310.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	4.84	619,520.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,300	177.10	14,398,230.00	
	AIA GROUP LTD	878,400	42.45	37,288,080.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	188,996	44.65	8,438,671.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.52	2,684,960.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	86,360	42.95	3,709,162.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	30.95	1,238,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	19.40	746,900.00	

	NEW WORLD DEVELOPMENT	399,500	6.83	2,728,585.00	
	SINO LAND CO	235,400	10.10	2,377,540.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	127,000	85.85	10,902,950.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	74.20	3,005,100.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.40	1,962,480.00	
	WHARF HOLDINGS	99,000	38.15	3,776,850.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	31.30	2,034,500.00	
	PCCW LTD	357,000	4.51	1,610,070.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	71.55	2,933,550.00	
	CLP HOLDINGS	133,000	63.30	8,418,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	491,679	14.46	7,109,678.34	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	98,500	68.95	6,791,575.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	54.00	745,200.00	
	香港ドル 小計	6,432,291		180,823,878.74 (2,717,782,897)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.18	581,714.00	
	NOBLE GROUP LTD	297,563	0.30	89,268.90	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	2.54	144,780.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	1.48	90,132.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	2.92	318,280.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	0.94	125,020.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	2.91	421,950.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	11.09	480,562.97	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.70	299,625.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	3.55	451,205.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	34.79	344,421.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.35	148,745.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	155,000	2.78	430,900.00	
	DBS GROUP	128,600	14.48	1,862,128.00	
	OCBC BANK	220,100	7.92	1,743,192.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	90,900	17.52	1,592,568.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	6.89	378,950.00	
	CAPITALAND LTD	185,500	3.09	573,195.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	7.28	174,720.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	1.89	470,610.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	5.74	186,550.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	582,643	3.50	2,039,250.50	
	STARHUB LTD	38,000	3.41	129,580.00	
	シンガポールドル 小計	3,700,339		13,077,347.37 (1,069,857,788)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	435	620.00	269,700.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	15.87	519,837.72	

	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	62,993	251.30	15,830,140.90	
	BANK HAPOLIM BM	80,056	18.60	1,489,041.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,989	13.12	1,246,255.68	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	44.00	360,800.00	
	AZRIELI GROUP	1,780	146.30	260,414.00	
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	226.00	758,908.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	8.70	1,345,072.20	
	イスラエルシェケル 小計	439,173		22,080,170.10 (653,352,233)	
	合 計	83,789,010		222,546,663,966 (222,546,663,966)	

(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	236,450.00	
		アメリカドル 小計		472,900	236,450.00 (27,794,697)
	オーストラリアドル	APA GROUP	74,495	615,328.70	
		DUET GROUP	177,921	402,101.46	
		LENDLEASE GROUP	44,009	567,276.01	
		SYDNEY AIRPORT	70,759	446,489.29	
	オーストラリアドル 小計		367,184	2,031,195.46 (164,872,135)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,316,385.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,845,690.00	
	香港ドル 小計		407,500	3,162,075.00 (47,525,987)	
投資信託受益証券合計			1,247,584	240,192,819 (240,192,819)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	27,108	447,282.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	30,408	2,764,391.28	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70,023	616,202.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,771	1,742,657.85	
		BOSTON PROPERTIES	11,357	1,355,230.81	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,835	328,961.05	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,979	438,320.49	
		CROWN CASTLE INTL CORP	24,087	1,914,916.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,665	725,841.50	
		DUKE REALTY CORP	26,052	506,190.36	
		EQUINIX INC	4,372	1,290,220.92	

	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	26,298	2,082,275.64	
	ESSEX PROPERTY TRUST	4,774	1,109,143.42	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,793	778,180.50	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,879	723,750.86	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	40,144	1,060,604.48	
	HCP INC	34,359	1,256,165.04	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	52,693	675,524.26	
	IRON MOUNTAIN INC	14,074	349,457.42	
	KIMCO REALTY CORP	29,179	750,192.09	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	342,719.78	
	MACERICH CO/THE	10,128	776,716.32	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	13,249	541,619.12	
	PROLOGIS INC	38,599	1,506,904.96	
	PUBLIC STORAGE	10,592	2,652,660.48	
	REALTY INCOME CORP	16,219	859,769.19	
	REGENCY CENTERS CORP	7,269	504,395.91	
	SIMON PROPERTY GROUP	22,304	4,157,465.60	
	SL GREEN REALTY CORP	7,346	735,040.76	
	UDR INC	18,412	660,070.20	
	VENTAS INC	24,536	1,364,937.68	
	VEREIT INC	67,784	479,232.88	
	VORNADO REALTY TRUST	12,616	1,149,948.40	
	WELLTOWER INC	25,401	1,721,425.77	
アメリカドル 小計		733,127	38,368,415.92 (4,510,207,291)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	175,768.45	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	244,882.88	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5,631	165,889.26	
カナダドル 小計		25,569	586,540.59 (47,286,902)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	174,081.60	
	GECINA SA	2,522	279,689.80	
	ICADE	2,845	175,963.25	
	KLEPIERRE	16,799	631,474.41	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,385	1,639,839.25	
ユーロ 小計		31,861	2,901,048.31 (372,436,582)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	74,136	530,072.40	
	HAMMERSON PLC	61,184	348,442.88	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	213,265.07	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,520	610,981.20	
	SEGRO PLC	48,938	204,609.77	

イギリスポンド 小計		314,267	1,907,371.32 (317,729,914)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	538,634.30	
	GOODMAN GROUP	119,536	725,583.52	
	GPT GROUP	136,015	632,469.75	
	MIRVAC GROUP	241,410	452,643.75	
	SCENTRE GROUP	389,348	1,619,687.68	
	STOCKLAND	182,732	741,891.92	
	VICINITY CENTERS	254,887	734,074.56	
	WESTFIELD CORP	144,920	1,383,986.00	
オーストラリアドル 小計		1,542,938	6,828,971.48 (554,307,615)	
香港ドル	LINK REIT	163,000	7,335,000.00	
香港ドル 小計		163,000	7,335,000.00 (110,245,050)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,300	309,792.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	195,195.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	392,588.00	
	SUNTEC REIT	173,000	268,150.00	
シンガポールドル 小計		654,600	1,165,725.00 (95,367,962)	
投資証券合計		3,465,362	6,007,581,316 (6,007,581,316)	
合計			6,247,774,135 (6,247,774,135)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 604銘柄	96.9%	—	—	62.9%
	投資信託受 1銘柄 益証券	—	0.0%	—	0.0%
	投資証券 34銘柄	—	—	3.0%	2.0%
カナダドル	株式 90銘柄	99.4%	—	—	3.2%
	投資証券 3銘柄	—	—	0.6%	0.0%
ユーロ	株式 229銘柄	98.7%	—	—	12.5%
	投資証券 5銘柄	—	—	1.3%	0.2%

イギリスポンド	株式	108銘柄	98.3%	—	—	7.9%
	投資証券	5銘柄	—	—	1.7%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%	—	—	4.0%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%	—	—	1.2%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式	60銘柄	88.6%	—	—	2.4%
	投資信託受益証券	4銘柄	—	2.6%	—	0.1%
	投資証券	8銘柄	—	—	8.8%	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	—	1.7%	—	0.0%
	投資証券	1銘柄	—	—	3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式	23銘柄	91.8%	—	—	0.5%
	投資証券	4銘柄	—	—	8.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%	—	—	0.3%

(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。

新興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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	139,021,847
コール・ローン	63,327,987
国債証券	15,453,326,598
未収利息	233,231,368
前払費用	32,600,911
流動資産合計	15,921,508,711
資産合計	15,921,508,711
負債の部	
流動負債	
未払金	36,911,770

	平成28年 1月20日現在
項目	金額（円）
未払解約金	9,339,727
流動負債合計	46,251,497
負債合計	46,251,497
純資産の部	
元本等	
元本	11,182,201,829
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,693,055,385
元本等合計	15,875,257,214
純資産合計	15,875,257,214
負債純資産合計	15,921,508,711

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 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
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	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成28年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,182,201,829口
2.	1口当たり純資産額 1.4197円

	平成28年 1月20日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(14,197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 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月20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。

	平成28年 1月20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。

（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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年 1月21日
期首元本額	7,903,790,507円
期中追加設定元本額	3,847,224,518円
期中一部解約元本額	568,813,196円
期末元本額	11,182,201,829円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,094,360,472円
世界経済インデックスファンド	1,837,945,292円
DC新興国債券インデックス・オープン	2,670,895,283円
DC世界経済インデックスファンド	1,843,608,559円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	583,984,091円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	22,354,558円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	45,910,583円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	656,143,780円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	145,423,656円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	93,320,803円
新興国債券インデックス・オープン	8,730,886円
SMT インデックスバランス・オープン	179,523,866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 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△181,394,812
合計	△181,394,812

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「新興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）

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	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	7,500,000.00	10,046,850.00	
		MBONO 10% 12/05/24	20,250,000.00	25,798,702.50	
		MBONO 4.75% 06/14/18	23,200,000.00	23,412,396.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	3,900,000.00	3,764,494.50	
		MBONO 5% 06/15/17	11,200,000.00	11,382,952.00	
		MBONO 5% 12/11/19	9,900,000.00	9,888,961.50	
		MBONO 6.5% 06/09/22	14,300,000.00	14,928,199.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	13,500,000.00	14,167,845.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	7,150,000.00	7,809,337.25	
		MBONO 7.75% 05/29/31	12,450,000.00	13,672,465.50	
		MBONO 7.75% 11/13/42	10,600,000.00	11,572,868.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	6,650,000.00	7,258,308.75	
		MBONO 7.75% 12/14/17	13,000,000.00	13,914,680.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	8,600,000.00	10,080,834.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	11,900,000.00	14,016,712.50	
		MBONO 8.5% 12/13/18	23,600,000.00	26,084,726.00	

	MBONO 8% 06/11/20	11,100,000.00	12,332,211.00	
	MBONO 8% 12/07/23	13,700,000.00	15,463,464.00	
メキシコペソ 小計		222,500,000.00	245,596,007.50 (1,579,182,328)	
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/18	5,950,000.00	4,443,912.20	
	BLTN 0% 01/01/19	8,350,000.00	5,321,404.90	
	BLTN 0% 07/01/17	9,300,000.00	7,519,050.00	
	BLTN 0% 07/01/18	9,100,000.00	6,291,012.00	
	BLTN 0% 07/01/19	8,800,000.00	5,205,534.40	
	BLTN 0% 10/01/17	1,850,000.00	1,435,616.65	
	BNTNF 10% 01/01/18	1,500,000.00	1,360,211.34	
	BNTNF 10% 01/01/19	5,950,000.00	5,124,541.99	
	BNTNF 10% 01/01/21	9,250,000.00	7,385,769.45	
	BNTNF 10% 01/01/23	7,200,000.00	5,408,492.84	
	BNTNF 10% 01/01/25	8,150,000.00	5,834,711.83	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	700,000.00	635,250.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	468,281.25	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	300,000.00	263,062.50	
ブラジルレアル 小計		76,850,000.00	56,696,851.35 (1,639,672,941)	
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	100,000,000.00	103,626,000.00	
チリペソ 小計		100,000,000.00	103,626,000.00 (16,777,049)	
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	8,450,000,000.00	7,027,907,250.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	14,000,000,000.00	14,213,990,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	5,030,000,000.00	5,723,184,300.00	
コロンビアペソ 小計		27,480,000,000.00	26,965,081,550.00 (957,260,395)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.2% 09/12/23	1,300,000.00	1,162,954.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	1,650,000.00	1,504,577.25	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	1,500,000.00	1,351,380.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	1,400,000.00	1,298,528.00	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,400,000.00	1,476,965.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	1,400,000.00	1,480,990.00	
ペルーヌエボソル 小計		8,650,000.00	8,275,394.25 (282,935,729)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,750,000.00	1,695,977.50	
	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000.00	2,663,887.50	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	1,900,000.00	1,880,553.50	
	TURKGB 6.3% 02/14/18	2,650,000.00	2,430,474.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	3,850,000.00	3,123,081.50	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	3,100,000.00	2,749,204.00	
	TURKGB 8.3% 06/20/18	3,250,000.00	3,074,646.25	

	TURKGB 8.5% 07/10/19	2,650,000.00	2,469,177.25	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	2,400,000.00	2,127,924.00	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	2,950,000.00	2,621,207.75	
	TURKGB 8.8% 11/14/18	3,100,000.00	2,945,899.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	2,350,000.00	1,959,065.75	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	2,350,000.00	2,224,498.25	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,812,155.00	
	TURKGB 9% 03/08/17	2,250,000.00	2,206,068.75	
	TURKGB 9% 07/24/24	2,700,000.00	2,424,708.00	
トルコリラ 小計		42,950,000.00	39,408,528.00 (1,525,898,204)	
ハンガリー フォリント	HGB 2.5% 06/22/18	120,000,000.00	121,942,800.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	244,000,000.00	254,382,200.00	
	HGB 4% 04/25/18	165,000,000.00	173,194,725.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	215,000,000.00	251,357,575.00	
	HGB 5.5% 12/20/18	170,000,000.00	187,195,500.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	218,000,000.00	258,823,770.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	312,000,000.00	355,572,360.00	
	HGB 6.75% 02/24/17	123,000,000.00	130,597,095.00	
	HGB 6.75% 11/24/17	120,000,000.00	131,291,400.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	194,000,000.00	236,428,770.00	
	HGB 7% 06/24/22	173,000,000.00	212,599,700.00	
ハンガリーフォリント 小計		2,054,000,000.00	2,313,385,895.00 (941,779,397)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0% 07/25/17	1,250,000.00	1,224,200.00	
	POLGB 1.5% 04/25/20	4,100,000.00	3,983,806.00	
	POLGB 2.5% 07/25/18	5,400,000.00	5,517,747.00	
	POLGB 2% 04/25/21	1,300,000.00	1,269,879.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	3,200,000.00	3,343,184.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,500,000.00	4,550,625.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	3,750,000.00	3,933,825.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,200,000.00	2,291,883.00	
	POLGB 4% 10/25/23	5,700,000.00	6,122,683.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,250,000.00	5,593,770.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	4,650,000.00	5,274,564.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	3,700,000.00	4,172,619.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,850,000.00	4,559,766.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,050,000.00	3,574,249.25	
ポーランドズロチ 小計		51,900,000.00	55,412,802.75 (1,598,659,359)	
ロシアルー ブル	RFLB 6.2% 01/31/18	9,000,000.00	8,355,510.00	
	RFLB 6.4% 05/27/20	45,000,000.00	39,010,050.00	

	RFLB 6.7% 05/15/19	50,500,000.00	45,477,017.50	
	RFLB 6.8% 12/11/19	28,700,000.00	25,583,754.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	47,900,000.00	37,563,180.00	
	RFLB 7.4% 04/19/17	7,000,000.00	6,790,910.00	
	RFLB 7.4% 06/14/17	45,000,000.00	43,432,200.00	
	RFLB 7.5% 02/27/19	32,500,000.00	30,108,162.50	
	RFLB 7.5% 03/15/18	14,300,000.00	13,599,014.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	43,700,000.00	39,131,165.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	40,000,000.00	35,082,400.00	
	RFLB 7% 01/25/23	38,000,000.00	31,956,480.00	
	RFLB 7% 08/16/23	47,000,000.00	39,088,020.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	48,500,000.00	41,908,365.00	
	RUSSIA 7.85% 03/10/18	85,000,000.00	80,905,550.00	
ロシアルーブル 小計		582,100,000.00	517,991,778.00 (771,807,749)	
マレーシア リングgit	MGS 3.26% 03/01/18	2,400,000.00	2,408,064.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	3,170,000.00	3,201,557.35	
	MGS 3.394% 03/15/17	1,800,000.00	1,814,427.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	3,100,000.00	3,003,915.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	3,150,000.00	3,024,472.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,850,000.00	2,854,232.25	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,350,000.00	2,373,711.50	
	MGS 3.654% 10/31/19	2,800,000.00	2,825,158.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	3,400,000.00	3,443,163.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,050,000.00	971,271.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,300,000.00	1,295,768.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	550,000.00	495,110.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,600,000.00	1,625,200.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	950,000.00	897,845.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,600,000.00	2,569,749.00	
	MGS 4.012% 09/15/17	3,150,000.00	3,214,779.75	
	MGS 4.048% 09/30/21	3,050,000.00	3,099,654.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,950,000.00	1,837,728.75	
	MGS 4.16% 07/15/21	3,150,000.00	3,220,497.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,200,000.00	2,203,212.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,800,000.00	2,862,118.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,650,000.00	2,743,028.25	
	MGS 4.392% 04/15/26	3,200,000.00	3,210,496.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,330,000.00	2,314,470.55	
	MGS 5.734% 07/30/19	2,150,000.00	2,316,926.00	
マレーシアリングgit 小計		59,700,000.00	59,826,554.90 (1,605,744,733)	
タイバーツ	THAIGB 2.55% 06/26/20	11,500,000.00	11,866,102.50	

	THAIGB 2.8% 10/10/17	20,000,000.00	20,446,800.00	
	THAIGB 3.25% 06/16/17	47,100,000.00	48,320,125.50	
	THAIGB 3.45% 03/08/19	13,000,000.00	13,737,555.00	
	THAIGB 3.58% 12/17/27	18,500,000.00	20,339,547.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	40,000,000.00	43,573,400.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	72,500,000.00	78,688,600.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	41,900,000.00	47,030,655.00	
	THAIGB 3.875% 06/13/19	93,700,000.00	100,810,893.00	
	THAIGB 4.75% 12/20/24	12,262,000.00	14,520,169.92	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	39,450,000.00	49,478,190.00	
	THAIGB 5.125% 03/13/18	20,800,000.00	22,385,376.00	
タイバーツ 小計		430,712,000.00	471,197,414.42 (1,526,679,622)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	10,000,000.00	9,665,350.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	5,000,000.00	5,145,175.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	10,000,000.00	11,128,150.00	
フィリピンペソ 小計		25,000,000.00	25,938,675.00 (65,365,461)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	7,105,644,000.00	
	INDOGB 10% 07/15/17	2,500,000,000.00	2,564,725,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	5,200,000,000.00	5,949,060,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	4,100,000,000.00	4,482,694,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	5,700,000,000.00	6,712,434,000.00	
	INDOGB 5.25% 05/15/18	4,700,000,000.00	4,396,333,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	5,500,000,000.00	4,606,855,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	11,000,000,000.00	8,791,310,000.00	
	INDOGB 6.25% 04/15/17	1,600,000,000.00	1,567,808,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	19,125,840,000.00	
	INDOGB 7.875% 04/15/19	14,800,000,000.00	14,565,272,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	8,000,000,000.00	7,373,440,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	6,000,000,000.00	5,242,860,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	12,300,000,000.00	11,551,545,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	11,100,000,000.00	10,978,788,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	31,500,000,000.00	31,010,805,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	6,000,000,000.00	5,705,880,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	7,200,000,000.00	7,088,184,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	6,900,000,000.00	7,222,023,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,000,000,000.00	19,249,090,000.00	
インドネシアルピア 小計		193,400,000,000.00	185,290,590,000.00 (1,574,970,015)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	32,700,000.00	34,349,061.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	20,900,000.00	13,928,909.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	18,200,000.00	12,073,607.00	

	SAGB 6.75% 03/31/21	15,700,000.00	13,998,434.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	16,300,000.00	15,230,149.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	12,000,000.00	10,862,280.00	
	SAGB 7% 02/28/31	20,400,000.00	15,556,224.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	10,800,000.00	9,153,432.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	12,900,000.00	12,839,241.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	12,950,000.00	10,991,506.75	
	SAGB 8.75% 02/28/48	21,400,000.00	18,306,095.00	
	SAGB 8% 01/31/30	17,950,000.00	15,185,341.00	
	SAGB 8% 12/21/18	12,800,000.00	12,474,880.00	
	南アフリカランド 小計	225,000,000.00	194,949,160.75 (1,366,593,616)	
合計			15,453,326,598 (15,453,326,598)	

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
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.0%	10.2%
ブラジルリアル	国債証券 14銘柄	100.0%	10.6%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	6.2%
ペルーヌエボソル	国債証券 6銘柄	100.0%	1.8%
トルコリラ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.9%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.0%	6.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	10.3%
ロシアルーブル	国債証券 15銘柄	100.0%	5.0%
マレーシアリンギット	国債証券 25銘柄	100.0%	10.4%
タイバーツ	国債証券 12銘柄	100.0%	9.9%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.4%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	8.8%

(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

該当事項はありません。

新興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 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	357,640,075
コール・ローン	4,522,053
株式	21,011,477,801
投資信託受益証券	44,360,920
投資証券	99,513,890
派生商品評価勘定	455,506
未収入金	388,737
未収配当金	15,880,934
未収利息	6
前払金	49,573,187
差入委託証拠金	125,988,239
流動資産合計	21,709,801,348
資産合計	21,709,801,348
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	50,028,693
未払金	2,238
未払解約金	1,406,247
流動負債合計	51,437,178
負債合計	51,437,178
純資産の部	
元本等	
元本	11,448,031,282
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,210,332,888
元本等合計	21,658,364,170
純資産合計	21,658,364,170
負債純資産合計	21,709,801,348

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 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

	(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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,448,031,282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 1.8919円 (1万口当たり純資産額) (18,919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 1月20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 1月20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 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年 1月21日
期首元本額	9,114,836,588円
期中追加設定元本額	2,834,445,604円
期中一部解約元本額	501,250,910円
期末元本額	11,448,031,282円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	5,583,412,065円
世界経済インデックスファンド	1,344,021,169円
DC新興国株式インデックス・オープン	2,470,895,907円
DC世界経済インデックスファンド	1,294,195,848円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	15,975,679円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	99,739,654円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	147,398,050円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	334,445,541円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	20,178,058円

新興国株式インデックス・オープン	16,540,681円
SMT インデックスバランス・オープン	121,228,630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 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△2,807,465,127
投資信託受益証券	△5,511,637
投資証券	△13,735,998
合計	△2,826,712,762

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「新興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 1月20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	601,302,340	—	551,729,153	△49,573,187
合計		601,302,340	—	551,729,153	△49,573,187

(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 1月20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	61,120,800	—	61,120,800	—
	アメリカドル	61,120,800	—	61,120,800	—
合計		61,120,800	—	61,120,800	—

(注)時価の算定方法

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

- ①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。
- ②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	GAZPROM OAO-SPON ADR	370,616	3.16	1,172,999.64	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	31,398	27.41	860,619.18	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	5,323	72.50	385,917.50	
	ROSNEFT OJSC-GDR	81,895	2.94	241,508.35	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	81,414	4.28	348,858.99	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	13,624	22.96	312,807.04	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	3.38	57,223.40	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	34,033	10.87	370,108.87	
	SEVERSTAL - GDR REG S	15,540	7.98	124,086.90	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,196	22.29	204,978.84	
	DP WORLD LTD	10,914	17.15	187,175.10	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	3,305	28.89	95,481.45	

	TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,460	43.83	63,991.80	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	7,952	42.01	334,063.52	
	JD.COM INC-ADR	9,040	27.41	247,786.40	
	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	1,562	41.00	64,042.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,631	14.01	148,940.31	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	15,136	32.50	491,920.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	79,426	3.69	293,081.94	
	CREDICORP LTD	3,627	87.59	317,688.93	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	165,287	4.59	759,989.62	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	162,413	1.72	279,350.36	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	25,200	3.52	88,754.40	
	58.COM INC-ADR	2,035	56.10	114,163.50	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	29,280	70.13	2,053,406.40	
	BAIDU INC - SPON ADR	8,081	166.03	1,341,688.43	
	NETEASE INC-ADR	2,549	161.65	412,045.85	
	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	2,595	71.01	184,270.95	
	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	8,433	6.01	50,682.33	
	YOUKU TUDOU INC-ADR	3,319	27.19	90,243.61	
	YY INC-ADR	1,029	57.65	59,321.85	
	GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	38,757	1.14	44,182.98	
	MEGAFON-PJSC	10,762	10.00	107,620.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	40,335	5.51	222,245.85	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	12,444	6.57	81,757.08	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	85,721	0.79	68,062.47	
	アメリカドル 小計	1,401,262		12,281,065.84 (1,443,639,289)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	886,984	7.52	6,670,119.68	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	226,792	33.98	7,706,392.16	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	158.53	1,573,410.25	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	62,190	36.01	2,239,461.90	
	ALFA S.A.B.-A	175,000	30.90	5,407,500.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	64.94	2,435,250.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	11,200	196.34	2,199,008.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	9,900	227.44	2,251,656.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,480	144.50	2,525,860.00	
	OHL MEXICO SAB DE CV	37,600	16.71	628,296.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	140,690	94.74	13,328,970.60	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	198.13	2,159,617.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	19,600	45.25	886,900.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	271,980	44.72	12,162,945.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	23,075	102.00	2,353,650.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	29,500	117.94	3,479,230.00	

	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	101,440	158.96	16,124,902.40	
	GRUMA S.A.B.-B	9,800	246.41	2,414,818.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	103,500	46.73	4,836,555.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	40.10	1,435,580.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	92,600	39.57	3,664,182.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	107,300	26.99	2,896,027.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	139,800	85.94	12,014,412.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	150,500	28.01	4,215,505.00	
	GENTERA SAB DE CV	77,100	29.29	2,258,259.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	1,849,440	11.32	20,935,660.80	
	メキシコペソ 小計	4,637,596		138,804,168.39 (892,510,802)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	4,300	22.10	95,030.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	156,400	6.15	961,860.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	244,140	4.66	1,137,692.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	19,600	54.70	1,072,120.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	24.50	218,050.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	23,400	3.28	76,752.00	
	DURATEX SA	21,672	5.18	112,260.96	
	FIBRIA CELULOSE SA	13,900	44.06	612,434.00	
	GERDAU SA-PREF	43,200	3.44	148,608.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	18,500	15.38	284,530.00	
	VALE SA	86,700	9.18	795,906.00	
	VALE SA-PREF A	112,215	7.04	789,993.60	
	EMBRAER SA	41,400	27.42	1,135,188.00	
	WEG SA	31,440	14.07	442,360.80	
	CCR SA	41,500	11.55	479,325.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	10,890	21.80	237,402.00	
	ESTACIO PARTICIPACOES SA	13,800	11.66	160,908.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	72,684	8.34	606,184.56	
	B2W CIA DIGITAL	6,700	13.75	92,125.00	
	LOJAS AMERICANAS SA	9,000	11.10	99,900.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	31,847	18.39	585,666.33	
	LOJAS RENNER S.A.	29,500	16.44	484,980.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	35.00	378,000.00	
	RAIA DROGASIL SA	12,900	37.66	485,814.00	
	AMBEV SA	258,700	16.75	4,333,225.00	
	BRF SA	34,700	47.15	1,636,105.00	
	JBS SA	44,400	10.48	465,312.00	
	M DIAS BRANCO SA	2,100	57.45	120,645.00	
	HYPERMARCAS SA	21,600	20.90	451,440.00	
	NATURA COSMETICOS SA	10,700	22.00	235,400.00	

	ODONTOPREV S.A.	12,400	9.10	112,840.00	
	QUALICORP SA	8,300	12.59	104,497.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	48,280	18.24	880,627.20	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	138,880	17.22	2,391,513.60	
	BANCO DO BRASIL S.A.	63,500	12.84	815,340.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	180,129	23.40	4,215,018.60	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	217,872	6.35	1,383,487.20	
	BM&FBOVESPA SA	105,200	10.53	1,107,756.00	
	CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,405	36.91	420,958.55	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,000	22.69	1,021,050.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	25.30	184,690.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	22,400	11.30	253,120.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	38.89	213,895.00	
	CIELO SA	51,924	32.50	1,687,530.00	
	TOTVS SA	7,300	29.82	217,686.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	19,400	32.74	635,156.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	41,200	5.93	244,316.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	8.72	154,344.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	10,300	11.65	119,995.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	35,892	4.29	153,976.68	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,300	17.85	58,905.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	19.10	498,510.00	
	CPFL ENERGIA SA	15,652	14.07	220,223.64	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	4,700	11.03	51,841.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	7,500	33.25	249,375.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	5,700	30.40	173,280.00	
	ブラジルリアル 小計	2,550,422		36,305,149.12 (1,049,944,912)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	23,727	5,425.40	128,728,465.80	
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	1,460.40	123,082,512.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	11,814.00	85,769,640.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	3,329.20	73,598,624.40	
	S.A.C.I. FALABELLA	51,520	4,536.00	233,694,720.00	
	CENCOSUD SA	67,389	1,365.30	92,006,201.70	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	6,914.80	64,466,680.40	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,801.50	27,404,418.00	
	BANCO DE CHILE	1,114,705	69.29	77,237,909.45	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,221	25,901.00	57,526,121.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	4,238,261	29.10	123,333,395.10	
	CORPBANCA	15,284,724	5.28	80,733,912.16	
	SONDA SA	34,296	1,165.20	39,961,699.20	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	6,349.10	38,691,415.40	

	AES GENER SA	141,749	308.82	43,774,926.18	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	351.48	57,378,407.04	
	COLBUN SA	475,888	160.34	76,303,881.92	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	158,195	853.01	134,941,916.95	
	ENERSIS SA	1,030,498	156.82	161,602,696.36	
	チリペソ 小計	22,930,697		1,720,237,543.06 (278,506,458)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	923.00	329,812,821.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	9,500.00	304,104,500.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	15,100.00	267,617,300.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	33,879	21,600.00	731,786,400.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,005.00	305,226,540.00	
	CORP FIN COLOMBIANA-CD	4,296	36,240.00	155,687,040.00	
	CORP FINANCIERA COLOMB-ND	39	35,280.00	1,375,920.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	31,660.00	460,716,320.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	4,705	31,200.00	146,796,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	20,793	7,180.00	149,293,740.00	
	コロンビアペソ 小計	789,033		2,852,416,581.00 (101,260,788)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	7,408	73.60	545,228.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	61,323	2.99	183,355.77	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	32,009	5.00	160,045.00	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	31,657	4.17	132,009.69	
	KOC HOLDING AS	38,796	11.38	441,498.48	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	36,454	2.93	106,810.22	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	17.08	167,998.88	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,354	7.23	233,919.42	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	30.76	100,216.08	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	19.22	129,735.00	
	ARCELIK AS	15,358	14.80	227,298.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	10,345	49.14	508,353.30	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	17.18	192,931.40	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	32.58	143,905.86	
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	17.73	170,668.98	
	AKBANK T.A.S.	132,833	6.87	912,562.71	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	137,163	7.17	983,458.71	
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	9.99	523,785.69	
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	4.53	503,595.57	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	3.72	193,227.96	
	YAPI VE KREDI BANKASI	105,585	3.49	368,491.65	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	8.09	497,098.14	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	5.15	91,649.40	

	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	37,702	9.87	372,118.74	
トルコリラ 小計		1,018,889		7,889,963.85 (305,499,400)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,455	4,748.00	6,908,340.00	
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	249.00	1,120,500.00	
	CEZ AS	13,737	384.50	5,281,876.50	
チェココルナ 小計		19,692		13,310,716.50 (63,225,903)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	2,292	13,215.00	30,288,780.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,459	5,465.00	46,228,435.00	
	OTP BANK NYRT	16,953	5,845.00	99,090,285.00	
ハンガリーフォリント 小計		27,704		175,607,500.00 (71,489,813)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	27.15	149,759.40	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	17,245	65.40	1,127,823.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	146,497	4.63	678,281.11	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	98.30	273,863.80	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,246	54.21	663,855.66	
	SYNTHOS SA	33,750	3.94	132,975.00	
	CCC SA	1,281	117.25	150,197.25	
	LPP SA	67	5,356.70	358,898.90	
	CYFROWY POLSAT SA	11,880	20.82	247,341.60	
	EUROCASH SA	5,057	47.30	239,196.10	
	ALIOR BANK SA	2,949	55.00	162,195.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	74.01	148,760.10	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	4.69	154,849.73	
	BANK PEKAO SA	7,896	129.95	1,026,085.20	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	233.80	560,652.40	
	M BANK SA	1,802	276.90	498,973.80	
	PKO BANK POLSKI SA	49,889	22.51	1,123,001.39	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	31,920	32.10	1,024,632.00	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.19	344,523.02	
	ENEA SA	12,967	10.25	132,911.75	
	ENERGA SA	12,891	11.61	149,664.51	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	41,804	12.32	515,025.28	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	2.78	158,551.74	
ポーランドズロチ 小計		548,559		10,022,017.74 (289,135,211)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	229,000	2.55	583,950.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	5.33	554,320.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,479,400	4.17	6,169,098.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	210,500	10.88	2,290,240.00	

CNOOC LTD-R	1,021,000	7.01	7,157,210.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	162,000	5.53	895,860.00	
PETROCHINA CO LTD-H	1,262,000	4.50	5,679,000.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	3.12	349,440.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.32	788,800.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	76,500	17.48	1,337,220.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	134,000	3.33	446,220.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	8.25	684,750.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	4.16	420,160.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	3.00	597,000.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	379,000	1.88	712,520.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	5.55	688,200.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	23,500	40.45	950,575.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	239,000	6.79	1,622,810.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	85,500	14.16	1,210,680.00	
CHINA INTL MARINE CO-H	35,600	12.46	443,576.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	109,500	7.44	814,680.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	200,000	4.95	990,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	100,000	12.14	1,214,000.00	
CITIC LTD	236,000	11.46	2,704,560.00	
CRRC CORP LTD-H	234,050	7.71	1,804,525.50	
FOSUN INTERNATIONAL	126,000	10.50	1,323,000.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	9.08	317,800.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.56	598,080.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	17.90	680,200.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	68,000	6.41	435,880.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	54,400	7.45	405,280.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	39,500	37.65	1,487,175.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	147,000	8.43	1,239,210.00	
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	5.11	602,980.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	7.89	852,120.00	
CAR INC	40,000	10.42	416,800.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	160,500	3.24	520,020.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	55,513	21.55	1,196,305.15	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	220,000	1.73	380,600.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	86,000	4.92	423,120.00	
COSCO PACIFIC LIMITED-R	102,000	7.95	810,900.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	8.78	597,040.00	
SINOTRANS LIMITED-H	91,000	3.69	335,790.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.74	681,120.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	150,000	8.18	1,227,000.00	
BYD CO LTD-H	37,000	38.50	1,424,500.00	

CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	47,600	13.82	657,832.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	166,000	9.34	1,550,440.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	295,000	3.58	1,056,100.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	7.02	1,430,325.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	122,246	6.60	806,823.60	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	42,000	20.35	854,700.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	308,000	5.19	1,598,520.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	70,000	12.62	883,400.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	32,000	39.00	1,248,000.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	530,000	1.71	906,300.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	593,958	1.12	665,232.96	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	66,000	14.84	979,440.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	87,500	4.79	419,125.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	2.94	1,278,900.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	154,000	11.42	1,758,680.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	122,000	9.43	1,150,460.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	31.50	630,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	4.96	1,631,840.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	40,000	67.10	2,684,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	4.83	521,640.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	14.46	621,780.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	72,000	28.35	2,041,200.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	51,000	9.31	474,810.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	212,000	7.11	1,507,320.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	65,500	6.98	457,190.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	26,000	17.54	456,040.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	177,000	4.37	774,729.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	246,000	5.55	1,365,300.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,383,000	2.82	3,900,060.00	
BANK OF CHINA LTD-H	4,556,200	3.05	13,896,410.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	484,475	4.75	2,301,256.25	
CHINA CITIC BANK-H	503,200	4.42	2,224,144.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,835,620	4.74	22,920,838.80	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.59	800,570.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	259,423	15.14	3,927,664.22	
CHINA MINSHENG BANKING-H	335,000	6.82	2,284,700.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	3.91	543,490.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	4,249,515	4.04	17,168,040.60	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	525,000	2.46	1,291,500.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	15.42	956,040.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	172,500	5.85	1,009,125.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	141,500	15.10	2,136,650.00	

FAR EAST HORIZON LTD	141,000	6.28	885,480.00
GF SECURITIES CO LTD-H	71,600	16.92	1,211,472.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	203,600	11.32	2,304,752.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	70,600	14.32	1,010,992.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	434,000	20.80	9,027,200.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	154,800	27.55	4,264,740.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	101,824	19.22	1,957,057.28
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	48,800	27.75	1,354,200.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	369,000	3.20	1,180,800.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	224,859	13.68	3,076,071.12
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	297,500	36.55	10,873,625.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	220,000	2.18	479,600.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	229,040	23.00	5,267,920.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	173,111	18.54	3,209,477.94
CHINA VANKE CO LTD-H	75,000	17.96	1,347,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	267,285	3.00	801,855.00
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	30,700	38.80	1,191,160.00
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	295,000	5.55	1,637,250.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	8.24	566,912.00
LONGFOR PROPERTIES	73,000	10.16	741,680.00
NEW WORLD CHINA LAND LTD	170,000	7.55	1,283,500.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	65,500	11.62	761,110.00
SHUI ON LAND LTD	209,278	1.86	389,257.08
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	187,591	4.04	757,867.64
SOHO CHINA LTD	113,000	3.34	377,420.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	78,000	4.89	381,420.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	344,000	1.13	388,720.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	15.90	1,049,400.00
TENCENT HOLDINGS LTD	301,500	139.80	42,149,700.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	47,000	11.22	527,340.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	40,000	48.35	1,934,000.00
LENOVO GROUP LTD	360,000	6.84	2,462,400.00
ZTE CORP-H	48,508	14.24	690,753.92
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	140,000	4.52	632,800.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	2.74	356,200.00
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	354,500	82.80	29,352,600.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	840,000	3.56	2,990,400.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	316,000	8.66	2,736,560.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	222,000	4.67	1,036,740.00
CGN POWER CO LTD-H	490,000	2.53	1,239,700.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	84,000	9.88	829,920.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	4.66	1,178,980.00

	CHINA POWER INTERNATIONAL	208,000	3.62	752,960.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	52,000	19.50	1,014,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	113,400	13.44	1,524,096.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	158,000	2.15	339,700.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	42,000	34.15	1,434,300.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	150,000	9.60	1,440,000.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	84,000	4.66	391,440.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	6.34	1,635,720.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	1.72	526,320.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	551,000	1.08	595,080.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	1.95	1,270,750.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,214,000	0.71	861,940.00	
	香港ドル 小計	44,009,246		320,517,270.06 (4,817,374,569)	
マレーシアリン ギット	BUMI ARMADA BERHAD	307,400	0.96	295,104.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	15,300	23.72	362,916.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	282,600	1.69	477,594.00	
	LAFARGE MALAYAN BHD	26,100	8.51	222,111.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	134,400	7.19	966,336.00	
	DIALOG GROUP BHD	222,968	1.56	347,830.08	
	GAMUDA BHD	74,700	4.51	336,897.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	6.60	252,120.00	
	IJM CORP BHD	114,800	3.35	384,580.00	
	SIME DARBY BERHAD	165,542	7.24	1,198,524.08	
	AIRASIA BHD	64,800	1.37	88,776.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	5.79	310,309.26	
	MISC BHD	56,540	8.87	501,509.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	124,900	3.93	490,857.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	7.05	239,700.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	31,541	2.95	93,045.95	
	GENTING BHD	148,900	7.19	1,070,591.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	158,400	4.16	658,944.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	2.50	296,250.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	5,100	55.78	284,478.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.58	126,874.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.30	144,200.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.35	781,434.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	28,600	22.76	650,936.00	
	PPB GROUP BERHAD	20,500	15.84	324,720.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	36,000	5.90	212,400.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	115,400	6.53	753,562.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,600	3.28	231,568.00	

	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.39	571,578.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	310,887	4.04	1,255,983.48	
	HONG LEONG BANK BERHAD	26,192	13.08	342,591.36	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	13.44	200,699.52	
	MALAYAN BANKING BHD	266,295	8.33	2,218,237.35	
	PUBLIC BANK BHD-LOCAL MKT	148,320	18.18	2,696,457.60	
	RHB CAPITAL BHD	40,729	5.27	214,641.83	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	123,060	2.27	279,346.20	
	AXIATA GROUP BERHAD	148,687	6.13	911,451.31	
	DIGI.COM BERHAD	203,600	5.17	1,052,612.00	
	MAXIS BHD	90,000	6.57	591,300.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.56	462,821.12	
	PETRONAS GAS BHD	31,900	21.10	673,090.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	196,975	12.90	2,540,977.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	247,417	1.52	376,073.84	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	122,325	1.43	174,924.75	
	マレーシアリングイト 小計	4,895,397		26,666,953.03 (715,741,019)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	79,000	15.00	1,185,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	21.80	1,497,660.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	4.48	2,566,144.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	76,200	45.25	3,448,050.00	
	PTT PCL-NVDR	66,400	211.00	14,010,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	48,000	65.25	3,132,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	87,400	21.00	1,835,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	100,634	47.25	4,754,956.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	11,300	412.00	4,655,600.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	12,600	412.00	5,191,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	23,100	348.00	8,038,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	8.70	3,197,250.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	107,910	32.50	3,507,075.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	29.25	1,640,925.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	6.95	1,609,863.25	
	CP ALL PCL-NVDR	299,900	42.00	12,595,800.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	266,800	18.90	5,042,520.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	111,200	17.70	1,968,240.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	205,000	21.50	4,407,500.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	216.00	5,529,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	152.00	2,462,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	68,600	160.50	11,010,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	35,000	160.00	5,600,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	17.00	4,203,250.00	

	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	99,000	118.00	11,682,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.50	3,341,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	74,800	45.50	3,403,400.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	78.50	2,535,550.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	70,900	154.00	10,918,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	598,729	6.75	4,041,420.75	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	76.00	2,249,600.00	
	タイバーツ 小計	5,426,658		151,261,754.50 (490,088,084)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	114,690	55.15	6,325,153.50	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	139,100	14.06	1,955,746.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	12.00	4,145,400.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	132,060	62.70	8,280,162.00	
	SM INVESTMENTS CORP	8,677	800.00	6,941,600.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	8,510	57.50	489,325.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	201.40	5,125,630.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	45,910	185.10	8,497,941.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	84.50	4,429,490.00	
	BDO UNIBANK INC	79,961	95.80	7,660,263.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	41,152	69.90	2,876,524.80	
	AYALA CORPORATION	10,780	649.00	6,996,220.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	3,580	1,286.00	4,603,880.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	5.20	3,825,640.00	
	AYALA LAND INC	370,000	29.95	11,081,500.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	3.53	2,252,140.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	24.20	2,250,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	467,450	19.52	9,124,624.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,703.00	3,048,370.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	4,760	1,900.00	9,044,000.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	40.00	3,580,000.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	5.80	3,516,540.00	
	フィリピンペソ 小計	4,014,240		116,050,750.10 (292,447,890)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	461.00	369,030,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	57,100	19,400.00	1,107,740,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	134,700	10,575.00	1,424,452,500.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	7,175.00	1,005,935,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	67,900	16,075.00	1,091,492,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,625.00	694,687,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,135,700	5,925.00	6,729,022,500.00	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	473,000	870.00	411,510,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	175,700	1,455.00	255,643,500.00	

	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	292,400	2,830.00	827,492,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	125,000	17,225.00	2,153,125,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	17,275.00	345,500,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	2,865.00	1,237,966,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	16,900	55,000.00	929,500,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	18,300	93,325.00	1,707,847,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	80,500	14,300.00	1,151,150,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	248,900	5,825.00	1,449,842,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	89,100	35,900.00	3,198,690,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,365.00	1,710,891,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	682,900	13,075.00	8,928,917,500.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	3,225.00	633,712,500.00	
	BANK MANDIRI	565,298	9,375.00	5,299,668,750.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	471,600	4,960.00	2,339,136,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	637,100	11,500.00	7,326,650,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,780.00	1,216,452,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	1,050.00	1,273,650,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	453,200	1,535.00	695,662,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	3,135,800	3,110.00	9,752,338,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	5,600.00	747,040,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	3,720.00	641,700,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	2,495.00	1,974,792,500.00	
	インドネシアルピア 小計	14,821,098		68,631,237,750.00 (583,365,520)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,525	47,450.00	119,811,250.00	
	S-OIL CORPORATION	2,397	77,800.00	186,486,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,865	130,500.00	504,382,500.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,389	23,850.00	152,377,650.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	114,000.00	160,626,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,606	46,750.00	215,330,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	484	430,000.00	208,120,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	50,900.00	53,495,900.00	
	LG CHEM LTD	2,637	307,000.00	809,559,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	231,000.00	110,649,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	838	255,000.00	213,690,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	62,500.00	70,437,500.00	
	POSCO	4,445	165,500.00	735,647,500.00	
	CJ CORP	822	269,000.00	221,118,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,571	68,000.00	106,828,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	5,290.00	43,748,300.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,548	12,850.00	19,891,800.00	
	DOOSAN CORP	423	71,900.00	30,413,700.00	

DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	14,450.00	48,291,900.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	22,450.00	76,285,100.00	
HANWHA CORPORATION	2,825	32,500.00	91,812,500.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	41,050.00	155,045,850.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4,097	30,900.00	126,597,300.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,694	85,000.00	228,990,000.00	
KCC CORP	326	404,500.00	131,867,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,570	66,700.00	171,419,000.00	
LG CORP	5,640	68,100.00	384,084,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	4,559	148,500.00	677,011,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	7,429	9,840.00	73,101,360.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,110	237,500.00	501,125,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	2,484	5,070.00	12,593,880.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	98,700.00	92,876,700.00	
S-1 CORPORATION	960	93,900.00	90,144,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	952	193,000.00	183,736,000.00	
KOREA EXPRESS CO LTD	324	204,000.00	66,096,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,921	24,150.00	46,392,150.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	4,770	44,400.00	211,788,000.00	
HANON SYSTEMS	2,165	51,200.00	110,848,000.00	
HYUNDAI MOBIS	3,947	245,000.00	967,015,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	8,866	140,000.00	1,241,240,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,041	99,900.00	203,895,900.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,250	97,900.00	122,375,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	685	106,000.00	72,610,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	15,370	49,000.00	753,130,000.00	
COWAY CO.,LTD.	3,051	95,000.00	289,845,000.00	
HANSSEM CO LTD	615	260,000.00	159,900,000.00	
LG ELECTRONICS INC	6,703	54,800.00	367,324,400.00	
KANGWON LAND INC	6,490	37,600.00	244,024,000.00	
PARADISE CO LTD	1,876	15,050.00	28,233,800.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	21,200.00	107,484,000.00	
CJ E&M CORP	1,055	86,400.00	91,152,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	64,000.00	137,728,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	590	122,500.00	72,275,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	710	225,500.00	160,105,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	417	207,000.00	86,319,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	371	201,500.00	74,756,500.00	
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	29,300.00	44,565,300.00	
EMART	1,193	170,000.00	202,810,000.00	
GS RETAIL CO LTD	1,311	61,800.00	81,019,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	503	416,500.00	209,499,500.00	

KT&G CORP	5,983	108,000.00	646,164,000.00	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	31	2,400,000.00	74,400,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	45	2,271,000.00	102,195,000.00	
ORION CORP	206	1,032,000.00	212,592,000.00	
OTTOGI CORPORATION	68	1,315,000.00	89,420,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,823	380,500.00	693,651,500.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	207,000.00	146,970,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	511	966,000.00	493,626,000.00	
PACIFIC CORP	1,561	142,000.00	221,662,000.00	
CELLTRION INC	4,351	114,300.00	497,319,300.00	
HANMI PHARM CO LTD	342	753,000.00	257,526,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	565	163,000.00	92,095,000.00	
YUHAN CORPORATION	545	315,000.00	171,675,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,626	8,250.00	194,914,500.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	9,180.00	112,693,680.00	
HANA FINANCIAL GROUP	19,070	20,750.00	395,702,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	11,000.00	198,506,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	22,118	29,350.00	649,163,300.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	24,950	36,950.00	921,902,500.00	
WOORI BANK	20,802	8,350.00	173,696,700.00	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	11,786	7,700.00	90,752,200.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,255	43,700.00	98,543,500.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	3,856	20,500.00	79,048,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	8,810.00	99,535,380.00	
SAMSUNG CARD CO	1,899	30,000.00	56,970,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,909	36,600.00	106,469,400.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	2,739	67,100.00	183,786,900.00	
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	6,930.00	84,684,600.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	30,950.00	133,642,100.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,085	292,500.00	609,862,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,632	102,500.00	474,780,000.00	
KAKAO CORP	1,728	114,100.00	197,164,800.00	
NAVER CORP	1,657	670,000.00	1,110,190,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,174	230,000.00	270,020,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,785	251,500.00	448,927,500.00	
LG DISPLAY CO LTD	11,677	22,000.00	256,894,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	857	85,800.00	73,530,600.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,895	55,600.00	160,962,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,338	1,171,000.00	7,421,798,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,226	997,000.00	1,222,322,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	2,943	99,900.00	294,005,700.00	
KT CORP	3,800	27,000.00	102,600,000.00	

	LG UPLUS CORP	12,570	9,600.00	120,672,000.00	
	SK TELECOM	515	202,500.00	104,287,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	15,294	51,600.00	789,170,400.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	33,600.00	48,115,200.00	
	SK HYNIX INC	34,136	28,300.00	966,048,800.00	
	韓国ウォン 小計	485,610		35,110,683,700.00 (3,419,780,592)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	68,240	78.30	5,343,192.00	
	ASIA CEMENT CORP	132,176	25.50	3,370,488.00	
	CHINA STEEL	648,261	17.50	11,344,567.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	169,061	70.10	11,851,176.10	
	FORMOSA PLASTICS CORP	217,824	75.50	16,445,712.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	272,752	56.30	15,355,937.60	
	TAIWAN CEMENT	195,929	26.50	5,192,118.50	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	41.95	1,426,300.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	189,028	24.30	4,593,380.40	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,514	125.50	1,570,507.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	24.45	2,713,950.00	
	CHINA AIRLINES LTD	140,203	11.40	1,598,314.20	
	EVA AIRWAYS CORP	133,085	18.15	2,415,492.75	
	EVERGREEN MARINE	107,563	11.55	1,242,352.65	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	85,061	50.10	4,261,556.10	
	YULON MOTOR COMPANY	51,000	28.70	1,463,700.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,440	418.00	4,781,920.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	13,390	164.00	2,195,960.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	28.30	1,132,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	13,464	206.00	2,773,584.00	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,550	134.50	1,553,475.00	
	POU CHEN	153,780	38.85	5,974,353.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	55.80	2,056,062.60	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	14,000	335.50	4,697,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	33,544	210.00	7,044,240.00	
	STANDARD FOODS CORP	30,974	77.70	2,406,679.80	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	275,395	52.50	14,458,237.50	
	OBI PHARMA INC	6,000	616.00	3,696,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	356,129	15.10	5,377,547.90	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	865,780	7.30	6,320,194.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	970,405	15.25	14,798,676.25	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	404,720	16.50	6,677,880.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	520,504	14.45	7,521,282.80	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	279,085	14.15	3,949,052.75	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	636,339	20.00	12,726,780.00	

SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	620,573	8.43	5,231,430.39
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	493,566	10.30	5,083,729.80
TAIWAN BUSINESS BANK	501,305	7.76	3,890,126.80
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	585,340	13.00	7,609,420.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	67,429	51.10	3,445,621.90
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	411,082	37.15	15,271,696.30
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	551,153	10.25	5,649,318.25
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	480,951	35.30	16,977,570.30
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	195,968	23.15	4,536,659.20
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	6.33	3,897,830.43
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	34.05	1,434,186.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,445	39.00	1,811,355.00
ACER INC	93,803	10.70	1,003,692.10
ADVANTECH CO LTD	18,548	206.00	3,820,888.00
ASUSTEK COMPUTER INC	38,092	270.50	10,303,886.00
AU OPTRONICS CORP	590,090	9.05	5,340,314.50
CASETEK HOLDINGS LTD	9,000	145.50	1,309,500.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	41,700	232.00	9,674,400.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,366	66.30	1,880,665.80
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	552,000	9.42	5,199,840.00
COMPAL ELECTRONICS	241,760	18.05	4,363,768.00
DELTA ELECTRONICS INC	107,903	135.50	14,620,856.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	49,357	62.60	3,089,748.20
HON HAI PRECISION INDUSTRY	820,829	75.30	61,808,423.70
HTC CORPORATION	37,430	76.50	2,863,395.00
INVENTEC CO LTD	136,511	22.75	3,105,625.25
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	2,025.00	12,231,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	100,705	31.20	3,141,996.00
PEGATRON CORP	122,474	70.20	8,597,674.80
QUANTA COMPUTER INC	156,270	49.25	7,696,297.50
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	17,354	100.50	1,744,077.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	74,381	30.55	2,272,339.55
WISTRON CORP	118,448	16.75	1,984,004.00
WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	30.70	2,492,440.90
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	68.30	1,497,272.60
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	198,000	10.10	1,999,800.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	205,315	101.50	20,839,472.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	95,000	68.60	6,517,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	88,200	98.00	8,643,600.00
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	342,739	34.35	11,773,084.65
HERMES MICROVISION INC	2,000	932.00	1,864,000.00
INOTERA MEMORIES INC	192,000	28.70	5,510,400.00

	MEDIATEK INC	84,804	216.50	18,360,066.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	23,045	122.00	2,811,490.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	231.00	2,679,369.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	65.20	3,114,604.00	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	26,157	64.90	1,697,589.30	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	75.10	2,098,594.40	
	SILICONWARE PRECISION INDS	157,000	52.20	8,195,400.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,417,389	138.00	195,599,682.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	84.00	793,380.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	727,000	11.15	8,106,050.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	40.30	2,176,200.00	
	新台湾ドル 小計	19,026,323		747,990,502.02 (2,610,486,852)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	11,099	895.80	9,942,484.20	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	114.70	2,540,605.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	308.85	12,948,227.40	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	45,947	218.00	10,016,446.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	74,419	1,043.60	77,663,668.40	
	ACC LTD	1,768	1,235.30	2,184,010.40	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	191.35	7,115,349.75	
	ASIAN PAINTS LTD	12,841	845.55	10,857,707.55	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	71.85	5,677,658.85	
	JSW STEEL LTD	7,923	998.55	7,911,511.65	
	SHREE CEMENT LTD	355	9,843.00	3,494,265.00	
	TATA STEEL LTD	25,839	238.00	6,149,682.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,375	2,638.70	6,266,912.50	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	17,944	391.95	7,033,150.80	
	VEDANTA LTD	72,716	69.25	5,035,583.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	63,171	86.80	5,483,242.80	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,997	144.30	4,905,767.10	
	EICHER MOTORS LTD	653	15,823.75	10,332,908.75	
	LARSEN & TOUBRO LTD	16,488	1,122.95	18,515,199.60	
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,035.15	5,546,333.70	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	40,158	232.85	9,350,790.30	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,670	1,181.20	3,153,804.00	
	BAJAJ AUTO LTD	5,458	2,266.30	12,369,465.40	
	BHARAT FORGE LTD	6,696	790.10	5,290,509.60	
	BOSCH LTD	431	18,010.90	7,762,697.90	
	HERO MOTOCORP LTD	3,249	2,482.80	8,066,617.20	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21,465	1,152.50	24,738,412.50	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,810	4,198.15	24,391,251.50	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	16,492	249.10	4,108,157.20	

TATA MOTORS LTD	50,825	354.15	17,999,673.75	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	16,217	263.95	4,280,477.15	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	34,593	394.30	13,640,019.90	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	529	5,939.45	3,141,969.05	
ITC LTD	128,745	314.05	40,432,367.25	
NESTLE INDIA LIMITED	1,289	5,428.80	6,997,723.20	
UNITED BREWERIES LTD	4,195	840.95	3,527,785.25	
UNITED SPIRITS LTD	3,561	2,731.15	9,725,625.15	
DABUR INDIA LTD	30,963	249.55	7,726,816.65	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,799	1,207.85	7,004,322.15	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	42,185	810.45	34,188,833.25	
MARICO LTD	20,706	224.00	4,638,144.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	4,144	1,408.50	5,836,824.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	13,270	821.20	10,897,324.00	
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	308.70	3,243,202.20	
CIPLA LTD	19,928	598.05	11,917,940.40	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,388	1,070.70	5,768,931.60	
DR. REDDY'S LABORATORIES	6,281	2,915.50	18,312,255.50	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6,204	783.60	4,861,454.40	
LUPIN LTD	12,671	1,699.75	21,537,532.25	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,535	895.30	3,164,885.50	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	54,258	793.90	43,075,426.20	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	89,002	1,153.00	102,619,306.00	
ICICI BANK LTD	76,629	228.75	17,528,883.75	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	20,091	696.95	14,002,422.45	
LIC HOUSING FINANCE LTD	14,381	469.80	6,756,193.80	
STATE BANK OF INDIA	104,739	182.95	19,162,000.05	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	220.20	3,571,203.60	
POWER FINANCE CORPORATION	19,274	158.90	3,062,638.60	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	34,922	184.25	6,434,378.50	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	775.25	9,409,209.25	
HCL TECHNOLOGIES LTD	30,054	838.25	25,192,765.50	
INFOSYS LTD	106,760	1,139.65	121,669,034.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,073	2,279.30	63,986,788.90	
TECH MAHINDRA LTD	16,432	512.50	8,421,400.00	
WIPRO LTD	35,599	542.00	19,294,658.00	
BHARTI AIRTEL LTD	67,587	310.30	20,972,246.10	
BHARTI INFRATEL LTD	22,807	374.15	8,533,239.05	
IDEA CELLULAR LTD	59,982	116.70	6,999,899.40	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	53,477	73.25	3,917,190.25	
GAIL INDIA LTD	28,235	342.95	9,683,193.25	
NTPC LTD	97,417	135.15	13,165,907.55	

	TATA POWER CO LTD	93,250	64.25	5,991,312.50	
	インドルピー 小計	2,178,460		1,091,145,823.35 (1,909,505,190)	
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	10,214	20.35	207,854.90	
	INDUSTRIES QATAR	7,230	93.20	673,836.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	6,420	39.00	250,380.00	
	DOHA BANK QSC	2,020	36.90	74,538.00	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	33.25	896,021.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	84.70	498,628.90	
	QATAR NATIONAL BANK	9,722	150.90	1,467,049.80	
	QATAR INSURANCE CO	3,232	74.00	239,168.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	33.00	126,258.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	48,549	13.70	665,121.30	
	OORED00 QSC	7,280	71.90	523,432.00	
	VODAFONE QATAR	19,530	10.88	212,486.40	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	190.00	302,290.00	
	カタールリアル 小計	152,449		6,137,064.30 (198,472,659)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,692	44.50	208,794.00	
	SASOL LTD	31,671	377.85	11,966,887.35	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	190.17	607,022.64	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,367	126.88	3,599,204.96	
	GOLD FIELDS LTD	42,564	51.31	2,183,958.84	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	60,550	25.98	1,573,089.00	
	MONDI LTD	10,177	291.31	2,964,661.87	
	SAPPI LIMITED	32,518	72.08	2,343,897.44	
	BARLOWORLD LTD	12,333	56.82	700,761.06	
	BIDVEST GROUP LTD	16,598	325.00	5,394,350.00	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	134,582	71.69	9,648,183.58	
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	25,358	22.01	558,129.58	
	NASPERS LTD-N SHS	23,128	1,905.64	44,073,641.92	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	108.46	1,349,242.40	
	MR PRICE GROUP LTD	13,092	153.59	2,010,800.28	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	11,184	111.50	1,247,016.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	23,238	86.15	2,001,953.70	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	58,445	90.00	5,260,050.00	
	MASSMART HOLDINGS LTD	8,389	85.84	720,111.76	
	PICK N PAY STORES LTD	18,180	55.74	1,013,353.20	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	25,002	128.72	3,218,257.44	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	7,827	168.91	1,322,058.57	
	PIONEER FOODS LTD	8,805	132.06	1,162,788.30	
	TIGER BRANDS LTD	8,940	280.00	2,503,200.00	

	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	45,409	32.00	1,453,088.00	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	24,213	121.04	2,930,741.52	
	NETCARE LTD	60,221	31.30	1,884,917.30	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	20,636	264.20	5,452,031.20	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	25,675	129.51	3,325,169.25	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	472.00	1,520,784.00	
	NEDBANK GROUP LTD	9,337	171.00	1,596,627.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	70,030	100.54	7,040,816.20	
	BRAIT SE	20,371	155.30	3,163,616.30	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	49.22	497,318.88	
	FIRSTRAND LTD	211,218	40.00	8,448,720.00	
	INVESTEC LTD	14,580	102.75	1,498,095.00	
	PSG GROUP LTD	8,086	181.00	1,463,566.00	
	REMGRO LTD	27,640	238.53	6,592,969.20	
	RMB HOLDINGS LTD	43,247	53.25	2,302,902.75	
	DISCOVERY LIMITED	21,716	117.13	2,543,595.08	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	108.08	672,906.08	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	20.90	1,422,830.20	
	RMI HOLDINGS	40,408	36.41	1,471,255.28	
	SANLAM LTD	104,023	54.63	5,682,776.49	
	FORTRESS INCOME FUND LTD	36,400	31.60	1,150,240.00	
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	49,578	15.25	756,064.50	
	NEW EUROPE PROPERTY INVEST	10,662	176.90	1,886,107.80	
	MTN GROUP LTD	100,290	120.05	12,039,814.50	
	TELKOM SA LTD	11,353	59.25	672,665.25	
	VODACOM GROUP	21,700	143.13	3,105,921.00	
	南アフリカランド 小計	1,685,695		188,206,952.67 (1,319,330,738)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ARABTEC HOLDING CO	69,438	1.17	81,242.46	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	113,289	5.53	626,488.17	
	DUBAI ISLAMIC BANK	31,286	5.29	165,502.94	
	FIRST GULF BANK	49,802	10.95	545,331.90	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	45,082	7.20	324,590.40	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	127,997	1.06	135,676.82	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.03	551,108.46	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	73,129	2.26	165,271.54	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	194,979	4.64	904,702.56	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	94,000	15.75	1,480,500.00	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,070,484		4,980,415.25 (159,672,112)	
	合 計	131,689,514		21,011,477,801 (21,011,477,801)	

(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	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,500	604,695.00	
		KLABIN SA-UNIT	28,700	570,556.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	14,318	240,542.40	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	118,125.00	
	ブラジルレアル 小計		96,018	1,533,918.40 (44,360,920)	
投資信託受益証券合計			96,018	44,360,920 (44,360,920)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	141,600	5,028,216.00	
	メキシコペソ 小計		141,600	5,028,216.00 (32,331,428)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	345,856.50	
	トルコリラ 小計		135,630	345,856.50 (13,391,563)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	102,326	2,240,939.40	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,062,611.54	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	216,372	1,962,494.04	
		RESILIENT REIT LTD	13,040	1,407,407.20	
	南アフリカランド 小計		354,661	7,673,452.18 (53,790,899)	
投資証券合計			631,891	99,513,890 (99,513,890)	
合計				143,874,810 (143,874,810)	

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 36銘柄	100.0%	—	—	6.8%
メキシコペソ	株式 26銘柄	96.5%	—	—	4.2%
	投資証券 1銘柄	—	—	3.5%	0.2%
ブラジルレアル	株式 56銘柄	95.9%	—	—	5.0%

	投資信託受 4銘柄 益証券	—	4.1%	—	0.2%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%	—	—	1.3%
コロンビアペソ	株式 10銘柄	100.0%	—	—	0.5%
トルコリラ	株式 24銘柄	95.8%	—	—	1.4%
	投資証券 1銘柄	—	—	4.2%	0.1%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式 23銘柄	100.0%	—	—	1.4%
香港ドル	株式 142銘柄	100.0%	—	—	22.8%
マレーシアリングギット	株式 44銘柄	100.0%	—	—	3.4%
タイバーツ	株式 31銘柄	100.0%	—	—	2.3%
フィリピンペソ	株式 22銘柄	100.0%	—	—	1.4%
インドネシアルピア	株式 31銘柄	100.0%	—	—	2.8%
韓国ウォン	株式 107銘柄	100.0%	—	—	16.2%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%	—	—	12.3%
インドルピー	株式 72銘柄	100.0%	—	—	9.0%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.0%	—	—	0.9%
南アフリカランド	株式 50銘柄	96.1%	—	—	6.2%
	投資証券 4銘柄	—	—	3.9%	0.3%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 10銘柄	100.0%	—	—	0.8%

(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。

2【ファンドの現況】

【世界経済インデックスファンド】

【純資産額計算書】

（平成28年 2月29日現在）

I 資産総額	16,880,936,930円
II 負債総額	28,712,528円
III 純資産総額（I－II）	16,852,224,402円
IV 発行済口数	9,274,991,104口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.8170円
（1万口当たり純資産額）	（18,170円）

（参考）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 2月29日現在）

I 資産総額	344,229,740,216円
II 負債総額	8,918,023,457円
III 純資産総額（I－II）	335,311,716,759円
IV 発行済口数	242,348,368,654口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3836円
（1万口当たり純資産額）	（13,836円）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 2月29日現在）

I 資産総額	139,283,035,691円
II 負債総額	966,070,512円
III 純資産総額（I－II）	138,316,965,179円
IV 発行済口数	125,073,164,250口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1059円
（1万口当たり純資産額）	（11,059円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 2月29日現在）

I 資産総額	210,685,160,219円
II 負債総額	90,237,751円
III 純資産総額（I－II）	210,594,922,468円
IV 発行済口数	78,515,315,510口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.6822円
（1万口当たり純資産額）	（26,822円）

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 2月29日現在）

I 資産総額	251,538,952,826円
II 負債総額	5,752,523,190円
III 純資産総額（I－II）	245,786,429,636円
IV 発行済口数	137,954,476,633口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.7816円
（1万口当たり純資産額）	（17,816円）

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 2月29日現在）

I 資産総額	16,829,853,932円
II 負債総額	4,686,672円
III 純資産総額（I－II）	16,825,167,260円
IV 発行済口数	11,820,933,568口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.4233円
（1万口当たり純資産額）	（14,233円）

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 2月29日現在）

I 資産総額	23,113,720,107円
II 負債総額	811,925,123円
III 純資産総額（I－II）	22,301,794,984円
IV 発行済口数	11,738,332,972口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.8999円
（1万口当たり純資産額）	（18,999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。

①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。

②受益権の譲渡

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

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

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

③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。

④受益権の再分割

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

⑤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します。）に支払います。

⑥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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成28年 2月29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年にお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

①会社の意思決定機構

会社に取り締役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。

②投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

[DO（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

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

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

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

さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は平成28年 4月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年2月29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	444	7,767,216
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	29	118,366
単位型公社債投資信託	0	0
合計	473	7,885,582

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第30期事業年度の中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	10,457,599	12,314,170
前払費用	114,325	125,306
未収委託者報酬	2,735,763	4,518,944
未収運用受託報酬	15,268	—
繰延税金資産	144,183	116,728
その他	3,448	8,789
流動資産合計	13,470,589	17,083,939
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 67,359	※1 57,461
器具備品	※1 87,378	※1 116,879
有形固定資産合計	154,737	174,341
無形固定資産		
ソフトウェア	203,360	197,641
その他	4,686	7,648
無形固定資産合計	208,046	205,290
投資その他の資産		
投資有価証券	69,583	60,277
長期前払費用	34,773	5,425
長期貸付金	28,838	25,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	117,743	114,415
その他	553	463
貸倒引当金	△28,838	△25,838
投資その他の資産合計	247,653	205,581
固定資産合計	610,437	585,213
資産合計	14,081,027	17,669,152

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,353	13,868
未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
固定負債		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
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	62,500	65,500
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	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
--	---	---

営業収益		
委託者報酬	22,773,831	28,159,652
運用受託報酬	55,511	8,732
営業収益合計	22,829,342	28,168,384
営業費用		
支払手数料	10,451,296	12,922,655
広告宣伝費	76,961	130,384
公告費	—	880
調査費	5,091,105	5,994,577
調査費	259,236	279,702
委託調査費	4,830,390	5,712,946
図書費	1,479	1,928
営業雑経費	1,264,334	1,299,065
通信費	17,246	17,456
印刷費	327,214	330,921
協会費	22,524	23,182
諸会費	773	105
情報機器関連費	837,859	857,009
その他営業雑経費	58,716	70,390
営業費用合計	16,883,698	20,347,563
一般管理費		
給料	2,201,964	2,185,555
役員報酬	102,330	89,055
給料・手当	1,846,450	1,839,000
賞与	253,183	257,499
退職給付費用	72,029	71,270
役員退職慰労金	1,070	—
福利費	207,122	212,286
交際費	2,758	4,491
旅費交通費	45,973	55,788
租税公課	42,862	42,868
不動産賃借料	130,938	130,938
寄付金	3,385	—
減価償却費	119,445	129,285
諸経費	※1 219,615	※1 212,345
一般管理費合計	3,047,165	3,044,830
営業利益	2,898,479	4,775,990

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日	(自 平成26年4月 1日
	至 平成26年3月31日)	至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802
収益分配金	3,234	4,617
投資有価証券売却益	553	1,846

貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,775		1,936
営業外収益合計		16,027		18,203
営業外費用				
長期前払費用償却	※1	23,222	※1	27,866
支払補償費		14,648		7,656
投資有価証券売却損		284		117
その他		2,112		3,283
営業外費用合計		40,268		38,924
経常利益		2,874,238		4,755,269
特別損失				
外国税関連費用		—	※2	56,222
特別損失合計		—		56,222
税引前当期純利益		2,874,238		4,699,047
法人税、住民税及び事業税		1,623,332		1,667,610
法人税等調整額		△502,474		30,739
法人税等合計		1,120,857		1,698,349
当期純利益		1,753,381		3,000,697

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
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	－	1,720,381	1,723,381	1,723,381

当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
-------	--------	-----------	-----------	-----------	------------

	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	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			△30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△2,283	△2,283	△2,283
当期変動額合計	△2,283	△2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	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	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	—	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			△30,000
当期純利益			3,000,697

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
建 物	35,517	千円	45,415	千円
器具備品	188,630	〃	218,270	〃
計	224,147	〃	263,685	〃

（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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
--	--	--

諸経費	73,276	千円	37,614	千円
長期前払費用償却	23,222	〃	27,866	〃

※2外国税関連費用

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28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26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26年3月31日	平成26年6月30日

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成27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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

（リース取引関係）

該当事項はありません。

（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

①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。

②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。

③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26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	10,457,599	10,457,599	—
（2）未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	—

(3) 投資有価証券 其他有価証券	69,583	69,583	—
(4) 未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	—
(5) 未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	—

(*) 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27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	12,314,170	12,314,170	—
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	—
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	—
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	—
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	—

(*) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（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26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	—	3

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

（注3） 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26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	10,457,599	—	—	—
未収委託者報酬	2,735,763	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	7,743	21,044	—

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	12,314,170	—	—	—
未収委託者報酬	4,518,944	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	1,576	16,038	—

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成26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	61,633	57,226	4,406
小計	61,633	57,226	4,406
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	7,950	8,138	△ 188
小計	7,950	8,138	△ 188
合計	69,583	65,365	4,218

当事業年度（平成27年3月31日現在）

（単位：千円）

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

（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25年4月1日 至 平成26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
23,757	553	284

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
34,635	1,846	117

（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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付費用	72,029	71,270

(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13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	102,368	千円	64,846	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	10,277	〃	8,356	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	33,736	〃	31,368	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	111,906	〃	110,871	〃
外国税関連費用損金不算入額	—	〃	18,609	〃
その他	13,094	〃	5,855	〃
繰延税金資産 合計	271,384	〃	239,908	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	△1,503	〃	△1,546	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	△7,953	〃	△7,217	〃
繰延税金負債 合計	△9,457	〃	△8,763	〃
繰延税金資産（負債）の純額	261,926	〃	231,144	〃

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千円増加しております。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	3,172,592千円

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディ ングス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導 料の支払	73,276	—	—

(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りません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

①経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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25年4月1日 至 平成26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	6,745,672	未払 手数料	794,830
							投資助言費 用の支払	2,631,233	その他 未払金	239,120

(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

① 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。

② 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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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。

② 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26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27年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56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25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：千円)

第30期中間会計期間末

(平成27年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金 14,016,702

未収委託者報酬 5,141,677

繰延税金資産 106,209

その他流動資産 141,365

流動資産合計 19,405,955

固定資産

有形固定資産

建物 ※1 59,944

器具備品 ※1 102,740

その他有形固定資産	※1	4,207
有形固定資産合計		166,892
無形固定資産		195,428
投資その他の資産		
投資有価証券		58,796
長期貸付金		24,338
会員権		25,000
その他の投資		1,137
繰延税金資産		124,183
貸倒引当金		△ 24,338
投資その他の資産合計		209,117
固定資産合計		571,438
資産合計		19,977,393
負債の部		
流動負債		
未払金		2,781,753
未払費用		77,994
未払法人税等		1,090,560
賞与引当金		100,008
その他流動負債	※2	189,082
流動負債合計		4,239,399
固定負債		
退職給付引当金		368,901
資産除去債務		12,816
その他固定負債		3,552
固定負債合計		385,270
負債合計		4,624,670

(単位：千円)

第30期中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	68,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	12,536,088
利益剰余金合計	14,704,588
株主資本合計	15,354,588
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△1,864
評価・換算差額等合計	△1,864

純資産合計	15,352,723
負債・純資産合計	19,977,393

中間損益計算書

(単位：千円)

第30期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,237,885
営業収益合計		16,237,885
営業費用		11,383,551
一般管理費	※1	1,638,696
営業利益		3,215,638
営業外収益	※2	12,278
営業外費用		14,137
経常利益		3,213,780
税引前中間純利益		3,213,780
法人税、住民税及び事業税		1,061,497
法人税等調整額		3,185
法人税等合計		1,064,682
中間純利益		2,149,097

中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：千円)

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
中間純利益			2,149,097	2,149,097	2,149,097

株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)					
当中間期変動額合計	3,000	—	2,116,097	2,119,097	2,119,097
当中間期末残高	68,500	2,100,000	12,536,088	14,704,588	15,354,588

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726
当中間期変動額			
剰余金の配当			△30,000
中間純利益			2,149,097
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	△5,100	△5,100	△5,100
当中間期変動額合計	△5,100	△5,100	2,113,997
当中間期末残高	△1,864	△1,864	15,352,723

重要な会計方針

第30期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1. 資産の評価基準及び評価方法 有価証券 その他有価証券 時価のあるもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。) 時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。 2. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。 3. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

第30期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

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

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

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間末
(平成27年9月30日)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

建 物	49,628千円
器具備品	239,367千円
その他有形固定資産	382千円
計	289,378千円

※2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第30期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

※1 減価償却実施額

有形固定資産	26,652千円
--------	----------

無形固定資産	34,155千円
※2 営業外収益の主要項目 受取利息	3,919千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	—	—	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成27年9月30日）

平成27年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	14,016,702	14,016,702	—
(2)未収委託者報酬	5,141,677	5,141,677	—
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,793	58,793	—
(4)未払金	(2,781,753)	(2,781,753)	—
(5)未払法人税等	(1,090,560)	(1,090,560)	—

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

ます。

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（3）投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第30期中間会計期間末（平成27年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの その他	7,156	6,560	596
小計	7,156	6,560	596
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの その他	51,636	54,986	△ 3,349
小計	51,636	54,986	△ 3,349
合計	58,793	61,546	△ 2,753

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

（デリバティブ取引関係）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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

（関連情報）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,010,428千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
1株当たり純資産額	5,117,574円52銭
1株当たり中間純利益	716,365円75銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）
中間純利益	2,149,097千円
普通株式に係る中間純利益	2,149,097千円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社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28年 4月20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

①名称：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（平成27年9月末日現在）

③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27年9月末日現在）	事業の内容
----	-----------------------------	-------

ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	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。
マネックス証券株式会社	12,200	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。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みちのく銀行	34,168	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社荘内銀行	7,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社栃木銀行	27,408	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
高木証券株式会社	11,069	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北都銀行※	11,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	7,007	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。
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

※株式会社北都銀行は、職場積立NISA専用における募集・販売等の取扱いを行います。

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

- ①名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ②設立年月日 : 平成12年6月20日
- ③資本金の額 : 51,000百万円（平成27年9月末日現在）
- ④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。
- ⑤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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成27年 4月20日	有価証券届出書
平成27年 4月20日	有価証券報告書
平成27年10月20日	有価証券届出書
平成27年10月20日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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26年4月1日から平成27年3月31日までの第29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27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

※1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年3月18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

山田信之

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」に掲げられている世界経済インデックスファンドの平成27年1月21日から平成28年1月20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、世界経済インデックスファンドの平成28年1月20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. XBRL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27年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- ※ 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。